



# Geprüfter Jahresbericht und -abschluss

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. DEZEMBER 2021



**BNY MELLON**  
INVESTMENT MANAGEMENT



# INHALT

HINTERGRUND DER GESELLSCHAFT	1
BERICHT DES VERWALTUNGSRATS	3
BERICHT DER VERWAHRSTELLE	8
BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS	9
BERICHT DER ANLAGEVERWALTER	11
GLOSSAR FINANZBEGRIFFE (UNGEPRÜFT)	46
AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERBESTÄNDE	50
GESAMTERGEBNISRECHNUNG	281
BILANZ	301
VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS, DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN, PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST	319
ERLÄUTERUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS	329
BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT)	585
ANHANG 1: OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (UNGEPRÜFT)	638
ANHANG 2: ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (UNGEPRÜFT)	640
ANHANG 3: FINANZINDIZES (UNGEPRÜFT)	661
ANHANG 4: VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE-VERORDNUNG (UNGEPRÜFT)	662
VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN	665
WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)	667

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## HINTERGRUND DER GESELLSCHAFT

Die folgenden Informationen sind dem Prospekt entnommen und in Zusammenhang mit dem vollen Text und dem Definitionsabschnitt des Prospekts zu verstehen.

### STRUKTUR

Die BNY Mellon Global Funds, plc (die „Gesellschaft“) wurde in der Republik Irland am 27. November 2000 mit der Registrierungsnummer 335837 gemäß dem Companies Act 2014 (Aktiengesetz) in der jeweils gültigen Fassung als eine Aktiengesellschaft gegründet. Die Gesellschaft firmierte zum 3. Juni 2008 von Mellon Global Funds, plc in BNY Mellon Global Funds, plc um.

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft mit Umbrella-Struktur und variablem Kapital, die nach irischem

Recht mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds gegründet wurde, die einzeln als der „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet werden. Die Gesellschaft erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren und wurde in Irland von der irischen Zentralbank „Central Bank of Ireland“ (die „Zentralbank“) gemäß den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) zugelassen (die „OGAW-Vorschriften“). Die Gesellschaft umfasst aktuell zum 31. Dezember 2021 49 aktive Fonds (31. Dezember 2020: 48).

Die Historie der Fonds der Gesellschaft zum Zeitpunkt der Genehmigung des vorliegenden Berichts und Abschlusses ist wie folgt:

Fonds	Anlageverwalter	Auflegungsdatum
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	9. März 2012
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Januar 2011
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Mai 2019
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund <sup>(1)</sup>	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	10. Januar 2017
BNY Mellon Asian Equity Fund	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Asian Income Fund	Newton Investment Management Limited	9. Mai 2014
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	Newton Investment Management North America LLC*	19. Februar 2019
BNY Mellon Brazil Equity Fund	ARX Investimentos Ltd	31. August 2007
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	Newton Investment Management North America LLC	18. November 2021
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund <sup>(2)</sup>	Mellon Investments Corporation	15. Mai 2015
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Newton Investment Management North America LLC*	3. November 2017
BNY Mellon Efficient Euro High Yield Beta Fund^	Insight North America LLC*	–
BNY Mellon Efficient EM Debt Local Currency Beta Fund^	Insight North America LLC*	–
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	Insight North America LLC*	15. September 2020
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	Insight North America LLC*	10. März 2020
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	Insight North America LLC*	21. September 2020
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	Insight North America LLC*	26. September 2017
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Januar 2012
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Insight Investment Management (Global) Limited*	10. Mai 2005
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Insight Investment Management (Global) Limited*	28. April 2006
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	Insight Investment Management (Global) Limited*	27. September 2013
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	11. Dezember 2017
BNY Mellon Euroland Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited*	28. April 2003
BNY Mellon European Credit Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	12. Februar 2013
BNY Mellon Floating Rate Credit Rate Fund^	Alcentra Limited	–
BNY Mellon Future Earth Fund	Newton Investment Management Limited	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Food Fund	Newton Investment Management Limited	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Life Fund	Newton Investment Management Limited	12. Januar 2021
BNY Mellon Global Bond Fund	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Credit Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	29. Februar 2016
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Newton Investment Management Limited	5. August 2010
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	Newton Investment Management Limited	13. November 2012
BNY Mellon Global Equity Fund	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Equity Income Fund	Newton Investment Management Limited	29. Juli 2010
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Alcentra NY, LLC	11. Februar 2004
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	Newton Investment Management North America LLC*	13. August 2018

Fonds	Anlageverwalter	Auflegungsdatum
BNY Mellon Global Leaders Fund	Walter Scott & Partners Limited	7. Dezember 2016
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund <sup>(3)</sup>	Newton Investment Management Limited	10. Juli 2018
BNY Mellon Global Opportunities Fund	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Newton Investment Management Limited	8. März 2010
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Newton Investment Management Limited	14. Juni 2012
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Newton Investment Management Limited	30. Juni 2009
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	30. November 2016
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	Newton Investment Management Limited	6. Dezember 2017
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	12. Dezember 2013
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	Walter Scott & Partners Limited	4. April 2008
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	Newton Investment Management North America LLC*	1. August 2018
BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund <sup>(4)</sup>	Mellon Investments Corporation	10. Januar 2018
BNY Mellon Pan European Equity Fund <sup>(5)</sup>	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker <sup>(6)</sup>	Mellon Investments Corporation	23. März 2001
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	Newton Investment Management North America LLC*	28. April 2003
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	Newton Investment Management North America LLC*	14. Dezember 2020
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Newton Investment Management Limited	25. Februar 2019
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	Newton Investment Management Limited	6. Februar 2020
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	Insight North America LLC*	16. November 2015
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund <sup>(7)</sup>	Mellon Investments Corporation	18. September 2002
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	Newton Investment Management North America LLC*	17. Januar 2017
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Insight North America LLC*	19. April 2017
BNY Mellon U.S. Credit Select Income Fund^	Insight Investment Management (Global) Limited	–
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Insight Investment Management (Global) Limited	27. März 2021
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund**	Insight Investment Management (Global) Limited	10. Januar 2022

<sup>(1)</sup> Dieser Fonds wurde am 2. September 2020 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(2)</sup> Dieser Fonds wurde am 26. Februar 2021 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(3)</sup> Dieser Fonds wurde am 18. März 2021 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(4)</sup> Dieser Fonds wurde am 28. August 2018 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(5)</sup> Dieser Fonds wurde am 9. März 2017 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(6)</sup> Dieser Fonds wurde am 15. Januar 2021 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

<sup>(7)</sup> Dieser Fonds wurde am 5. März 2021 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

^ Dieser Fonds wurde von der Zentralbank genehmigt, aber noch nicht aufgelegt.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

\*\* Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Für jeden Fonds wird ein separater (als „Portfolio“ bezeichneter) Vermögenspool verwaltet, der im Sinne des Anlageziels des jeweiligen Fonds investiert wird, zu dem das Portfolio gehört.

Alle Fonds der Gesellschaft wurden mit Wirkung vom 9. April 2021 von der irischen Börse, die als Euronext Dublin handelt, dekotiert.

## ANLAGEZIEL

Die Vermögenswerte jedes Fonds werden separat in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik des betreffenden Fonds angelegt, die in den jeweiligen Nachträgen zum Prospekt aufgeführt sind.

## SONSTIGE WICHTIGE ANGABEN

Geprüfte Jahresberichte und -abschlüsse sowie ungeprüfte Halbjahresberichte liegen am eingetragenen Sitz der Gesellschaft oder unter [www.bnymellonim.com](http://www.bnymellonim.com) zur Einsicht aus. Sie können auch an die eingetragene Adresse der Anteilsinhaber geschickt werden.

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr vor.

### HAUPTTÄTIGKEITEN

Das Anlageziel jedes Fonds wird im Prospekt dargelegt und in den Berichten der Anlageverwalter erläutert.

### AUFGABEN DES VERWALTUNGSRATS

Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind für die Erstellung des Berichts des Verwaltungsrats und des Jahresabschlusses gemäß dem Companies Act 2014 in der jeweils gültigen Fassung verantwortlich.

Nach dem irischen Gesellschaftsrecht ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Jahresabschluss zu erstellen. Im Rahmen dieses Gesetzes hat sich der Verwaltungsrat entschieden, den Jahresabschluss gemäß dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendender Finanzberichterstattungsstandard“ („FRS 102“) zu erstellen. Nach dem Gesellschaftsrecht muss der Verwaltungsrat den Jahresabschluss nicht genehmigen, sofern er nicht davon überzeugt ist, dass er zum Ende des Geschäftsjahres ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der Finanzlage der BNY Mellon Global Funds, plc (die „Gesellschaft“) sowie der Gewinne oder Verluste der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt und die Bestimmungen des Companies Act 2014 in der jeweils gültigen Fassung erfüllt. Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat verpflichtet:

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden auszuwählen und diese konsequent anzuwenden;
- Ermessensentscheidungen zu treffen und Schätzungen vorzunehmen, die vernünftig und umsichtig sind;
- festzustellen, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt wurde, ferner diese Grundsätze zu identifizieren und die Auswirkungen und Gründe für wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen zu ermitteln und
- den Abschluss auf der Basis des Fortführungsprinzips erstellen, außer es ist nicht damit zu rechnen, dass die Gesellschaft ihre Geschäfte in absehbarer Zeit fortsetzen wird.

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass er sich bei der Erstellung des Jahresabschlusses an die vorstehenden Vorschriften gehalten hat.

### ENTSPRECHUNGSERKLÄRUNG DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat bestätigt gemäß Section 225(2) Companies Act 2014 (das „Gesetz“), dass er dafür verantwortlich ist, die Einhaltung der folgenden, in diesem Artikel definierten „relevanten Verpflichtungen“ sicherzustellen: (i) bestimmte Bestimmungen des Gesetzes, deren Verletzung einen Verstoß der Kategorie 1 oder 2 darstellt; (ii) Delikte im Zusammenhang mit schwerem Marktmissbrauch wie in Section 1368 des Gesetzes erwähnt; und (iii) die in Section 225 des Gesetzes genannten irischen Steuergesetze.

Die Gesellschaft bemüht sich im Rahmen ihrer Politik darum, die Erfüllung ihrer maßgeblichen Verpflichtungen zu gewährleisten und ein Unternehmensumfeld zu fördern, welches das Bewusstsein für eine Unternehmenskultur zur Entsprechung dieser Verpflichtungen stärkt und dieser förderlich ist (die „Compliance-Politik“).

Um der Compliance-Politik Wirkung zu verleihen, hat der

Verwaltungsrat mit Unterstützung der zuständigen Berater die relevanten Verpflichtungen herausgestellt, die seiner Ansicht nach für die Gesellschaft gelten.

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass:

- angemessene Regelungen und Strukturen eingeführt wurden (die „Compliance-Regelungen“), die seines Erachtens die wesentliche Einhaltung der relevanten Verpflichtungen der Gesellschaft sicherstellen; und
- die Compliance-Regelungen, die getroffen wurden, um die Einhaltung der relevanten Verpflichtungen durch die Gesellschaft sicherzustellen, im Laufe des Geschäftsjahres überprüft wurden.

Die Erklärung zur Compliance-Politik wird regelmäßig überprüft und kann gelegentlich ergänzt werden. Die Compliance-Regelungen werden jedes Jahr überprüft um sicherzustellen, dass die relevanten Verpflichtungen der Gesellschaft weiterhin in jeder wesentlichen Hinsicht angemessen eingehalten werden.

### RECHNUNGSLEGUNGSUNTERLAGEN

Der Verwaltungsrat ist für angemessene Rechnungslegungsunterlagen verantwortlich, die mit ausreichender Genauigkeit zu jeder Zeit die Finanzlage der Gesellschaft ausweisen und ihm die Möglichkeit geben sicherzustellen, dass der Abschluss in Übereinstimmung mit FRS 102 und unter Einhaltung des Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, und der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) und den Vorschriften der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) entspricht.

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen, mit denen sichergestellt wird, dass die Verpflichtung der Gesellschaft, angemessene Rechnungslegungsunterlagen zu führen, erfüllt wird, umfassen den Einsatz von entsprechenden Systemen und Verfahren sowie die Beschäftigung von Fachpersonal. Zu diesem Zweck wurde die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (der „Administrator“) mit der ordnungsgemäßen Führung der Rechnungslegungsunterlagen der Gesellschaft beauftragt. Die Rechnungslegungsunterlagen werden demgemäß in One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, D01E4XO, Irland, aufbewahrt. Der Verwaltungsrat ist ferner dafür verantwortlich, die Vermögenswerte der Gesellschaft zu schützen und insofern angemessene Maßnahmen zur Verhinderung und Aufdeckung von Betrug und anderen Unregelmäßigkeiten zu ergreifen. Gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank ist der Verwaltungsrat verpflichtet, die Verwahrstelle mit der sicheren Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft zu betrauen. In Ausübung dieser Pflicht hat die Gesellschaft The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin bestellt, damit diese ihr Treuhand-, Verwahr- und Depotdienstleistungen erbringt.

Der Abschluss der Gesellschaft wird auf der Website der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited ([www.bnymellonim.com](http://www.bnymellonim.com)) veröffentlicht. Der Verwaltungsrat ist für die Pflege und Richtigkeit der auf dieser Website enthaltenen Unternehmens- und Finanzinformationen der Gesellschaft verantwortlich. Die Gesetzgebung der Republik Irland, die die Erstellung und Verteilung von Abschlüssen regelt, kann von der Gesetzgebung anderer Hoheitsgebiete abweichen.

## AUSSCHÜTTUNGEN

Ausschüttungen an Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Finanzierungskosten“ erfasst.

Ausschüttungen werden wie notwendig erklärt, damit die Gesellschaft eine umfassende Ausschüttungspolitik in Übereinstimmung mit der aktuellen britischen Steuergesetzgebung verfolgen kann.

## GESCHÄFTSÜBERBLICK UND KÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die von der Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde. Die Art der Geschäfte der Gesellschaft hat sich im Verlauf des Geschäftsjahres nicht verändert.

Eine genaue Übersicht über die Faktoren, die zum Fondsergebnis beigetragen haben, ist im Bericht der Anlageverwalter enthalten. Der Verwaltungsrat rechnet nicht mit einer Änderung der Struktur oder der Anlageziele der Gesellschaft.

### Coronavirus („COVID 19“)

2020 erklärte die Weltgesundheitsorganisation den COVID-19-Ausbruch zur Pandemie. Die wirtschaftliche Erholung nach der ersten Welle der Pandemie verlief unterschiedlich. Die zeitnahe Bereitstellung mehrerer Covid-Impfstoffe verbesserte den Ausblick für Märkte. Dies führte im Laufe des Jahres 2021 zu einer allmählichen Normalisierung und in der Folge zu einer Belebung der wirtschaftlichen und sozialen Aktivitäten, was erneutes Wirtschaftswachstum erzeugte. Es bestehen jedoch eindeutige Risiken durch das Aufkommen mutierter Virusstämme der Pandemie, was zu anhaltender Marktvolatilität führen kann. Der Zugang der Teilfonds zu Liquidität könnte unter Umständen, unter denen der Liquiditätsbedarf zur Ausführung von Rücknahmeanträgen erheblich ansteigen könnte, ebenfalls beeinträchtigt werden. Weder die Gesellschaft noch die Teilfonds waren bisher mit betrieblichen Problemen konfrontiert. Die Entwicklungen werden sorgfältig überwacht.

## ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

Durch ihre Anlagetätigkeit ist die Gesellschaft verschiedenen Arten von Risiken ausgesetzt, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten verbunden sind, in denen sie investiert.

Einzelheiten zu den mit Anlagen in die Gesellschaft einhergehenden Risiken sind in Erläuterung 16 zum Abschluss dargelegt.

## ERGEBNISSE

Die Ergebnisse für das Geschäftsjahr sind in der Gesamtergebnisrechnung dargelegt.

## EREIGNISSE SEIT DEM BILANZSTICHTAG

Seit Ende des Geschäftsjahres haben sich außer den in Erläuterung 20 zum Abschluss genannten keine wichtigen Ereignisse auf die Gesellschaft ausgewirkt.

## TRANSAKTIONEN MIT UND POSITIONEN BEI NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Außer wie in Erläuterung 11 zum Abschluss angegeben, sind dem Verwaltungsrat keine bedeutenden Verträge oder Vereinbarungen bekannt, die in Verbindung mit der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft stehen und an denen zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 die Verwaltungsratsmitglieder ein wirtschaftliches Interesse gemäß Definition im Companies Act 2014 in der jeweils gültigen Fassung hatten.

## TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Gemäß Artikel 43 (1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank muss jede Transaktion, die mit der Gesellschaft von ihrer Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle und den Beauftragten oder Unterbeauftragten dieser Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (außer einer von einer Verwahrstelle bestellten Unterdepotbank, die nicht zur Unternehmensgruppe zählt) und einem verbundenen Unternehmen oder Konzernunternehmen der Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle, des Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt wird, so abgewickelt werden, als wäre sie unter marktüblichen Bedingungen ausgehandelt worden. Derartige Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilsinhaber sein. Neben diesen Transaktionen gibt es auch Transaktionen, die von verbundenen Personen im Auftrag der Gesellschaft durchgeführt werden, auf die der Verwaltungsrat keinen direkten Zugriff hat und bei denen sich der Verwaltungsrat auf Zusicherungen seiner Beauftragten verlassen muss, dass die verbundenen Personen, die solche Transaktionen ausführen, diese auf einer ähnlichen Grundlage ausführen.

Anteilhaber sollten die Governance-Struktur der Gesellschaft berücksichtigen, die insbesondere im Abschnitt „Corporate-Governance-Erklärung“ dieses Berichts des Verwaltungsrats beschrieben ist, und ferner die Aufgaben und Verantwortlichkeiten der jeweiligen Beauftragten der Gesellschaft, die der Gesamtaufsicht durch den Verwaltungsrat unterliegen. Ferner sollten Anteilhaber den Prospekt lesen, in dem viele Transaktionen mit verbundenen Personen sowie die allgemeine Beschaffenheit der vertraglichen Vereinbarungen mit den wichtigsten verbundenen Personen beschrieben sind. Dabei handelt es sich aber nicht um eine vollständige Auflistung aller Transaktionen mit verbundenen Personen. Ferner werden die Anteilhaber auf die Bestimmungen des Prospekts verwiesen, die sich mit Interessenkonflikten befassen.

Daher ist der Verwaltungsrat von BNY Mellon Management (Luxemburg) mit Blick auf die Bestätigung seitens der Verwaltungsgesellschaft und ihrer entsprechenden Beauftragten überzeugt, dass:

- (i) es geltende Vereinbarungen (welche aus schriftlichen, von den Anlageverwaltern dokumentierten Verfahren hervorgehen) gibt, um sicherzustellen, dass die vorstehend beschriebenen Verpflichtungen für sämtliche Transaktionen mit verbundenen Personen gelten; und
- (ii) die mit verbundenen Personen im Laufe des Geschäftsjahres eingegangenen Transaktionen in Übereinstimmung mit diesen Verpflichtungen durchgeführt wurden, was durch die Anlageverwalter in Form von regelmäßigen Berichten an den Verwaltungsrat bestätigt wird.

In Erläuterung 11 werden die Transaktionen mit nahestehenden Unternehmen und Personen im Geschäftsjahr gemäß den Anforderungen von Abschnitt 33 „Angaben über Beziehungen zu nahestehenden Unternehmen und Personen“ in FRS 102 dargelegt. Anteilhaber sollten jedoch beachten, dass nicht alle „verbundenen Personen“ nahestehende Unternehmen und Personen im Sinne von Abschnitt 33 des FRS 102 sind.

## CORPORATE-GOVERNANCE-ERKLÄRUNG

Die Gesellschaft unterliegt Corporate-Governance-Praktiken, die auf folgenden Dokumenten oder Vorschriften basieren:

- (i) der Gründungsurkunde und Satzung der Gesellschaft;

- (ii) dem Companies Act 2014 in der jeweils gültigen Fassung;
- (iii) den OGAW-Vorschriften der Zentralbank und
- (iv) bis zum 8. April 2021 dem Kodex der Listing-Anforderungen und -verfahren der Euronext. Alle Fonds der Gesellschaft wurden mit Wirkung vom 9. April 2021 von der Euronext Dublin handelt dekotiert.

Exemplare aller oben genannten Dokumente liegen am eingetragenen Sitz der Gesellschaft in One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, D01E4X0, Irland, zur Einsichtnahme bereit.

Am 14. Dezember 2011 veröffentlichte die Irish Funds Industry Association („IF“) einen Corporate-Governance-Kodex („IF-Code“), der auf der Website der IF ([www.irishfunds.ie](http://www.irishfunds.ie)) eingesehen werden kann und der dort erhältlich ist. Es sei darauf hingewiesen, dass der IF-Code die bestehenden Corporate Governance-Richtlinien widerspiegelt, welche für in Irland zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen gelten.

Der Verwaltungsrat hat den IF-Code geprüft und diesen Kodex am 20. Dezember 2012 übernommen, nachdem bewertet wurde, ob die im IF-Code enthaltenen Maßnahmen mit seinen bestehenden Corporate Governance-Grundsätzen und -Verfahren für das Geschäftsjahr übereinstimmen. In Übereinstimmung mit dem für Fondsgesellschaften wie die Gesellschaft geltenden aufsichtsrechtlichen Rahmen (und im Gegensatz zu normal operierenden Gesellschaften mit einer Geschäftsleitung und Mitarbeitern in Vollzeit) operiert die Gesellschaft folglich nach dem delegierten Modell, gemäß dem sie Management- (einschließlich der Anlageverwaltung), Verwaltungs- und Vertriebsaufgaben an Dritte delegiert hat, ohne dabei die Gesamtverantwortung des Verwaltungsrats abzugeben. Der Verwaltungsrat hat Mechanismen zur Überwachung der Ausübung dieser delegierten Aufgaben eingeführt, die der ständigen Aufsicht und Führung des Verwaltungsrats unterliegen. Diese Übertragung von Aufgaben und die Ernennung beaufsichtigter Dritter werden im Prospekt der Gesellschaft erläutert. Insgesamt gilt:

- (1) Laut dem Managementvertrag hat die Gesellschaft BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. zu ihrer Verwaltungsgesellschaft ernannt. Gemäß den Bestimmungen des Managementvertrags trägt die Verwaltungsgesellschaft die Verantwortung für das Management und die Verwaltung der Geschäfte der Gesellschaft sowie den Vertrieb der Anteile der Fonds. Die Verwaltungsgesellschaft ist von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) zugelassen und steht unter ihrer Aufsicht.
- (2) Die Verwaltungsgesellschaft hat die Erfüllung der Anlageverwaltungsaufgaben in Bezug auf die Gesellschaft und ihre Fonds gemäß den Erläuterungen im Prospekt und entsprechend der Aufführung im Adressenverzeichnis dieses Abschlusses an die jeweiligen Anlageverwalter übertragen.

Die jeweiligen Anlageverwalter tragen die unmittelbare Verantwortung für die Entscheidungen in Bezug auf die laufende Verwaltung der Fonds, die sie verwalten. Darüber hinaus berichten sie dem Verwaltungsrat über die Wertentwicklung der von ihnen verwalteten Fonds. Die jeweiligen Anlageverwalter verfügen über von ihnen eingeführte interne Kontroll- und Risikomanagementverfahren, die gewährleisten, dass sämtliche maßgeblichen Risiken, die in Verbindung mit der Verwaltung der Fonds durch sie stehen, jederzeit identifiziert, überwacht und verwaltet werden und gegenüber dem Verwaltungsrat regelmäßig eine angemessene Berichterstattung erfolgt. Die

Anlageverwalter werden von der Aufsichtsbehörde des jeweils zuständigen Hoheitsgebiets reguliert und unterstehen deren Aufsicht.

- (3) Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Verantwortung als Administrator, Registerführer und Übertragungsagent an den Administrator übertragen, der für die laufende Verwaltung der Gesellschaft und der Fonds, einschließlich der Berechnung der Nettoinventarwerte, verantwortlich ist. Der Administrator wird von der Zentralbank reguliert und untersteht ihrer Aufsicht; und
- (4) BNY Mellon Investment Management EMEA Limited und BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. fungieren als Vertriebsgesellschaften für die Fonds der Gesellschaft.

In Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften der Zentralbank ist der Verwaltungsrat verpflichtet, die Verwahrstelle mit der sicheren Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft zu betrauen. In Ausübung dieser Pflicht hat die Gesellschaft The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin bestellt, damit diese ihr Treuhand-, Verwahr- und Depotdienstleistungen erbringt. Das Unternehmen ist von der Europäischen Zentralbank zugelassen und steht unter der Aufsicht der Zentralbank.

Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig (mindestens vierteljährlich) Berichte von seinen beauftragten Dienstleistern und von der Verwahrstelle, auf deren Grundlage er die Leistung der beauftragten Dienstleister und der Verwahrstelle (je nach Fall) beurteilen kann.

#### **PROZESS DER FINANZBERICHTERSTATTUNG – BESCHREIBUNG DER HAUPTMERKMALE**

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Einrichtung und Aufrechterhaltung angemessener interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme für die Gesellschaft in Bezug auf den Prozess der Finanzberichterstattung. Ziel dieser Systeme ist es, das Risiko von Fehlern oder Betrug beim Erreichen der Rechnungslegungsziele der Gesellschaft zu steuern statt sie auszuschalten. Die Systeme können lediglich einen angemessenen jedoch keinen absoluten Schutz vor wesentlichen Fehldarstellungen oder Verlust bieten. Der Verwaltungsrat hat den Administrator mit der Verwaltung der Rechnungslegungsunterlagen beauftragt.

Der Verwaltungsrat verfügt per Übertragung an den Administrator über Verfahren zur Sicherstellung, dass alle relevanten Rechnungslegungsunterlagen ordnungsgemäß geführt werden und verfügbar sind, einschließlich der Erstellung von Jahres- und Halbjahresabschlüssen. Die Jahres- und Halbjahresabschlüsse der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Zentralbank eingereicht werden. Der Jahresabschluss muss darüber hinaus beim Companies Registration Office (Handelsregister) eingereicht und von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Verwaltungsrat jährlich über ihre Erkenntnisse berichten.

Der Verwaltungsrat hat eine unabhängige externe Wirtschaftsprüfungsgesellschaft beauftragt, den Jahresabschluss in Übereinstimmung mit dem Companies Act 2014 in der jeweils gültigen Fassung zu prüfen. Bei Bedarf beurteilt und erörtert der Verwaltungsrat wichtige Fragen der Rechnungslegung und Berichterstattung.

Der Administrator trägt die betriebliche Verantwortung für seine internen Kontrollen in Bezug auf das Rechnungslegungsverfahren und die Berichterstattung des Administrators an den Verwaltungsrat. Der Administrator wurde von der Zentralbank zugelassen und untersteht ihrer Aufsicht und erfüllt die Vorschriften der Zentralbank.



## VERSAMMLUNGEN DER ANTEILSINHABER

Die Einberufung und Durchführung von Versammlungen der Anteilhaber werden durch die Gründungsurkunde und Satzung der Gesellschaft und den Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, geregelt. Obgleich der Verwaltungsrat jederzeit eine außerordentliche Hauptversammlung der Gesellschaft einberufen kann, muss er innerhalb von achtzehn Monaten nach Gründung der Gesellschaft und innerhalb von fünfzehn Monaten nach dem Datum der letzten Jahreshauptversammlung eine Jahreshauptversammlung einberufen, vorausgesetzt, dass jeweils neun Monate nach Ende jedes Bilanzierungszeitraums der Gesellschaft eine Jahreshauptversammlung abgehalten wird.

Nach Maßgabe des Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, können zudem Anteilhaber, die mindestens ein Zehntel des eingezahlten Anteilskapitals der Gesellschaft repräsentieren, den Verwaltungsrat zur Einberufung einer Versammlung der Anteilhaber auffordern. Die Mitteilung über die Einberufung jeder Jahreshauptversammlung und jeder Versammlung, die zur Verabschiedung eines Sonderbeschlusses einberufen wird, muss mit einer Frist von mindestens einundzwanzig vollen Tagen an die Anteilhaber erfolgen.

Die Beschlussfähigkeit einer Hauptversammlung ist erreicht, wenn zwei Anteilhaber persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesend sind. Die Stimmabgabe kann persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter erfolgen. Per Handzeichen verfügt jeder persönlich oder mittels Stimmrechtsvertretung anwesende Anteilhaber über eine Stimme, und jeder Anteilhaber des Managements verfügt über eine Stimme für alle nicht partizipierenden Anteile. Bei einer geheimen Abstimmung hat jeder Anteilhaber eine Stimme für jeden von ihm gehaltenen partizipierenden Anteil und jeder Anteilhaber des Managements eine Stimme für alle von ihm gehaltenen nicht-partizipierenden Anteile. Der Vorsitzende einer Hauptversammlung der Gesellschaft oder mindestens fünf anwesende Anteilhaber oder ein oder mehrere Anteilhaber, die mindestens ein Zehntel der in Umlauf befindlichen Anteile repräsentieren und auf einer solchen Versammlung stimmberechtigt sind, können eine geheime Wahl beantragen.

Die Anteilhaber können beschließen, einen ordentlichen Beschluss oder einen Sonderbeschluss auf einer Anteilhaberversammlung zu genehmigen. Ein ordentlicher Beschluss der Gesellschaft oder der Anteilhaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten Klasse erfordert die absolute Mehrheit der abgegebenen Stimmen der Anteilhaber, die bei der Versammlung, im Rahmen derer der Beschluss vorgeschlagen wird, persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter ihre Stimme abgeben. Für einen Sonderbeschluss der Gesellschaft oder der Anteilhaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten Klasse, unter anderem einen Beschluss zur Änderung der Gründungsurkunde und Satzung, ist eine Mehrheit von mindestens 75 % der persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter auf der Hauptversammlung anwesenden und abstimmenden Anteilhaber erforderlich.

## ZUSAMMENSETZUNG UND ARBEIT DES VERWALTUNGSRATS UND DER AUSSCHÜSSE

Sofern auf einer Hauptversammlung durch ordentlichen Beschluss der Gesellschaft nichts anderes bestimmt ist, beträgt die Anzahl der Verwaltungsratsmitglieder mindestens zwei und höchstens zwölf. Der derzeitige Verwaltungsrat der Gesellschaft setzt sich aus vier Verwaltungsratsmitgliedern zusammen, die im Verzeichnis dieses Abschlusses aufgeführt sind.

Die Geschäftstätigkeit der Gesellschaft wird von den

Verwaltungsratsmitgliedern geleitet, die alle entsprechenden Vollmachten der Gesellschaft gemäß dem Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, oder der Satzung der Gesellschaft ausüben. Ein Verwaltungsratsmitglied kann jederzeit eine Verwaltungsratssitzung einberufen, der Gesellschaftssekretär muss auf Aufforderung des Verwaltungsrats eine Verwaltungsratssitzung einberufen. Über Fragen, die sich auf einer Sitzung des Verwaltungsrats ergeben, wird durch Stimmenmehrheit entschieden. Bei Stimmgleichheit hat der Vorsitzende eine zweite oder entscheidende Stimme. Die erforderliche Beschlussfähigkeit für die Abhandlung der Tagesordnungspunkte bei einer Verwaltungsratssitzung wird von den Verwaltungsratsmitgliedern festgelegt und ist ansonsten mit zwei Stimmen erreicht. Die wichtigsten Managementfunktionen der Verwaltungsgesellschaft werden in Übereinstimmung mit ihrem Businessplan an die designierten Verwaltungsratsmitglieder delegiert.

## DIVERSITÄTSERKLÄRUNG

In Anerkennung der Bedeutung und des Werts von Diversität hat der Verwaltungsrat im September 2019 eine Diversitätspolitik übernommen, die auf der nächsten Sitzung des Verwaltungsrats im Januar 2020 verabschiedet wurde. Diese Diversitätspolitik trägt den Vorteilen Rechnung, die eine Besetzung des Verwaltungsrats mit Personen mit unterschiedlichen Hintergründen, Erfahrungen und Ansichten mit sich bringt, einschließlich Personen, die zur Heterogenität des Verwaltungsrats beitragen. Ziel der Diversitätspolitik ist die Förderung von Vielfalt im Verwaltungsrat. Diese Diversitätspolitik wird in Zukunft umgesetzt, indem sichergestellt wird, dass Neuernennungen in den Verwaltungsrat leistungsorientiert vorgenommen werden. Dabei werden die spezifischen Fähigkeiten und Erfahrungen, die Unabhängigkeit und das Wissen berücksichtigt, die erforderlich sind, um einen vielschichtigen Verwaltungsrat und die Vorteile der Vielfalt zu gewährleisten, die jeder Kandidat in die Gesamtzusammensetzung des Verwaltungsrats einbringen würde. Seit die Diversitätspolitik angenommen wurde, gab es eine Bestellung in den und einen Rücktritt aus dem Verwaltungsrat.

## DER VERWALTUNGSRAT

Nachfolgend eine Liste mit den Namen der Personen, die während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 Mitglieder des Verwaltungsrats waren:

David Dillon (Ire)\*^

Gerald Rehn (US-Amerikaner)

Greg Brisk (Brite)

Claire Cawley (Irin)^

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

\* Vorsitzender des Verwaltungsrats.

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

## BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES GESELLSCHAFTSSEKRETÄRS

Die Verwaltungsratsmitglieder (einschließlich ihrer Angehörigen) und der Gesellschaftssekretär, Tudor Trust Limited, hielten während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 keine Beteiligungen an der Gesellschaft.

Gerald Rehn und Gregory Brisk sind Vollzeitführungskräfte der BNY Mellon Group und Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft. Sie haben auf ihren Rechtsanspruch auf eine Vergütung ihrer Tätigkeit als

Verwaltungsratsmitglieder in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 verzichtet. Im Laufe des Geschäftsjahres sind Managementgebühren in Höhe von 112.390.536 USD (31. Dezember 2020: 97.984.524 USD) entstanden.

#### **POLITISCHE SPENDEN**

In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 wurden von der Gesellschaft keine politischen Spenden gemacht.

#### **OFFENLEGUNG VON INFORMATIONEN AN DIE ABSCHLUSSPRÜFER**

Nach Kenntnis jeder Person, die zum Zeitpunkt der Genehmigung des vorliegenden Berichts Mitglied des Verwaltungsrats war, gibt es keine prüfungsrelevanten Informationen, bei denen es sich um Angaben handelt, die die Abschlussprüfer in Verbindung mit der Erstellung ihres Berichts benötigen, über die sie die Abschlussprüfer nicht in Kenntnis gesetzt haben. Jedes Verwaltungsratsmitglied hat alle Maßnahmen ergriffen, die es als Verwaltungsratsmitglied ergreifen muss, um sich sämtliche prüfungsrelevanten Informationen zu beschaffen und sicherzustellen, dass diese den Abschlussprüfern zur Verfügung gestellt werden.

#### **UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

Der Verwaltungsrat hat Ernst & Young mit Wirkung vom 2. September 2014 zu den Abschlussprüfern der Gesellschaft ernannt.

Ernst & Young haben gemäß Section 383 (2) des Companies Act 2014 ihre Bereitschaft bekundet, dieses Amt weiterhin auszuüben.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied – **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied – **Claire Cawley**

Datum: 14. April 2022

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## BERICHT DER VERWAHRSTELLE

für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021 (der „Berichtszeitraum“)

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin (die „Verwahrstelle“, „wir“, „uns“) hat in ihrer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft die Führung der Geschäfte der BNY Mellon Global Funds plc (die „Gesellschaft“) im Berichtszeitraum untersucht.

Dieser Bericht, einschließlich des Prüfungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft gemäß unserer Rolle als Verwahrstelle der Gesellschaft und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit der Erteilung dieses Prüfungsvermerks übernehmen wir keine Verantwortung in sonstiger Hinsicht oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht zur Einsichtnahme vorgelegt wird.

### AUFGABEN DER VERWAHRSTELLE

Unsere Pflichten und Aufgaben werden in Vorschrift 34 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011), in der jeweils gültigen Fassung, (die „Vorschriften“) erläutert.

Unser Bericht gibt Auskunft darüber, ob die Gesellschaft nach unserer Auffassung in diesem Berichtszeitraum in Übereinstimmung mit ihren Gründungsunterlagen (die „Gründungsurkunde und Satzung“) sowie den Vorschriften geführt wurde. Die Gesellschaft trägt die Gesamtverantwortung dafür, dass diese Bestimmungen eingehalten werden. Ist die Gesellschaft nicht dementsprechend verwaltet worden, müssen wir als Verwahrstelle angeben, inwiefern dies der Fall war, und außerdem darlegen, welche Maßnahmen wir zur Bereinigung dieser Situation ergriffen haben.

### GRUNDLAGE FÜR DEN PRÜFUNGSVERMERK DER VERWAHRSTELLE

Die Verwahrstelle nimmt alle Prüfungen vor, die sie in eigenem Ermessen für angemessen hält, um pflichtgemäß sicherzustellen, dass die Gesellschaft in jeder wesentlichen Hinsicht (i) in Übereinstimmung mit den in der Satzung und Gründungsurkunde und den betreffenden Vorschriften verankerten Anlage- und Kreditaufnahmebeschränkungen und (ii) darüber hinaus in Übereinstimmung mit der Satzung und Gründungsurkunde sowie den betreffenden Vorschriften geführt wurde.

### PRÜFUNGSVERMERK

Wir sind der Meinung, dass die Geschäfte der Gesellschaft während des Berichtszeitraums in allen wesentlichen Aspekten in Übereinstimmung mit folgenden Vorschriften geführt wurden:

- (i) gemäß den durch die Satzung und Gründungsurkunde der Gesellschaft sowie die Vorschriften festgesetzten Anlage- und Kreditaufnahmebeschränkungen der Gesellschaft und
- (ii) im Übrigen gemäß den Bestimmungen der Gründungsurkunde und der Satzung sowie den Vorschriften.

### MICHELLE MORONEY

Michelle Moroney

Für und im Namen von

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin  
Riverside 2, Sir John Rogerson's Quay, Grand Canal Dock  
Dublin 2, D02 KV60

Irland

Datum: 14. April 2022

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## BERICHT DER UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFER AN DIE GESELLSCHAFTER DER BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

### PRÜFUNGSVERMERK

Wir haben den Jahresabschluss der BNY Mellon Global Funds, plc („die Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 geprüft. Dieser umfasst die Bilanz, die Gesamtergebnisrechnung, die Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern von einlöslichen, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens und Erläuterungen zum Abschluss sowie die Zusammenfassung der wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden in Erläuterung 1. Bei der Erstellung des Abschlusses wurden die gesetzlichen Vorgaben in Irland und die Rechnungslegungsgrundsätze, einschließlich FRS 102, der im Vereinigten Königreich und in der Republik Irland anzuwendende Rechnungslegungsstandard, berücksichtigt, der vom Financial Reporting Council im Vereinigten Königreich herausgegeben wurde.

Unseres Erachtens

- vermittelt der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft zum 31. Dezember 2021 und ihres Gewinns für das dann abgelaufene Geschäftsjahr;
- wurde der Jahresabschluss ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit dem im Vereinigten Königreich und in der Republik Irland anzuwendenden Finanzberichterstattungsstandard FRS 102 erstellt und
- wurde der Jahresabschluss ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den Anforderungen des Companies Act 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 und den Vorschriften der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) von 2019 erstellt.

### GRUNDLAGE FÜR DEN PRÜFUNGSVERMERK

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Irland) (ISAs (Irland)) und geltendem Recht durchgeführt. Unsere Aufgaben gemäß diesen Grundsätzen sind im Abschnitt „Aufgaben des Abschlussprüfers im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung“ näher erläutert.

Wir sind gemäß den für unsere Prüfung von Abschlüssen in Irland maßgeblichen ethischen Anforderungen unabhängig von der Gesellschaft, unter anderem gemäß dem ethischen Standard für Unternehmen des öffentlichen Interesses, der von der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority (IAASA) herausgegeben wurde; zudem sind wir unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen Anforderungen gerecht geworden.

Wir betrachten die erlangten Prüfungsnachweise als hinreichende und angemessene Grundlage für die Erteilung unseres Prüfungsvermerks.

### SCHLUSSFOLGERUNGEN ZUM FORTFÜHRUNGSPRINZIP

Bei der Prüfung des Jahresabschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Fortführungsprinzips als Grundlage für die Erstellung des Abschlusses durch den Verwaltungsrat angemessen ist.

Auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfungshandlungen haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Zeitpunkt der Freigabe des Abschlusses zur Veröffentlichung aufwerfen können.

Unsere Aufgaben und die Aufgaben des Verwaltungsrats im Hinblick auf die Unternehmensfortführung sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhergesagt werden können, ist diese Aussage keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft zur weiteren Unternehmensfortführung.

### SONSTIGE ANGABEN

Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Angaben beinhalten die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, mit Ausnahme des Abschlusses und unseres Berichts als Abschlussprüfer darüber. Unser Prüfungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Angaben, und sofern dies nicht ausdrücklich in unserem Bericht erwähnt wird, geben wir kein Urteil mit Prüfungssicherheit dazu ab.

Unsere Aufgabe besteht darin, die sonstigen Angaben zu lesen und dabei zu prüfen, ob die sonstigen Angaben mit Blick auf den Abschluss oder die von uns bei der Prüfung oder auf sonstige Weise erlangten Kenntnisse sachlich unzutreffend sind oder andere wesentliche Fehldarstellungen enthalten. Wenn wir sachlich unzutreffende Angaben oder offensichtliche wesentliche Fehldarstellungen feststellen, müssen wir bestimmen, ob eine wesentliche Fehldarstellung im Abschluss oder eine wesentliche Fehldarstellung sonstiger Angaben vorliegt. Wenn wir auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen zu dem Schluss gelangen, dass diese sonstigen Angaben eine wesentliche Fehldarstellung enthalten, müssen wir dies berichten.

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

## VOM COMPANIES ACT 2014 VORGESCHRIEBENE STELLUNGNAHMEN ZU SONSTIGEN SACHVERHALTEN

Wir berichten ausschließlich auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen, dass nach unserer Auffassung:

- die Informationen im Bericht des Verwaltungsrats für das abgelaufene Geschäftsjahr, für das der Jahresabschluss erstellt wurde, mit dem Jahresabschluss übereinstimmen; und
- der Bericht des Verwaltungsrats in Übereinstimmung mit den geltenden gesetzlichen Anforderungen erstellt wurde.

Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für die Zwecke unserer Prüfung für notwendig erachten.

Die Rechnungslegungsunterlagen der Gesellschaft waren nach unserer Auffassung ausreichend, um jederzeit eine ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu gestatten, und die Bilanz der Gesellschaft stimmt mit den Rechnungslegungsunterlagen überein.

## SACHVERHALTE, ÜBER DIE WIR IN AUSNAHMEFÄLLEN BERICHTEN MÜSSEN

Ausgehend von unserem Wissen und Verständnis der Gesellschaft und ihres Umfelds, das wir im Rahmen unserer Prüfung erlangt haben, haben wir keine wesentlichen Fehldarstellungen im Bericht des Verwaltungsrats festgestellt.

Gemäß dem Companies Act 2014 sind wir verpflichtet, Ihnen zu berichten, wenn die Gesellschaft nach unserer Auffassung die gemäß Section 305 bis 312 vorgeschriebenen Angaben zur Vergütung und zu Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht erteilt hat.

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

## JEWELIGE AUFGABEN

### Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Abschluss

Wie ausführlicher in der Erklärung zu den Aufgaben des Verwaltungsrats auf Seite 3 dargelegt, ist der Verwaltungsrat für die Erstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den aufsichtsrechtlichen Bestimmungen zuständig. Ferner muss er sicherstellen, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt und die von ihm für notwendig erachteten internen Kontrollen bestehen, um die Erstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen Fehldarstellungen aufgrund von Betrug oder Fehlern ist.

Bei der Erstellung des Abschlusses obliegt es dem Verwaltungsrat zu prüfen, ob die Muttergesellschaft die Fähigkeit zur Unternehmensfortführung besitzt, und gegebenenfalls entsprechende Sachverhalte im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung und der Bilanzierung auf der Grundlage der Unternehmensfortführung offenzulegen, sofern die Unternehmensleitung nicht beabsichtigt, die Gesellschaft aufzulösen oder die Geschäftstätigkeit einzustellen bzw. keine realistische Alternative dazu hat.

### Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

Unser Ziel besteht darin, uns angemessene Sicherheit darüber zu verschaffen, dass der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen Fehldarstellungen aufgrund von Betrug oder Fehlern ist, und einen Bericht des Abschlussprüfers zu erstellen, der unseren Prüfungsvermerk enthält. Angemessene Sicherheit bedeutet ein hohes Maß an Sicherheit, ist jedoch keine Garantie dafür, dass eine Prüfung nach den für Irland geltenden internationalen Prüfungsstandards (ISAs) stets eine möglicherweise vorhandene wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können durch Betrug oder Fehler entstehen und gelten als wesentlich, wenn nach vernünftigem Ermessen davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die auf der Grundlage des Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Adressaten beeinflussen könnten.

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Aufgaben im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung finden Sie auf der Website der IAASA: [http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Prüfungsberichts.

### ZWECK UNSERER PRÜFUNGSHANDLUNGEN UND WEM GEGENÜBER WIR VERANTWORTLICH SIND

Unser Bericht wird ausschließlich für die Gesellschafter der Gesellschaft als Gremium in Übereinstimmung mit Section 391 des Companies Act 2014 erstellt. Unsere Prüfungshandlungen wurden ausschließlich zu dem Zweck durchgeführt, den Gesellschaftern der Gesellschaft diejenigen Sachverhalte anzugeben, zu deren Angabe im Bericht der Abschlussprüfer wir verpflichtet sind. Soweit gesetzlich zulässig, schließen wir jede Verantwortung für unsere Prüfungshandlungen, diesen Bericht und die von uns erteilten Prüfungsvermerke gegenüber anderen Personen als der Gesellschaft und ihren Gesellschaftern als Gremium aus.

## AIDAN TIERNAN

### Aidan Tiernan

Für und im Namen von Ernst & Young  
Chartered Accountants & Statutory Audit Firm  
Dublin

Datum: 22. April 2022

# BERICHTE DER ANLAGEVERWALTER^

## KONJUNKTUR- & MARKTÜBERBLICK

### Einleitung

Die 12 Monate bis Ende Dezember 2021 brachten *Aktienanlegern* bemerkenswert starke Gewinne, während *Anleiheanleger* Enttäuschungen erlebten. Die Hauptfaktoren hinter den divergierenden *Renditen* waren die Erholung des Wirtschaftswachstums und die steigende *Inflation*. Die *Aktienmärkte* erhielten Auftrieb durch die allmähliche Konjunkturerholung nach den massiven Auswirkungen der Pandemie, wenn auch die Erholung uneinheitlich blieb und durch die Covid-19-Varianten Delta und Omikron beeinträchtigt wurde. Demgegenüber wurden die *Anleihemärkte* durch die steigenden langfristigen *Inflationserwartungen* infolge der wirtschaftlichen Erholung und einen daraus resultierenden Anstieg der *Anleiherenditen* erschüttert.

Die *Aktienmärkte* legten im Jahr 2021 zu, nachdem die Covid-Impfstoffe auf den Markt kamen. Mit dem Vormarsch der Delta-Variante von Covid-19 erleben viele Länder in den Sommer- und Herbstmonaten weitere Viruswellen, wodurch sich die Aufhebung von Einschränkungen verzögerte. Als zum Jahresende hin Omikron auftrat, folgten vielerorts weitere Lockdowns und Verschärfungen der Einschränkungen, wobei sich die Märkte relativ gut behaupteten, in der wachsenden Hoffnung, dass die Omikron-Variante milder sei als Delta.

Sorgen über eine steigende *Inflation* verursachten *Volatilität* an den *Aktienmärkten*, brachten sie aber letztlich nicht zum Entgleisen, da die Zentralbanken die Märkte im Großen und Ganzen weiterhin *geldpolitisch* kräftig unterstützten. Die *Inflation* kletterte auf Niveaus, die in den meisten Volkswirtschaften seit Jahrzehnten nicht mehr erreicht wurden, da eine Kombination aus Faktoren zusammentraf: u. a. steigende Energiepreise, Engpässe in den Lieferketten, eine anziehende wirtschaftliche Nachfrage und Rekordniveaus bei den *Fiskalausgaben*. Die Debatte unter Zentralbankern drehte sich darum, ob diese Faktoren langfristig zu einer höheren *Inflation* führen würden oder ob die höheren Niveaus der *Inflation* vorübergehender Natur seien. Die Zentralbanken hatten zunächst letzteres Szenario favorisiert, aber die Hartnäckigkeit der *Inflationsdaten* im gesamten Berichtszeitraum löste bei vielen Zweifel aus. Die *Geldpolitik* blieb über den Großteil des Berichtszeitraums in den meisten Ländern expansiv, einige Zentralbanken, und insbesondere die von Südkorea, Brasilien und Neuseeland, hoben allerdings relativ schnell die Zinsen an. In den Sommermonaten 2021 ging man an den Märkten zunehmend von allmählichen Veränderungen in der *Geldpolitik* aus. Die US-Notenbank (Fed) passte ihre *Inflationserwartungen* maßgeblich an und begann, ihr Anleihekaufprogramm zu *reduzieren*. Nach reichlich Spekulationen erhöhte die Bank of England (BoE) im Dezember erstmals in über drei Jahren die Zinsen. Die *Renditen* von Staatsanleihen blieben im Vergleich zu den Niveaus zu Jahresbeginn erhöht.

Das *Bruttoinlandsprodukt (BIP)* erholte sich 2021, wenn auch die Wachstumsraten zum Jahresende hin wieder etwas nachließen, als die Welt von neuen Pandemiewellen überrollt wurde. Viele Märkte kratzten in dieser Phase an neuen Allzeithochs.

### Nordamerika

Der US-Markt entwickelte sich sehr gut. Der S&P 500, der Dow Jones Industrial Average und die Nasdaq-Indizes erreichten im Verlauf des Berichtszeitraums regelmäßig neue Höchststände, gestützt durch den wachsenden Optimismus in Bezug auf die Wirtschaft und die Erholung von Covid-19. Die erfolgreiche Wahl von Joe Biden zum US-Präsidenten Ende 2020 und eine effektive Mehrheit für die Demokraten im Kongress schufen die Voraussetzungen für mehr politische Stabilität nach der relativen *Volatilität* unter Donald Trump. Die von der Regierung Biden angekündigten enormen *fiskal- und geldpolitischen Stützungs Pakete* gaben dem Markt einen Schub. Diese Pakete konzentrierten sich auf große Infrastrukturprojekte, Maßnahmen gegen den Klimawandel und Unterstützung für einkommensschwache Familien.

Die erfolgreiche Entwicklung und Markteinführung von zwei Covid-Impfstoffen von Pfizer und Moderna in den USA trieb die Kurse von *Aktien* in den ersten Monaten des Jahres 2021 wieder deutlich nach oben. Es machte sich Optimismus breit, dass die zunehmende Durchimpfung der US-Bevölkerung eine Rückkehr zur Normalität ermöglichen würde.

Die *US-Geldpolitik* blieb über den Großteil des Berichtszeitraums akkommodierend. Zunächst waren die Märkte durch die oft wiederholte Bestätigung des Fed-Vorsitzenden Jerome Powell, dass die Zentralbank überdurchschnittliche *Inflationsniveaus* tolerieren würde und die steigende *Inflation* wahrscheinlich vorübergehender Natur seien, beruhigt. Die *Inflationsraten* schossen jedoch weiter in die Höhe und erreichten im November mit 6,8 % den höchsten Stand seit über 30 Jahren. Bis zum Herbst wurde die Fed besorgter bezüglich der Hartnäckigkeit der *Inflation* und entschied sich für eine *Reduzierung* ihres Anleihekaufprogramms mit dem Ziel, es bis Mitte März ganz einzustellen.

Die Märkte rechneten allmählich damit, dass die Fed 2022 auch zu Zinserhöhungen gezwungen sein würde, womit sie bisher nicht vor 2024 gerechnet hatte.

Die US-Konjunktur erholte sich im Berichtszeitraum weiter. Das *BIP* stieg im ersten Quartal auf annualisierter Basis um 6,3 %, im zweiten Quartal um 6,7 % und im dritten Quartal etwas bescheidener um 2,3 %. In der Zahl für das dritte Quartal spiegeln sich ein Rückgang der Nettoexporte sowie Lieferkettenengpässe in der gesamten Wirtschaft wider, welche die Produktion beeinträchtigten. Die Beschäftigungsdaten erholten sich gut. Da sich die wirtschaftlichen Bedingungen und die Geschäftstätigkeit allmählich normalisierten, sank die Arbeitslosenquote während des gesamten Berichtszeitraums kontinuierlich, von 6,4 % im Januar 2021 auf 4,2 % im November. Die wöchentlichen Erstanträge auf Arbeitslosenunterstützung fielen im November auf unter 200.000, den niedrigsten Stand seit über 50 Jahren.

## Europa

Die europäischen Märkte folgten einem ähnlichen Muster wie andere globale Märkte: Nach der Ankündigung und schließlich der Markteinführung von Covid-Impfstoffen in den ersten Monaten von 2021 setzte eine kräftige Rally ein. Obwohl im Frühjahr die dritte und vierte Pandemiewelle weitere Lockdowns erforderlich machten, legten die Märkte weiter zu, angetrieben von der optimistischen Konjunktüreinschätzungen der Anleger.

Europäische Märkte blieben geringfügig hinter dem globalen Markt zurück. Innerhalb Europas schnitt der britische Markt, der 2020 ein deutlicher Underperformer war, etwas besser ab als die Märkte Kontinentaleuropas. Österreich war der Markt mit der besten Performance, Schweden, Norwegen und die Niederlande waren indessen deutliche Outperformer. Deutschland und Spanien hinkten hinterher.

Sowohl die britische Regierung als auch die Regierung der *Eurozone* setzten die Unterstützung ihrer angeschlagenen Volkswirtschaften während des gesamten Berichtszeitraums fort. Durch ihr Pandemie-Notkaufprogramm (PEPP) unterstützte die EU weiterhin Länder in der *Eurozone*, und die Europäische Zentralbank setzte ihr Anleihekaufprogramm fort. Die EZB stimmte im Juni einer Erhöhung der Käufe zu, nachdem man ihr vorgeworfen hatte, dass sie eine Reduzierung der Käufe im Frühjahr zugelassen hatte. Sie erklärte auch, dass sie die Zinsen trotz steigender *Inflationsniveaus* nicht anheben würde, solange die Konjunkturerholung aufgrund von Covid fragil bliebe. Zum Ende des Berichtszeitraums bestätigte die EZB jedoch, dass sie ihr Pandemie-Notkaufprogramm (PEPP) im März 2022 beenden werde. Die britische Regierung verlängerte ihr Furlough-Programm bis September, was dazu beitrug, die Arbeitslosenquote relativ niedrig zu halten. Die Arbeitslosigkeit blieb tatsächlich niedrig, selbst nach Beendigung des Furlough-Programms, und die Anzahl freier Stellen stieg auf Rekordniveaus. Die BoE setzte ihr Anleihekaufprogramm fort, deutete aber weiterhin eine Zinserhöhung gegen Jahresende an, die erwartungsgemäß im Dezember mit einer Anhebung der Zinsen von 0,1% auf 0,25% erfolgte.

Die europäische Wirtschaft ohne die britische Wirtschaft erholte sich zur Jahreswende von ihrer Schwäche. Im ersten Quartal 2021 wurde eine milde Rezession bestätigt, das *BIP* schrumpfte, erholte sich aber in den folgenden zwei Quartalen mit einem Wachstum von knapp über 2% wieder. Im Vereinigten Königreich ging das *BIP* im ersten Quartal 2021 um 1,3% zurück, nachdem die Regierung Anfang Januar einen erneuten Shutdown verhängt hatte, weil sich eine zweite Pandemiewelle dramatisch über das Vereinigte Königreich ausbreitete und die Zahl der Todesfälle und Krankenhausaufenthalte neue Höchststände erreichte. Anschließend legte es im zweiten Quartal wieder um 5,4% zu, während im dritten Quartal ein bescheidenes Wachstum von 1,1% erzielt wurde. Die *Inflation* stieg in der gesamten Region auf seit Jahrzehnten nicht mehr erlebte Niveaus. Im November erreichte sie 4,9% in der *Eurozone* und 5,1% im Vereinigten Königreich.

## Asien

Die asiatischen Märkte fielen insgesamt im Berichtszeitraum, da Befürchtungen angesichts der weltweit steigenden *Inflation* und der anhaltenden Pandemie die Aktienkurse belasteten. Daran konnte auch die ermutigende Nachricht über die Markteinführung von Impfstoffen und die Erholung des regionalen und globalen Wirtschaftswachstums nichts ändern. Die beste Performance innerhalb Asiens verzeichneten Taiwan und Indien. Taiwan profitierte von einer hohen Nachfrage nach Technologiebauteilen und -produkten, die den Schwerpunkt der Wirtschaft und vieler börsennotierter Unternehmen des Landes bilden. Auch Indien erholte sich deutlich nach einer schwierigen Phase zu Jahresbeginn, in der die Covid-Fälle Rekordhöhe erreichten. China war der schwächste Markt, da die Covid-Fälle anstiegen, Probleme im Immobiliensektor sich verstärkten und verschärfte Vorschriften Sektoren der Wirtschaft mit hohem Wachstum trafen und zu langsamerem Wachstum führten. Südasiatische Märkte wie Thailand, Indonesien und die Philippinen waren relativ schwach, da ihre verbraucher- und tourismusorientierten Volkswirtschaften weiter massiv unter der Pandemie litten.

Die chinesische Wirtschaft erholte sich zunächst schnell von Covid-19. Das *BIP* verzeichnete im ersten Quartal 2021 mit 18,3% im Jahresvergleich das stärkste Wachstum seit Beginn der Aufzeichnungen im Jahr 1992. In den folgenden Quartalen schwächte sich das Wachstumstempo jedoch auf 7,9% bzw. 4,9% ab. Auch Taiwan konnte im Jahr 2020 ein gewisses Wirtschaftswachstum verbuchen, das insbesondere durch den starken Technologiezyklus begünstigt wurde. Indiens *BIP* schoss im zweiten Quartal um 20,1% im Jahresvergleich in die Höhe, was größtenteils an Basiseffekten lag, schwächte sich im dritten Quartal aber auf ein Wachstum von 8,4% ab.

In Japan blieben die Wirtschaftsdaten während weiten Teilen des Berichtszeitraums unverändert schwach. In den ersten drei Quartalen des Jahres 2021 ging das *BIP* aufgrund erneuter Lockdowns leicht zurück. Die *Inflation* blieb jedoch gedämpft und lag weit unter dem mittel- bis langfristigen offiziellen Ziel der Bank of Japan (2,0%). Bis zum Ende des Berichtszeitraums lag die Verbraucherpreis*inflation* nach 12 Monaten der Deflation wieder im positiven Bereich und stieg im November um 0,6% im Jahresvergleich. Die Bank of Japan erklärte, dass sie bis Mitte 2022 mit einer Erholung der *Inflation* auf rund 1% rechnete und an ihrer expansiven *Geldpolitik* festhalten würde. Allerdings kündigte sie zum Ende des Berichtszeitraums an, dass sie ihr Anleihekaufprogramm *reduzieren* werde.

Die *Inflation* bereitete anderen Ländern der Region zunehmend Sorge, nicht zuletzt China, wo die Erzeugerpreise im Oktober um 13,5% stiegen, der steilste Anstieg seit über 26 Jahren und ein Ausdruck steigender *Rohstoff-* und *Grundstoffpreise*.

## Festverzinsliche Wertpapiere

Die Anleihemärkte erleben in den ersten sechs Monaten von 2021 eine kräftige Verkaufswelle, die jedoch im zweiten Halbjahr abebbte. Die Renditen hatten zu Jahresbeginn angezogen, als Impfstoffe angekündigt wurden und die Anleger eine vollständige Erholung von Covid-19 im Jahr 2021 einpreisten, zogen dann jedoch im Frühjahr mit wachsender Inflationsangst weltweit drastisch an. Ein ähnlicher Anstieg fand erneut im Herbst statt. Die Renditen auf festverzinsliche Wertpapiere waren während des gesamten Berichtszeitraums negativ, insbesondere im Staatsanleihensektor, während inflationsindexierte Anleihen und Hochzinsanleihen positive Renditen lieferten und damit den Entwicklungen an den Aktienmärkten folgten.

Ein markanter Anstieg der Inflation weltweit bildete den Hintergrund für die Anleihemärkte und sorgte für steigende Renditen. Sowohl die Verbraucherpreis- als auch die Produzentenpreis-inflation stiegen auf Niveaus, die es in mehreren Industrieländern seit Jahrzehnten nicht mehr gab. Störungen auf der Angebotsseite in mehreren Sektoren, sowie steil ansteigende Großhandelspreise für Energie führen zusammen mit einem anziehenden Wirtschaftswachstum und Rekordniveaus bei Fiskalausgaben zu einer deutlich steigenden Inflation. Große Zentralbanken wie die Fed, EZB und BoE versuchten anfänglich, die Ängste vor einer steigenden Inflation zu beschwichtigen, indem sie den Standpunkt vertraten, dass der Anstieg weitgehend auf vorübergehenden Faktoren beruhe. Anleger rechneten jedoch langsam damit, dass die seit der globalen Finanzkrise vor rund 13 Jahren vorherrschende lockere Geldpolitik kurz vor ihrer Beendigung steht. Zu den ersten Zentralbanken, die im Berichtszeitraum die Zinsen anhoben, zählten Südkorea, Brasilien und Neuseeland. Im Vereinigten Königreich wurde eine Zinserhöhung zum Jahresende als wahrscheinlich erachtet, in den USA für 2022. Die BoE erhöhte zum ersten Mal seit dem Sommer 2018 die Zinsen von 0,10 % auf 0,25 %. Die Fed kündigte eine Reduzierung ihres Anleihekaufprogramms mit einem im November beginnenden Zurückfahren an, und das gesamte Programm dürfte bis März 2022 auslaufen.

Die Anleihenrenditen schnellten dramatisch in die Höhe. Die Rendite der 10-jährigen US-Treasuries verdoppelte sich nahezu von 0,9 % zum Jahreswechsel auf über 1,7 % Ende März und damit auf das höchste Niveau seit Anfang Januar 2020. Sie beendete den Berichtszeitraum bei rund 1,5%. Ebenso stieg die Rendite 10-jähriger britischer Gilts von 0,2 % Anfang 2021 auf über 0,8 % im März, erreichte im Oktober einen Höhepunkt bei 1,2 % und beendete das Jahr bei rund 1,0 %. Auch die Renditen deutscher Staatsanleihen stiegen deutlich an, blieben aber negativ.

## Währungen und Rohstoffe

Der US-Dollar machte im Laufe des Jahres 2021 wieder einen Großteil seiner Verluste von 2020 wett und stieg gegenüber den meisten wichtigen Währungen. Dies war teilweise auf die überdurchschnittlichen relativen Wachstumsraten in den USA sowie auf Erwartungen zurückzuführen, dass die Fed infolge der in die Höhe schießenden Inflation bald ihre Geldpolitik straffen müsste.

Trotz des Kampfs mit Covid-19, des erneuten Lockdowns im Januar und einer noch immer fragilen Wirtschaft legte das Pfund Sterling über den Berichtszeitraum stetig zu. Die Wirtschaft erholte sich und die Erwartungen stiegen, dass die BoE bald die Zinsen anheben müsste. Dies sorgte für einen kräftigen Anstieg des Pfund Sterling zum Ende des Berichtszeitraums. Ende 2021 erreichte es seinen höchsten Stand gegenüber dem Euro seit fast zwei Jahren.

In der Euro-Schwäche im Berichtszeitraum schlug sich die relativ schwache Erholung der Eurozone nieder. Die Eurozone rutschte im ersten Quartal in eine leichte Rezession ab, von der sie sich in den folgenden Quartalen erholte. Die EZB blieb jedoch über den größten Teil des Berichtszeitraums kategorisch dabei, dass sie die fragile Konjunkturerholung nicht mit einer Änderung der Geldpolitik gefährden würde, entschied sich dann aber schließlich für eine Beendigung ihres PEPP-Programms. Dies schwächte den Euro gegenüber dem US-Dollar und dem Pfund Sterling.

Der japanische Yen schwächte sich im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar ab, worin sich teilweise die Dollarerholung aber auch die Fragilität der Konjunkturerholung in Japan niederschlug, da das Land in vielen städtischen Gebieten wie Tokio und Osaka mit steigenden Coronavirus-Fällen konfrontiert war. Der Yen fiel zum Ende des Berichtszeitraums gegenüber dem Dollar auf seinen tiefsten Stand seit über vier Jahren.

Rohstoffe erholten sich von dem dramatischen Ausverkauf gegen Anfang 2020. Die Ölpreise waren stark, der Preis für West Texas Intermediate und Brent Crude legte im Berichtszeitraum auf über 80 USD pro Barrel zu. Die sich verbessernde Nachfrage-/Angebotsdynamik in der Industrie und der wachsende wirtschaftliche Optimismus trieben die Ölpreise auf den höchsten Stand seit mehreren Jahren. Die meisten anderen wichtigen Industriemetalle, wie Kupfer und Zink, erlebten eine ähnliche Erholung infolge einer besseren Nachfrage und der allmählichen Aufhebung von Lockdown-Beschränkungen, allerdings blieben sie volatil, größtenteils aufgrund neuer Covid-Ausbrüche.

Edelmetalle wie Gold und Silber gaben nach. Die Volatilität bei beiden Edelmetallen spiegelte die gelegentliche Flucht in „sichere Häfen“ wider, wenn sich mit dem Auftreten neuer Covid-Varianten der Konjunkturausblick wieder eintrübte.

Alle Daten zur Wertentwicklung beziehen sich, soweit nicht anders angegeben, auf die Gesamtrenditen in Landeswährungen vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021. Quelle: Lipper Hindsight und Bloomberg.



## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET

### BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro S des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -0,39 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -0,55 % für den 3-Monats-EURIBOR (der Cash-Referenzwert, der als Ziel zur Bewertung der Wertentwicklung des Fonds auf einer gleitenden 12-Monatsbasis nach Gebühren verwendet wird) und 2,44 % für den Cash-Referenzwert +3 % p.a. (der als Ziel zur Bewertung der Wertentwicklung des Fonds auf einer gleitenden annualisierten 3-Jahresbasis nach Gebühren verwendet wird), jeweils in Euro.

Der Fonds erzielte eine negative Rendite, übertraf jedoch den Cash-Referenzwert. Im Berichtsjahr stiegen die Renditen von Staatsanleihen weltweit merklich an, als zunehmende Inflationstrends große Zentralbanken veranlassten, ihre expansive Geldpolitik zu überdenken. Im Segment der Unternehmensanleihen übertrafen Hochzinsanleihen Investment-Grade-Titel. Der US-Dollar wertete auf.

Gewinne aus den Kreditstrategien des Fonds wurden durch Verluste aus seinen Zinsstrategien und aus Engagements in Schwellenländern und Fremdwährungen ausgeglichen.

Im Segment der Unternehmensanleihen schnitten bei sich verengenden Spreads Investment-Grade- und Hochzinsanleihen besonders gut ab. Die Positionen des Fonds in forderungsbesicherten Wertpapieren und, in geringerem Umfang, in Darlehen brachten ebenfalls Gewinne.

Was die Zinsengagements betrifft waren die Positionen des Fonds auf der Renditekurve der größte Negativfaktor für die Renditen (vor allem im Oktober und Dezember), da sich die Renditekurven in den Industrieländern abflachten. Mit seiner Positionierung sollte der Fonds von einer Versteilerung der Renditekurve bei deutschen Staatsanleihen und US-Treasuries profitieren. Auch das Durationsengagement des Fonds wirkte sich im Oktober und November negativ aus, weil Short-Positionen in 10-jährigen Gilts und 10-jährigen US-Treasuries gehalten wurden. Im September und Dezember dagegen lieferten diese Positionen positive Beiträge, da die Renditen anstiegen.

Der größte positive Effekt kam indessen von den Länderallokationen des Fonds. Insbesondere Long-Positionen in 20- und 30-jährigen japanischen Staatsanleihen gegenüber 30-jährigen deutschen Staatsanleihen zahlten sich im Februar aus, während Long-Positionen in 10- und 30-jährigen australischen Staatsanleihen gegenüber 10-jährigen US-Treasuries im März, November und Dezember zur Wertsteigerung beitrugen.

Das Engagement des Fonds in Schwellenländern wirkte sich im Berichtszeitraum ebenfalls negativ aus, bedingt durch Verluste aus einem Schwerpunkt auf Long-Duration-Positionen und Long-Fremdwährungs-Positionen im ersten Quartal und im Juli.

Auch die Fremdwährungspositionierung des Fonds schmälerte etwas die Performance. Ursächlich hierfür war eine Short-Position im US-Dollar, die sich im Juni als negativ erwies, da die Währung gegenüber den meisten anderen Währungen aufwertete.

In den Zinsstrategien nahm der Anlageverwalter diverse Veränderungen an der Duration, der Länderauswahl und den Positionen auf der Renditekurve vor. So wurde beispielsweise die Short-Duration-Position in Kernmärkten erhöht und eine Long-Position in China sowie eine Position auf die Abflachung der Renditekurve in japanischen Staatsanleihen eingegangen und eine Position auf die Versteilerung der Zinskurve in deutschen Staatsanleihen geschlossen.

In den Kreditstrategien behielt der Anlageverwalter die Short-Position in Investment Grade und die Long-Position in Hochzinsanleihen bei und blieb insgesamt in Unternehmensanleihen neutral.

Die Inflation in den USA bleibt erhöht, maßgeblich dafür sind Lieferkettenprobleme. Auch in der Eurozone ist neben den Auswirkungen der neuen Covid-19-Varianten auf die globale Nachfrage aufgrund der Exportabhängigkeit der Eurozone die Inflation nach wie vor ein zentrales Risiko. Nach Einschätzung des Anlageverwalters ist der mittelfristige Inflationsausblick weltweit unterschiedlich, doch die Inflationsrisiken nehmen klar zu. Dies könnte für die Europäische Zentralbank, die vielleicht nicht geneigt ist, die Zinsen zu erhöhen, problematisch werden. Kurzfristige Wachstumsrisiken gibt es in China angesichts der anhaltenden Probleme im Immobiliensektor. Und schließlich könnte die Verlagerung der globalen Nachfrage von Waren zurück zu Dienstleistungen die Exporte belasten.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Die Anteilsklasse Sterling R (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 2,17 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der Cash-Referenzwert\* eine Rendite von 0,06 %.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert. Die in den letzten 18 Monaten vorgenommenen strategischen Feinabstimmungen im Anlageprozess des Fonds gaben dem Anlageverwalter die nötige Sicherheit, um in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums das Gesamtrisiko deutlich zu erhöhen, was auch zu einer positiven Performance in diesem Zeitraum führte. Im Vorfeld der Berichtssaison für das dritte Quartal 2021 war noch unklar, welche Auswirkungen Lieferkettenprobleme und die steigende Inflation für die Unternehmen haben würden, und der Anlageverwalter reduzierte daher das Gesamtrisiko. Dieses blieb bis zum Jahresende gering, als der Markt von Unsicherheit im Zusammenhang mit Omikron erfasst wurde. Das verbesserte Absicherungsinstrumentarium stellte sicher, dass Risiken in erster Linie aus idiosynkratischen, aktienspezifischen Engagements kamen.

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND Forts.

Der größte positive Performancebeitrag kam von der Investmentgesellschaft D'leteren, nachdem neue Anleger eine Minderheitsbeteiligung an Belron, einem Spezialisten für die Reparatur von Windschutzscheiben, gekauft hatten. Dieser bildete die größte Position im *Portfolio* von D'leteren. Der größte negative Performancebeitrag kam dagegen von Knorr-Bremse, einem führenden Anbieter von Bremssystemen für die Eisenbahn- und LKW-Branche. Der Gründer und Mehrheitsaktionär des Konzerns verstarb, was für eine gewisse Unsicherheit hinsichtlich der künftigen strategischen Richtung sorgte. Die Position wurde durch eine Kombination aus dem europäischen *Index* für den Industriesektor und einem führenden Hersteller von Schienenfahrzeugen und Signalanlagen *abgesichert*. Der Anlageverwalter trennte sich im Berichtszeitraum sowohl von seiner Position in Knorr-Bremse als auch von deren *Absicherung*.

Die Covid-19-Pandemie birgt noch Risiken, ebenso das Potenzial, dass *geldpolitische* Fehler Turbulenzen an den *Anleihemärkten* verursachen, wenn die US-Notenbank beginnt, ihre *geldpolitischen Stimuli* einzustellen. Allerdings verbinden sich beschleunigte Veränderungen an den Geschäftsmodellen infolge der Pandemie nun mit bedeutenden Verschiebungen der Marktdynamiken, wodurch sich nach Einschätzung des Anlageverwalters die Chancen für die Performance der *Aktienauswahl* verbessern. Nach einem Jahrzehnt günstiger Finanzbedingungen, die zu der Dominanz von *volatilitätsarmen* Strategien geführt hatten, treten nun innerhalb der *Aktienmärkte* wieder stärkere Divergenzen auf. Vor diesem Hintergrund würde der Anlageverwalter eine Erhöhung des Gesamtengagements in Betracht ziehen.

\*SONIA 30 Tage aufgezinnt. Mit Wirkung vom 1. November 2021 wechselte der Referenzwert von der GBP London Interbank Offered Rate (LIBOR) zur Sterling Overnight Index Average (SONIA). Alle Angaben zur Wertentwicklung des Referenzwerts in der Vergangenheit vor diesem Datum wurden im Vergleich zum GBP-LIBOR berechnet.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Die Anteilsklasse Euro U (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 0,91 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR eine *Rendite* von -0,56 %, jeweils in Euro.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen *Referenzwert*. *Risikoanlagen* hatten ein weiteres starkes Jahr, unterstützt durch den Roll-out von Covid-19-Impfprogrammen und anhaltende umfangreiche *geld- und fiskalpolitische Stützungsmaßnahmen* von Zentralbanken und Regierungen, besonders in den USA. Allerdings nahm die *Volatilität* im Laufe des Berichtszeitraums merklich zu, und die *Inflation* wurde bei steigenden Energiepreisen und anhaltenden Lieferkettenproblemen hartnäckiger. Dies veranlasste die großen Zentralbanken, die *geldpolitische* Straffung einzuleiten. Die *Anleiherenditen* stiegen an, was Wachstumsaktien wie z. B. Technologieunternehmen belastete. Hinzu kam die Unsicherheit angesichts der Ausbreitung der Covid-19-

Varianten Delta und Omikron, die in einigen Ländern zu regelmäßigen Verhängungen von Einschränkungen führten. Die globale Emissionstätigkeit bei *Wandelanleihen* blieb das Jahr über erhöht und verteilte sich gleichmäßig auf die Regionen. Die *Duration* des Fonds reduzierte sich, als der Anlageverwalter angesichts der anziehenden *Inflation* die *Absicherungen* gegen höhere Zinsen verstärkte. Die geografische Allokation blieb relativ statisch.

Insgesamt blieb die *Portfoliozusammensetzung* gut *diversifiziert*, ohne dass ein einzelner Sektor dominierte. Der Anlageverwalter stockte jedoch selektiv Positionen in den Sektoren Technologie, künstliche Intelligenz, Unternehmenssoftware, Industriewerkstoffe und nicht-zyklische Konsumgüter auf.

Das *Aktienengagement* des Fonds war gezielt mit kleinen *Long-Positionen* in bestimmten Unternehmen, wobei der Fonds in den meisten Titeln neutral blieb, um einen etwaigen Anstieg der *Volatilität* mitnehmen zu können. Insgesamt war das Engagement in Einzeltiteln fast vollständig *abgesichert*, das Risiko lag bei +/- 1 %. Zum 31. Dezember 2021 hatte der Fonds eine kleinere Anzahl an Positionen, deren Aussichten nach Einschätzung des Anlageverwalters das beste Risiko-Rendite-Verhältnis boten. Die *Brutto-Leverage* stieg mit der strategischen Neuausrichtung geringfügig an (und lag zum Jahresende bei 160 %). Der Anlageverwalter verstärkte zudem die *Aktienabsicherungen* in Richtung Risikoaversion.

Das größte Engagement des Fonds in *Unternehmensanleihen* konzentriert sich auf die hochwertigsten Unternehmen, die implizite *Spreads* nahe oder unter 50 *Basispunkten* aufweisen. Das *Portfolio* ist fest verankert mit soliden *Unternehmensanleihen*, engen *Aktienabsicherungen* und typischer *Diversifizierung*.

Für 2022 sieht der Anlageverwalter in *Zyklikern* und Unternehmen, die von der Wiedereröffnung der Wirtschaft profitieren, zwei Bereiche, die sich gut entwickeln könnten. Episoden von *Volatilität* dürften dabei aber weiterhin auftreten. Nach Einschätzung des Anlageverwalters könnte die Strategie des Fonds einer starken Positionierung in *Unternehmensanleihen* vor diesem Hintergrund hilfreich sein.

Der *Wandelanleihemarkt* bietet ein Spektrum an Sektoren, *Unternehmensanleihen* und zahlreichen *Volatilitätsprofilen*. Möglicherweise war der Markt seit Anfang der 2000er Jahre nicht so ausgewogen, was Sektorchancen betrifft. Manche Positionen könnten an steigenden *Aktienkursen* partizipieren, andere von fallenden *Aktienkursen* profitieren, während wiederum andere auf *Renditen* aus *Volatilität* ausgerichtet sind.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Der Fonds wurde am 18. November 2021 aufgelegt.

Im Zeitraum seit Auflegung des Fonds bis zum 31. Dezember 2021 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds eine Rendite von -1,00 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des FTSE 3 Month US T Bill Index 0,01 % betrug, jeweils in US-Dollar.

Die Rendite des Fonds war leicht negativ. Die globalen Aktienmärkte erholten sich von ihrer Schwächephase Ende November und zeigten sich angesichts mehrerer potenzieller Gegenwinde robust. Im Segment Aktien erzielten Substanzwerte (Value-Aktien) (die nach Performancemaßstäben wie Gewinn, Umsatz, Buchwert und Cashflow billig sind) eine gute Performance und profitierten von höheren Kursen. Auch der Carry auf festverzinsliche Wertpapiere (Kupon auf die Anleihen minus Zinskosten für die kurzfristige Kreditaufnahme) trug positiv zur Wertentwicklung bei, während Momentum (Kauf von Aktien, die bereits gestiegen sind, in der Erwartung, dass sie weiter steigen) eine Underperformance brachte.

Der Fonds ist so positioniert, dass er die Renditen in einer transparenten, liquiden und kostengünstigen Weise diversifiziert. Der Fonds hat das Potenzial, über den gesamten Konjunkturzyklus Renditen zu erzielen und traditionelle Engagements zu diversifizieren. Er strebt an, ein breites Spektrum an Hedgefonds-Faktoren durch direkte Anlagen in globalen Märkten und allen Anlageklassen, sowohl long als auch short, abzudecken.

Newton Investment Management North America LLC  
Januar 2022

### BNY MELLON DYNAMIC TOTAL RETURN FUND

Der Fonds wurde am 26. Februar 2021 geschlossen.

Die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds erzielte im Berichtszeitraum bis zur Schließung des Fonds eine Rendite von -0,08 % in US-Dollar, nach Abzug von Gebühren.

Defensive Vermögenswerte schmälerten aufgrund einer Long-Position in US-Anleihen die Performance. Die Renditekurve in den USA versteilerte sich im ersten Quartal erheblich, da der Vorschlag eines Infrastrukturplans mit einem Volumen von 2,3 Bio. USD, fiskalische Anreize und die Erwartung einer kräftigen Konjunkturerholung die Inflationserwartungen steigen ließ. Die Rendite 10-jähriger US-Treasuries legte im ersten Halbjahr zu. Short-Positionen in deutschen und britischen Staatsanleihen machten Rendite wett.

Eine hohe Risikobereitschaft kam Wachstumswerten zugute, und eine Long-Position in US-Aktien lieferte den größten Beitrag zur Performance. US-Aktien setzten ihre Rally fort und erreichten im Berichtszeitraum Allzeithochs. Alle Sektoren verzeichneten Zugewinne; der Outperformer war der Energiesektor, nachdem die Ölpreise auf Dreijahreshochs gestiegen waren. Aktien aus der Eurozone und dem Vereinigten Königreich trugen zur Wertschöpfung bei; beide Märkte profitierten von einer Berichtssaison mit kräftigen Gewinnen und einer beschleunigten Markteinführung von Impfstoffen.

Den zu Diversifizierungszwecken gehaltenen Anlagen war die rückläufige Volatilität im Berichtszeitraum zuträglich. Auch die Währungsallokationen trugen positiv zur Performance bei; eine Short-Position im Euro und eine Long-Position im Pfund Sterling lieferten die größten Beiträge zur Rendite. Bei realen Vermögenswerten trugen Long-Positionen in Mais und Sojaöl positiv zu den Renditen bei. Eine unerwartet geringe Nutzung der Anbauflächen brachten den Maispreisen Unterstützung, während die gestiegene Nachfrage nach Pflanzenölen die Preise für Sojaöl nach oben trieb.

Mellon Investments Corporation  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL MULTI – ASSET INCOME FUND

Der Fonds wurde am 18. März 2021 geschlossen.

Die Anteilsklasse Euro A (Inc) des Fonds erzielte im Berichtszeitraum bis zur Schließung des Fonds eine Rendite von 5,78 %, nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 60:40-Referenzwert (60 % MSCI AC World NR, 40 % ICE BofA Global Broad Market EUR Hedged Index) eine Rendite von 3,05 %.

Newton Investments Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 6,69 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a. eine Rendite von 3,43 %, jeweils in Euro.

Das Portfolio erzielte eine positive Rendite und übertraf den Referenzwert. Dieses Ergebnis war in erster Linie Risikoanlagen zu verdanken, insbesondere globale Aktien, und zwar sowohl, was den Umfang der von dieser Anlageklasse erzielten Gewinne betrifft, als auch die Entscheidung, das ganze Jahr über eine hohe Allokation in dieser Anlageklasse zu halten. Die größten positiven Beiträge auf Einzeltitelebene kamen von einem Mix aus langfristigen Wachstumsunternehmen (Accenture, Alphabet und Microsoft) und Positionen, die stärker konjunktur- bzw. marktabhängig sind (ConocoPhillips und Goldman Sachs), was die unterschiedlichen Rotationsphasen innerhalb der Aktienindizes im Jahresverlauf widerspiegelt. Die größten negativen Beiträge kamen von Unternehmen mit China-Bezug, wie Alibaba und Tencent Music, deren Underperformance größtenteils die Folge verstärkter regulatorischer Eingriffe war. Der andere wesentliche Performancefaktor im renditeorientierten Kern des Portfolios waren alternative Anlagen. Hier stammten die Beiträge aus einem breiten Spektrum an Engagements, u.a. in Rohstoffen, erneuerbaren Energien und Energiespeicherung sowie Risikoprämienstrategien, die Ineffizienzen im Markt ausnutzen sollen.

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR) Forts.

Die stabilisierenden Vermögenswerte des *Portfolios* schmälerten im Berichtszeitraum die Performance. Angesichts des Potenzials für seltene Ereignisrisiken wie neue Covid-19-Varianten wurde die *Aktienabsicherung* durch *Derivate* in unterschiedlichem Maße das ganze Jahr über beibehalten, und da die *Indizes* stiegen, verursachte dies dem Fonds Kosten. Allerdings waren diese Positionen hilfreich, um die *Volatilität* im Griff zu behalten, und vor dem Hintergrund der hohen Gewinne im *renditeorientierten* Kern des *Portfolios* waren die Gesamtkosten beherrschbar.

Das Engagement in *Risikoanlagen* und insbesondere in globalen *Aktien* blieb über den Berichtszeitraum relativ hoch, und das Engagement abzüglich *Derivate* wurde bis zum letzten Quartal des Berichtszeitraums verstärkt. Der Anlageverwalter reduzierte im Oktober das *Aktienengagement* wieder, nachdem die kräftigen Kursanstiege bei *Aktien* die niedrigen Kurse von Ende September wieder wettgemacht hatten. Unter den anderen *renditeorientierten* Anlageklassen wurden im Geschäftsjahr Unternehmens- und *Schwellenländeranleihen* reduziert, da angesichts der *Spread*-Verengung und der allgemein vorsichtigen Einschätzung des Anlageverwalters zu den *Anleiherenditen* ihr Risiko-/Ertragsprofil weniger attraktiv wurde. Diese Sichtweise, unterstützt durch eine positive *makroökonomische* Einschätzung und die Erwartung, dass sich die *Inflation* auf einem höheren (aber nicht dramatisch höheren) Niveau einpendeln wird, veranlasste den Anlageverwalter im April, aus *Staatsanleihen* der Industrieländer auszusteigen, womit das Engagement des Fonds in dieser Anlagenklasse zum ersten Mal seit 2008 bei null lag. Der Anlageverwalter verkaufte die Goldpositionen des Fonds, die eine ähnlich langfristige Komponente des *Portfolios* gewesen waren. Nach Ansicht des Anlageverwalters hatte Gold seinen Zweck erfüllt, auf *geldpolitische Stimuli* zu reagieren und die drohende *Inflation* vorwegzunehmen, war aber dann anfällig für ein Umfeld steigender *Realrenditen* geworden, welche den US-Dollar stärkten.

Der Anlageverwalter sieht den Konjunkturausblick weitgehend positiv und bleibt daher relativ fest in *renditeorientierten* Anlagen engagiert. Dabei behält er jedoch im Blick, dass *Aktien* seit März 2020 überdurchschnittliche *Renditen* erzielt haben und hier wohl kein leichtes Geld mehr zu machen sein dürfte. Zudem müssen, wenn die Zentralbanken in den Modus der *quantitativen Straffung* schalten, die *Aktienmärkte* selbständiger werden. Glücklicherweise sind die Aussichten für das Wachstum der *Gewinne* ermutigend, wenn auch dieser positive Effekt teilweise durch eine Herabstufung (eine Veränderung der Anlegerstimmung dahingehend, dass fallende *Aktienkurse* erwartet werden) unter einigen der Covid-19-„Gewinner“ gedämpft werden könnte, wenn sich die wirtschaftlichen und *geldpolitischen* Bedingungen normalisieren. Unter diesen Rahmenbedingungen sind niedrigere *Indexrenditen* zu erwarten, und der Fonds kann durchaus einer höheren *Volatilität* ausgesetzt sein; der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass es sich auszahlen wird, selektiver vorzugehen.

Mangels *Staatsanleihen* konzentrierten sich die stabilisierenden Vermögenswerte auf direkte Absicherungen am *Aktienmarkt* sowie Liquidität, wobei der Anlageverwalter für 2022 diesen Teil des *Portfolios* um diverse *defensive* Strategien bereichern will, die attraktive Renditen bringen können, wenn *Risikoanlagen* in Turbulenzen geraten sollten.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Die Anteilsklasse Sterling C (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 6,46 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der *Referenzwert\** eine *Rendite* von 4,06 %, jeweils in Pfund Sterling.

Das *Portfolio* erzielte eine positive *Rendite* und übertraf den *Referenzwert*. Dieses Ergebnis war in erster Linie *Risikoanlagen* zu verdanken, insbesondere globalen *Aktien*, und zwar sowohl, was den Umfang der von dieser Anlageklasse erzielten Gewinne betrifft, als auch die Entscheidung, das ganze Jahr über eine hohe Allokation in dieser Anlageklasse zu halten. Die größten positiven Beiträge auf Einzeltitelebene kamen von einem Mix aus langfristigen Wachstumsunternehmen (Accenture, Alphabet und Microsoft) und Positionen, die stärker konjunktur- bzw. marktabhängig sind (ConocoPhillips und Goldman Sachs), was die unterschiedlichen Rotationsphasen innerhalb der *Aktienindizes* im Jahresverlauf widerspiegelt. Die größten negativen Beiträge kamen von Unternehmen mit China-Bezug, wie Alibaba und Tencent Music, deren Underperformance größtenteils die Folge verstärkter regulatorischer Eingriffe war. Der andere wesentliche Performancefaktor im *renditeorientierten* Kern des *Portfolios* waren *alternative Anlagen*. Hier stammten die Beiträge aus einem breiten Spektrum an Engagements, u.a. in *Rohstoffen*, erneuerbaren Energien und Energiespeicherung sowie *Risikoprämienstrategien*, die Ineffizienzen im Markt ausnutzen sollen.

Die stabilisierenden Vermögenswerte des *Portfolios* schmälerten im Berichtszeitraum die Performance. Angesichts des Potenzials für seltene Ereignisrisiken wie neue Covid-19-Varianten wurde die *Aktienabsicherung* durch *Derivate* in unterschiedlichem Maße das ganze Jahr über beibehalten, und da die *Indizes* stiegen, verursachte dies dem Fonds Kosten. Allerdings waren diese Positionen hilfreich, um die *Volatilität* im Griff zu behalten, und vor dem Hintergrund der hohen Gewinne im *renditeorientierten* Kern des *Portfolios* waren die Gesamtkosten beherrschbar.

Das Engagement in *Risikoanlagen* und insbesondere in globalen *Aktien* blieb über den Berichtszeitraum relativ hoch, und das Engagement abzüglich *Derivate* wurde bis zum letzten Quartal des Berichtszeitraums verstärkt. Der Anlageverwalter reduzierte im Oktober das *Aktienengagement*, nachdem die kräftigen Kursanstiege die niedrigen Kurse von Ende September wieder wettgemacht hatten.

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

#### Forts.

Unter den anderen renditeorientierten Anlageklassen wurden im Geschäftsjahr Unternehmens- und *Schwellenländeranleihen* reduziert, da angesichts der *Spread*-Verengung und der allgemein vorsichtigen Einschätzung des Anlageverwalters zu den *Anleiherenditen* ihr Risiko-/Ertragsprofil weniger attraktiv wurde. Diese Sichtweise, unterstützt durch eine positive *makroökonomische* Einschätzung und die Erwartung, dass sich die *Inflation* auf einem höheren (aber nicht dramatisch höheren) Niveau einpendeln wird, veranlasste den Anlageverwalter im April, aus *Staatsanleihen* der Industrieländer auszusteigen, womit das Engagement des Fonds in dieser Anlagenklasse zum ersten Mal seit 2008 bei null lag. Der Anlageverwalter verkaufte die Goldpositionen, die eine ähnlich langfristige Komponente des *Portfolios* gewesen waren. Nach Ansicht des Anlageverwalters hatte Gold seinen Zweck erfüllt, auf *geldpolitische Stimuli* zu reagieren und die drohende *Inflation* vorwegzunehmen, war aber dann anfällig für ein Umfeld steigender *Realrenditen* geworden, welche den US-Dollar stärkten.

Der Anlageverwalter sieht den Konjunkturausblick weitgehend positiv und bleibt daher relativ fest in *renditeorientierten* Anlagen engagiert. Dabei behält er jedoch im Blick, dass *Aktien* seit März 2020 überdurchschnittliche *Renditen* erzielt haben und hier wohl kein leichtes Geld mehr zu machen sein dürfte. Zudem müssen, wenn die Zentralbanken in den Modus der *quantitativen Straffung* schalten, die *Aktienmärkte* selbständiger werden. Glücklicherweise sind die Aussichten für das Wachstum der *Gewinne* ermutigend, wenn auch dieser positive Effekt teilweise durch eine Herabstufung (eine Veränderung der Anlegerstimmung dahingehend, dass fallende *Aktienkurse* erwartet werden) unter einigen der Covid-19-„Gewinner“ gedämpft werden könnte, wenn sich die wirtschaftlichen und *geldpolitischen* Bedingungen normalisieren. Unter diesen Rahmenbedingungen sind niedrigere *Indexrenditen* zu erwarten, und der Fonds kann durchaus einer höheren *Volatilität* ausgesetzt sein; der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass es sich auszahlen wird, selektiver vorzugehen.

Mangels *Staatsanleihen* konzentrierten sich die stabilisierenden Vermögenswerte auf direkte Absicherungen am *Aktienmarkt* sowie Liquidität, wobei der Anlageverwalter für 2022 diesen Teil des *Portfolios* um diverse *defensive* Strategien bereichern will, die attraktive Renditen bringen können, wenn *Risikoanlagen* in Turbulenzen geraten sollten.

\*SONIA (30 Tage aufgezinnt) + 4% p.a. Mit Wirkung vom 1. November 2021 wechselte der *Referenzwert* von der GBP London Interbank Offered Rate (LIBOR) zur Sterling Overnight Index Average (SONIA). Alle Angaben zur Wertentwicklung des *Referenzwerts* in der Vergangenheit vor diesem Datum wurden im Vergleich zum GBP-LIBOR berechnet.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 6,08% nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der *Referenzwert\** eine *Rendite* von 4,09%, jeweils in US-Dollar.

Das *Portfolio* erzielte eine positive *Rendite* und übertraf den *Referenzwert*. Dieses Ergebnis war in erster Linie *Risikoanlagen* zu verdanken, insbesondere globale *Aktien*, und zwar sowohl, was den Umfang der von dieser Anlageklasse erzielten Gewinne betrifft, als auch die Entscheidung, das ganze Jahr über eine hohe Allokation in dieser Anlageklasse zu halten. Die größten positiven Beiträge auf Einzeltitelebene kamen von einem Mix aus langfristigen Wachstumsunternehmen (Accenture, Alphabet und Microsoft) und Positionen, die stärker konjunktur- bzw. marktabhängig sind (ConocoPhillips und Goldman Sachs), was die unterschiedlichen Rotationsphasen innerhalb der *Aktienindizes* im Jahresverlauf widerspiegelt. Die größten negativen Beiträge kamen von Unternehmen mit China-Bezug, wie Alibaba und Tencent Music, deren Underperformance größtenteils die Folge verstärkter regulatorischer Eingriffe war. Der andere wesentliche Performancefaktor im *renditeorientierten* Kern des *Portfolios* waren *alternative Anlagen*. Hier stammten die Beiträge aus einem breiten Spektrum an Engagements, u.a. in *Rohstoffen*, erneuerbaren Energien und Energiespeicherung sowie *Risikoprämienstrategien*, die Ineffizienzen im Markt ausnutzen sollen.

Die stabilisierenden Vermögenswerte des *Portfolios* schmälerten im Berichtszeitraum die Performance. Angesichts des Potenzials für seltene Ereignisrisiken wie neue Covid-19-Varianten wurde die *Aktienabsicherung* durch *Derivate* in unterschiedlichem Maße das ganze Jahr über beibehalten, und da die *Indizes* stiegen, verursachte dies dem Fonds Kosten. Allerdings waren diese Positionen hilfreich, um die *Volatilität* im Griff zu behalten, und vor dem Hintergrund der hohen Gewinne im *renditeorientierten* Kern des *Portfolios* waren die Gesamtkosten beherrschbar.

Das Engagement in *Risikoanlagen* und insbesondere in globalen *Aktien* blieb über den Berichtszeitraum relativ hoch, und das Engagement abzüglich *Derivate* wurde bis zum letzten Quartal des Berichtszeitraums verstärkt. Der Anlageverwalter reduzierte im Oktober das *Aktienengagement* wieder, nachdem die kräftigen Kursanstiege bei *Aktien* die niedrigen Kurse von Ende September wieder wettgemacht hatten. Unter den anderen *renditeorientierten* Anlageklassen wurden im Geschäftsjahr Unternehmens- und *Schwellenländeranleihen* reduziert, da angesichts der *Spread*-Verengung und der allgemein vorsichtigen Einschätzung des Anlageverwalters zu den *Anleiherenditen* ihr Risiko-/Ertragsprofil weniger attraktiv wurde. Diese Sichtweise, unterstützt durch eine positive *makroökonomische* Einschätzung und die Erwartung, dass sich die *Inflation* auf einem höheren (aber nicht dramatisch höheren) Niveau einpendeln wird, veranlasste den Anlageverwalter im April, aus *Staatsanleihen* der Industrieländer auszusteigen, womit das Engagement des Fonds in dieser Anlagenklasse zum ersten Mal seit 2008 bei null lag.

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD) Forts.

Der Anlageverwalter verkaufte die Goldpositionen des Fonds, die eine ähnlich langfristige Komponente des *Portfolios* gewesen waren. Nach Ansicht des Anlageverwalters hatte Gold seinen Zweck erfüllt, auf *geldpolitische Stimuli* zu reagieren und die drohende *Inflation* vorwegzunehmen, war aber dann anfällig für ein Umfeld steigender *Realrenditen* geworden, welche den US-Dollar stärkten.

Der Anlageverwalter sieht den Konjunkturausblick weitgehend positiv und bleibt daher relativ fest in *renditeorientierten Anlagen* engagiert. Dabei behält er jedoch im Blick, dass *Aktien* seit März 2020 überdurchschnittliche *Renditen* erzielt haben und hier wohl kein leichtes Geld mehr zu machen sein dürfte. Zudem müssen, wenn die Zentralbanken in den Modus der *quantitativen Straffung* schalten, die *Aktienmärkte* selbständiger werden.

Glücklicherweise sind die Aussichten für das Wachstum der *Gewinne* ermutigend, wenn auch dieser positive Effekt teilweise durch eine Herabstufung (eine Veränderung der Anlegerstimmung dahingehend, dass fallende *Aktienkurse* erwartet werden) unter einigen der Covid-19-„Gewinner“ gedämpft werden könnte, wenn sich die wirtschaftlichen und *geldpolitischen* Bedingungen normalisieren. Unter diesen Rahmenbedingungen sind niedrigere *Indexrenditen* zu erwarten, und der Fonds kann durchaus einer höheren *Volatilität* ausgesetzt sein; der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass es sich auszahlen wird, selektiver vorzugehen.

Mangels *Staatsanleihen* konzentrierten sich die stabilisierenden Vermögenswerte auf direkte Absicherungen am *Aktienmarkt* sowie Liquidität, wobei der Anlageverwalter für 2022 diesen Teil des *Portfolios* um diverse defensive Strategien bereichern will, die attraktive *Renditen* bringen können, wenn *Risikoanlagen* in Turbulenzen geraten sollten.

\*SOFR (30 Tage aufgezinnt) + 4 % p.a. Mit Wirkung vom 1. November 2021 wechselte der *Referenzwert* von der USD London Interbank Offered Rate (LIBOR) zur Secured Overnight Financing Rate (SOFR). Alle Angaben zur Wertentwicklung des *Referenzwerts* in der Vergangenheit vor diesem Datum wurden im Vergleich zum USD-LIBOR berechnet.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 8,24 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der *Referenzwert*, der zu 60 % aus dem MSCI AC World NR Index und zu 40 % aus dem JP Morgan Global GBI Unhedged TR Index besteht, eine *Rendite* von 8,06 %, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine positive *Rendite* und übertraf seinen *Referenzwert*. Der größte positive *Aktienbeitrag* zu den *Renditen* des Fonds kam von Applied Materials. Die *Aktien* des Unternehmens legten zu, als gemeldet wurde, dass Taiwan Semiconductor eine Erhöhung seiner Investitionen plane (was sich positiv auf den Umsatz von Applied Materials auswirkt). Hinzu kam eine positive *Gewinndynamik*. Auch Accenture lieferte nach ermutigenden Umsatz- und *Gewinnwachstumsprognosen* eine gute Performance. Das Unternehmen erfreut sich einer hohen Nachfrage, insbesondere nach seinen Dienstleistungen in den Bereichen Cloud Engineering, Cybersicherheit und Daten. Alphabet trug positiv bei, nachdem das Unternehmen mit starken Gewinnzahlen die Markterwartungen übertroffen hatte. Auch Sony lieferte eine gute Performance und profitierte von starken Quartalsergebnissen und der erfolgreichen Markteinführung seiner PlayStation Showcase 2021. In einem Umfeld mit hoher Nachfrage nach Elektrofahrzeugen kam die Position in dem Lithiumproduzenten Albemarle der Performance zugute.

Die *Alibaba-Aktien* zeigten aufgrund anhaltender Befürchtungen wegen der regulatorischen Verschärfungen in China Schwäche. Die Versicherer Ping An Insurance of China und AIA litten beide unter Sorgen wegen einer stärkeren regulatorischen Kontrolle der Versicherungsbranche und negativer Stimmung in Bezug auf das chinesische Finanzsystem. Suzuki Motor zählte zu den Underperformern, da der Automobilsektor weiter Unterbrechungen wegen der Halbleiterknappheit verzeichnete.

In puncto *Portfolioveränderungen* kaufte der Anlageverwalter die HDFC Bank, die größte Privatbank Indiens, hinzu. Sie ist gut positioniert auf dem indischen Bankenmarkt mit einer sehr bekannten Marke, einer überragenden Kundenzufriedenheit und einer starken Erfolgsbilanz bei Wachstum und Risikomanagement. Ferner wurde eine Position in dem Personaldienstleister Hays aufgebaut. Hays ist gut positioniert, um von einem *zyklischen* Aufschwung in seinem gut *diversifizierten* Branchen- und Länder-Mix zu profitieren. Langfristig besteht die Chance, dass Hays seine bisherigen Gewinnrekorde übertrifft. Des Weiteren wurde eine Position in dem Pharmaunternehmen AstraZeneca aufgebaut. Das Unternehmen hat ein erfolgreiches Portfolio an Onkologiemedikamenten mit einem beeindruckenden Wachstumsausblick. Zu den weiteren Zukäufen zählten der Hersteller von papierbasierten Verpackungen Smurfit Kappa und Barclays.

Der Anlageverwalter entschied sich für einen Ausstieg aus Merck, weil der Wachstumsausblick für das Unternehmen immer weniger überzeugte. Die *Aktien* des japanischen Industrieunternehmens Ebara wurden nach einer starken Performance verkauft. Auch die Position in Royal Dutch Shell wurde aufgelöst, da das Energieunternehmen von Disruption betroffen ist und nach seiner Entscheidung, seine duale *Aktienstruktur* zu beenden und seinen Steuersitz wieder in das Vereinigte Königreich zu verlegen, möglicherweise eine hohe Steuerstrafe zahlen muss. Weitere Positionen, die verkauft wurden, sind Naspers, Continental, Novartis, Brenntag und Samsung Electronics.

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND Forts.

Da die Entwicklung der *Anleiherenditen* eine wesentliche Determinante für die *Aktienmärkte* sein dürfte, behält der Anlageverwalter einen ausgewogenen Ansatz im Fondsmanagement bei und berücksichtigt dabei die rapiden Veränderungen der Rahmenbedingungen und die *Volatilität*, die einsetzen könnte, wenn der Markt auf die Einstellung der *geldpolitischen Stimuli* der Zentralbanken reagiert. Der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass unter anderem Technologie, Energiewende, *Geopolitik*, Demografie und Lieferketten eine tiefgreifende Auswirkung auf die Weltwirtschaft haben und auf viele Branchen als disruptive Kräfte wirken werden.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 7,26% nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des 1-Monats-EURIBOR +4 % p.a. bei 3,43 %, jeweils in Euro.

Der *renditeorientierte* Kern des Portfolios war im Berichtszeitraum der wichtigste *Renditetreiber*, denn er profitierte erheblich von der starken Performance globaler *Aktien*. ASML war dank hoher Ausgaben im Halbleiterssektor, welche die Auftragsbücher des Unternehmens kräftig füllten, einer der stärksten Performer im Portfolio. Wachstumsaktien wie Alphabet, Accenture und Microsoft erzielten eine starke Performance. Allgemeine *makroökonomische* Bedenken hinsichtlich Chinas führten dazu, dass die Unternehmen mit China-Bezug im Fonds die *Renditen* schmälerten. Alibaba, Tencent Music Entertainment, Ping An Insurance und AIA Group zählten vor diesem Hintergrund alle zu den Verlierern. Ebenfalls im *renditeorientierten* Kern leisteten *alternative Anlagen* einen positiven Beitrag. Hier zahlte sich dank steigender Energiepreise das Engagement in erneuerbaren Energien aus. Schwellenländeranleihen belasteten in sehr geringem Ausmaß.

Die stabilisierenden Vermögenswerte sowie *Absicherungspositionen* des Fonds brachten eine negative *Rendite*, was vor allem auf die schwächere Performance aus der *Währungsabsicherung* und aus *derivativen* Instrumenten zurückgeht. Die Absicherung mit *Derivaten* war so strukturiert, dass sie von einem Markteinbruch profitiert hätte, der dann nicht im erwarteten Ausmaß eintrat. Das Engagement des Fonds in Gold belastete ebenfalls die *Renditen*, da die *Anleiherenditen* und der US-Dollar stiegen.

In puncto Portfolioveränderungen nahm der Anlageverwalter im ersten Halbjahr Novozymes und Thermo Fisher ins Portfolio auf. Das Engagement im Bankensektor wurde verstärkt, indem die bestehende Position in JP Morgan aufgestockt und Morgan Stanley neu ins Portfolio aufgenommen wurde. Eine weitere größere Veränderung war der Verkauf von Zurich Insurance zugunsten einer neuen Position in Chubb, da nach Einschätzung des Anlageverwalters Chubb ein höheres *Gewinnwachstum* liefern könnte.

Zwei neue Positionen wurden im Industriesektor aufgebaut: Hubbell und Trane Technologies. Hubbell, ein Anbieter von Elektrozubehör für Gewerbe- und Kraftwerkskunden, profitiert von Investitionen im Rahmen der Energiewende und vom allgemeinen Elektrifizierungstrend. Trane Technologies, ein führender Anbieter von Klimaanlageanlagen, spielt ebenfalls eine Rolle bei der Reduzierung der Emissionen, und seine jüngste Produktgeneration hat das Potenzial für attraktive Renditen.

Im Segment *alternative Anlagen* führte der Anlageverwalter ein neues Engagement in CO<sub>2</sub>-Zertifikaten der EU ein, da eine Verschärfung der gesetzlichen Rahmenbedingungen für CO<sub>2</sub>-Emissionen den Marktpreis für CO<sub>2</sub> in die Höhe treiben könnte.

Die Position stabilisierender Vermögenswerte wurde verkleinert. Die *Long*-Position des Fonds in 10-jährigen US *Treasury Futures* wurde in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums verkauft. Auch die Goldposition des Fonds wurde verkauft, da steigende *Renditen* von Staatsanleihen und ein aufwertender US-Dollar wohl die Attraktivität des Edelmetalls einschränken werden. Und schließlich erneuerte der Anlageverwalter *Put-Optionen* zur Absicherung gegen Ereignisrisiken.

Der Anlageverwalter sieht den Konjunkturausblick weiterhin weitgehend positiv und bleibt daher in erheblichem Umfang in *renditeorientierten* Anlagen engagiert. Der Anlageverwalter sieht bei den aktuellen *Renditen*niveaus in allen außer den düstersten Szenarien kaum Wertschöpfungsmöglichkeiten bei *Staatsanleihen*. Mangels *Staatsanleihen* konzentrierten sich die stabilisierenden Vermögenswerte auf direkte Absicherungen am *Aktienmarkt* sowie Liquidität, wobei der Anlageverwalter für 2022 diesen Teil des Teilfonds um diverse *defensive* Strategien bereichern will, die positive *Renditen* bringen können, wenn *Risikoanlagen* in Turbulenzen geraten sollten.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

## ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

### BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds eine Rendite von -1,31% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -1,98% für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond Global USD, jeweils in US-Dollar.

*Festverzinsliche Anlagen* aus Industrieländern gerieten im ersten Quartal des Jahres stark unter Druck, und die Renditen 10-jähriger Titel stiegen in den letzten drei Monaten um fast 80 Basispunkte an. Die Renditen längerfristiger US-Treasuries erreichten zu Beginn des Frühjahrs ihren Höhepunkt, beendeten aber den Berichtszeitraum auf etwas niedrigeren Niveaus.

Der Fonds startete mit einem erheblichen Maß an Risiko in das Jahr, das sich in etwa gleichmäßig auf Spread-Sektoren und Zinsmärkte verteilte. Im ersten Quartal 2021 zogen die US-Renditen kräftig an, während die Spreads relativ stabil blieben. Im zweiten Quartal kehrte sich dieser Trend um, als sich die Zinsen auf eine neue, höhere Spanne einpendelten und die Spreads auf Risikoanlagen enger wurden. Hochverzinsliche Unternehmensanleihen (High Yield) erzielten eine Outperformance gegenüber Investment-Grade-Titeln. Eine Ausnahme von diesem Trend bildeten die Schwellenländer. Sorgen angesichts von Wachstumsabschwächung und steigender Inflation setzten Schwellenländeranleihen, und innerhalb der Anlageklasse insbesondere Hochzinsanleihen, erheblich unter Druck.

Im Laufe des zwölfmonatigen Berichtszeitraums verlagerte der Fonds seine deutliche Übergewichtung von Spread-Produkten, insbesondere bei US-Hochzins-Unternehmensanleihen, zu einer neutralen Gewichtung. Hierfür beschnitt der Fonds in beträchtlichem Ausmaß seine Positionen in Hartwährungs- und Investment-Grade-Unternehmensanleihen. Diese Umstellung fand allmählich über den gesamten Jahresverlauf statt. In dem Maße, wie die Risiken in Spread-Sektoren nachließen, erhöhte sich das aktive Zinsrisiko innerhalb des Fonds. Zum Jahresende war der Fonds effektiv neutral gewichtet in Risikoanlagen und deutlich untergewichtet in der Duration von Industrieländern.

Der Anlageverwalter geht davon aus, dass die Zinsen in den Industrieländern weltweit unter Druck bleiben werden, da die Inflation überraschend stark steigt und die Marktpreise mit den Preisen konvergieren, die die US-Notenbank in ihrem „Summary of Economic Projections“ angedeutet hat. In Europa rechnet der Anlageverwalter damit, dass hohe Arbeitslosigkeit und bescheidenes Lohnwachstum dafür sorgen könnten, dass die Europäische Zentralbank sich bequem zurücklehnen kann, wenn die Inflation im Frühjahr ihren Höhepunkt erreicht und dann möglicherweise wieder zurückgeht. Nach Meinung des Anlageverwalters wird die wirtschaftliche Entwicklung in Asien von China und dem Streben von Präsident Xi Jinping nach „allgemeinem Wohlstand“ bestimmt sein; dies wird sich auf die gesamte Region auswirken.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

## Globale Aktienmärkte

### BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 16,51% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 18,54% für den MSCI AC World NR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive Rendite, hielt aber nicht mit seinem Referenzwert Schritt. Während sich die Aktienausswahl positiv auf die Renditen des Fonds im Vergleich zum Referenzwert auswirkte, schmälerten die Sektor- und Länderallokation die Performance. Top-Performer bei Aktien war Applied Materials. Das Unternehmen profitierte von der Nachricht, dass Taiwan Semiconductor für 2021 eine Erhöhung seiner Investitionen plane, sowie von einer positiven Gewinndynamik durch die hohe Nachfrage nach Halbleiterausstattung. Alphabet trug positiv bei, nachdem das Unternehmen mit starken Gewinnzahlen die Markterwartungen übertroffen hatte. Goldman Sachs legte dank kräftiger Gebühreneinnahmen sowie steigender Inflation und Zinserwartungen eine gute Performance an den Tag. Microsoft entwickelte sich ebenfalls gut, der Quartalsumsatz übertraf die Prognosen, wobei sich die Stärke auf das gesamte Unternehmen erstreckte.

Die Aktien der Alibaba Group zeigten aufgrund anhaltender Befürchtungen wegen der regulatorischen Verschärfungen in China Schwäche. Die Versicherer Ping An Insurance und AIA Group litten unter Sorgen wegen einer stärkeren regulatorischen Kontrolle der Versicherungsbranche und negativer Stimmung in Bezug auf das chinesische Finanzsystem. Gedämpfte Gewinnprognosen von Continental, größtenteils bedingt durch die negativen Auswirkungen des globalen Chip-Mangels auf die Automobilproduktion, bescherten der Aktie eine Underperformance.

In puncto Portfolioveränderungen gab es im Geschäftsjahr zwei wichtige Neuzugänge: Novozymes, ein dänisches Enzym- und Industrie-Biotechnologieunternehmen, und TE Connectivity, ein führendes Unternehmen im Bereich Verbindungstechnik. Letzteres wurde später im Jahr aufgrund seines Engagements in der Elektrofahrzeugbranche ins Portfolio aufgenommen. Es wurde eine Position in CooperCompanies aufgebaut (ein weltweit führendes Unternehmen auf dem Kontaktlinsenmarkt). Das Unternehmen weist Potenzial für nachhaltiges langfristiges Wachstum auf, unterstützt durch alternde Bevölkerungen und die sehr weit verbreitete Nutzung von Bildschirmen in einer digitalisierten Welt.

Ferner erwarb der Anlageverwalter Aktien der HDFC Bank, die größte Privatbank Indiens. Sie ist gut positioniert auf dem indischen Bankenmarkt mit einer sehr bekannten Marke, einer überragenden Kundenzufriedenheit und einer starken Erfolgsbilanz bei Wachstum und Risikomanagement. JP Morgan, eine der hochwertigsten Banken in den USA, wurde ebenfalls ins Portfolio aufgenommen.

Die Kasikornbank wurde verkauft, weil die Möglichkeit einer weiteren Disruption der thailändischen Wirtschaft durch Covid-19 bestand. Die kleine Position in Meituan wurde verkauft. Der Anlageverwalter gelangte zu der Einschätzung, dass eine Fortsetzung der strengen staatlichen Kontrollen derzeit übertrieben sei. Die Position in dem Chemievertriebshändler Brenntag wurde ebenfalls verkauft, da es wahrscheinlich erscheint, dass ein zyklischer Höhepunkt bevorsteht.



## Globale Aktienmärkte Forts.

### BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND Forts.

Da die Entwicklung der *Anleiherenditen* eine wesentliche Determinante für die *Aktienmärkte* sein dürfte, behält der Anlageverwalter einen ausgewogenen Ansatz im Fondsmanagement bei und berücksichtigt dabei die rapiden Veränderungen der Rahmenbedingungen und die *Volatilität*, die einsetzen dürfte, wenn der Markt auf die Einstellung der *geldpolitischen Stimuli* der Zentralbanken reagiert. Der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass unter anderem Technologie, Energiewende, *Geopolitik*, Demografie und Lieferketten eine tiefgreifende Auswirkung auf die Weltwirtschaft haben und auf viele Branchen als disruptive Kräfte wirken werden.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 13,06 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 20,95 % für den FTSE World TR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem *Referenzwert* Schritt. Die chinesische Versicherungsgesellschaft Ping An war im Berichtszeitraum der schwächste *Aktienperformer* im Portfolio. Die *Aktie* litt unter einer allgemeinen negativen Stimmung gegenüber China und einem Rückgang der Versicherungsverkäufe sowie Wertminderungen bei ihren Immobilienanlagen. Das Event-Unternehmen Informa verzeichnete Kursverluste, da die Anleger die Chancen auf eine schnelle Erholung bei Langstreckengeschäftsreisen aufgrund mehrerer Covid-19-Wellen skeptisch sahen. Fehlende Positionen in Microsoft oder Alphabet schmälerten ebenfalls die *Renditen*, da die Kurse beider *Aktien* kräftig zulegten. Die strikte *Renditedisziplin* des Fonds verhindert, dass er diese *dividendenschwachen* Unternehmen hält.

Richemont war einer der Top-Performer im Portfolio. Das Unternehmen profitierte von seiner starken *Gewinndynamik* und einem gewissen Interesse an *Fusionen und Übernahmen*, insbesondere am Verkauf einer Minderheitsbeteiligung an dessen verlustträchtigem E-Commerce-Geschäft YOOX Net-a-Porter.

Infosys war im Berichtszeitraum ein starker Performer dank sich verbessernder Nachfragetrends und eines wachsenden Anlegervertrauens, dass das Unternehmen gut positioniert bleibt, um von einer Erholung der Technologieausgaben zu profitieren. Auch Cisco Systems erzielte eine gute Performance. Die Anleger zeigten sich zuversichtlich, dass eine steigende Nachfrage von Seiten der Unternehmen, der Service Provider und Cloud-Diensten dem Unternehmen helfen wird, im Geschäftsjahr 2022 das obere Ende seines Umsatzwachstumsziels zu erreichen.

In puncto Portfolioveränderungen nahm der Anlageverwalter eine Position in dem Spezialisten für Unternehmenssoftware und -lösungen Sage ins Portfolio auf. Das Unternehmen profitiert von den Trends, die durch das Anlagethema „Smart Revolution“ des Fonds abgedeckt werden. Dominion Energy, ein Unternehmen, das in den letzten Jahren erheblich umstrukturiert wurde und sich in einen reinen regulierten US-Versorger verwandelt hat, wurde ins Portfolio aufgenommen. Anglo American, eine *zyklische* und

*diversifizierte Rohstoffaktie* war ein weiterer Neuzugang. Nach Ansicht des Anlageverwalters hat das Unternehmen Vermögenswerte von Weltklasse in Platin, Kupfer, Eisenerz, Kohle, Nickel und Diamanten und hat eine solide Kapitaldisziplin bewiesen.

Ein weiterer Neuzugang war Hubbell, ein Unternehmen, das elektrische und elektronische Produkte für Anwendungen in Bau, Industrie und Versorgungsunternehmen entwickelt, herstellt und verkauft. Die *Aktie* bietet ein hochwertiges Engagement in Investitionen in Versorgungsunternehmen in den USA und könnte auch vom allgemeinem Rückenwind durch den Elektrifizierungstrend profitieren.

Die Position in dem US-Heimwerker-Einzelhändler Home Depot wurde nach einer starken *Aktienkursperformance* verkauft. Der Anlageverwalter verkaufte auch die Position in Ferguson, einem Vertriebshändler von Sanitärinstallations- und Heizungsprodukten, nachdem eine starke *Aktienkursperformance* die Verkaufsdisziplin des Fonds ausgelöst hatte. Der Geldtransfer-Dienstleister Western Union wurde verkauft wegen Bedenken angesichts des strukturellen Gegenwinds für das Unternehmen durch die zunehmende Digitalisierung im Sektor. Der Anlageverwalter reduzierte die *Gewichtungen* in bestimmten Technologieaktien wie Infosys und Cisco Systems nach einer starken Performance und nachdem deren Positionsgrößen im Fonds zu groß geworden waren.

Solange sich die Konjunkturerholung fortsetzt, erwartet der Anlageverwalter, dass die *Dividenden* von dem Rückenwind durch starke Verbesserungen bei den Unternehmensgewinnen profitieren werden. In den USA und Europa liegen die *Dividendenausschüttungsquoten* noch unter dem Niveau von vor Covid-19, was Spielraum für ein weiteres *Dividendenwachstum* bedeutet, wenn sich die Volkswirtschaften weiter gut entwickeln.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Die Anteilsklasse USDA(Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 17,93 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI World NR Index ein Plus von 21,82 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Global ein Plus von 14,16 %, jeweils in US-Dollar.

Die *Aktienmärkte* setzten ihre kräftige Erholung von den durch Covid-19 verursachten Tiefs vom März 2020 fort. Die Zentralbanken hatten ihren Part dabei, indem sie trotz steigender *Inflation* die *Geldpolitik* locker hielten. Erst in den letzten Monaten des Jahres vollzog die US-Notenbank eine Wende hin zu einer mehr *zinsbullischen* Haltung und kommunizierte die Notwendigkeit eines wachsameren Ansatzes gegenüber dem Kostendruck. Ein Großteil des Preisdrucks war durch die Unterbrechung der Liefer- und Nachfragedynamik durch die Covid-19-Pandemie bedingt.

Aus Sektorperspektive war die größte Belastung für die Performance die seit längerem bestehende *Untergewichtung* des Finanzsektors. Auch ein mangelndes Engagement im Energiesektor wirkte sich negativ aus. Positiver wirkt sich hingegen die *Übergewichtung* des Gesundheitssektors im Fonds aus.

## Globale Aktienmärkte Forts.

### BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND Forts.

Nach Einzelwerten im Fonds lieferte ASML, der weltweit größte Anbieter von Lithografiegeräten für die Halbleiterindustrie, hervorragende Renditen dank einer hohen Nachfrage nach seinen EUV-Maschinen. Das dänische Pharmaunternehmen Novo Nordisk hatte ebenfalls ein gutes Jahr 2021 dank einer anhaltend hohen Nachfrage nach seinen Diabetesmedikamenten und eines bemerkenswerten Markterfolgs von Wegovy, seinem neuen Medikament zur Behandlung von Fettleibigkeit.

Für AIA dagegen war das Jahr weniger positiv. Das Unternehmen litt unter der Ausbreitung der Covid-19-Variante Delta in Asien und dem anhaltenden Reiseverbot vom chinesischen Festland nach Hongkong, das traditionell eine zentrale Ertragsquelle für das Unternehmen ist. Auch Fanuc belastete im Berichtszeitraum die Performance, da schwache Umsätze im Robotikbereich sowie Engpässe bei Chips und anderen Bauteilen die Ergebnisse schmälerten. Lieferkettenengpässe, vor allen bei Halbleiter-Chips, hemmten beträchtlich die Produktion.

Drei *Portfoliositionen* wurden im Geschäftsjahr verkauft: Cognizant Technology Solutions, Colgate-Palmolive und Reckitt Benckiser. Sie alle hatten mit Herausforderungen zu kämpfen, und der Anlageverwalter war der Meinung, dass anderswo bessere *Fundamentaldaten* und langfristige Wachstumsaussichten zu finden seien. Der einzige Neuzugang 2021 war Tencent Holdings. Tencent ist mittlerweile mit seiner App WeChat ein unverzichtbarer Bestandteil des Alltags für den durchschnittlichen Internet-Nutzer in China geworden und ist ein Branchengigant. Die hohe Rentabilität des Unternehmens und eine starke Bilanz dürften die weitere Entwicklung neuer Internet-Dienste für das zukünftige Wachstum fördern.

Die Aktienmärkte haben sich aus den Tiefen des pandemiebedingten Abschwungs Anfang 2020 wieder ein großes Stück herausgearbeitet. Es gibt aber noch Herausforderungen, und die *Gewinne* müssen in einigen Sektoren deutlich steigen, um die Bewertungen zu rechtfertigen. Angesichts der mit Omikron verbundenen Unsicherheit und der Aussicht auf eine straffere *Geldpolitik* könnte eine *volatile* Phase zu erwarten sein. Der Anlageverwalter freut sich darüber, wie die Unternehmen im *Portfolio* ihre Herausforderungen durch die Pandemie und den anschließenden Anstieg der *Inflation* gemeistert haben, und ist der Meinung, dass sie sowohl Widerstandsfähigkeit als auch Anpassungsfähigkeit bewiesen haben.

Walter Scott & Partners Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 17,85% nach Abzug von Gebühren, während der MSCI AC World NR Index um 18,54% zulegte, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem *Referenzwert* Schritt. Die Auswahl der *Aktien* war maßgeblich für die *Renditen* des Fonds. Applied Materials war im Berichtszeitraum die stärkste Position im Portfolio.

Die Aktie stieg dank eines steigenden Ausgabetrends in der Industrie, der direkt den Produkten des Unternehmens zugute kam und dementsprechend für eine starke Dynamik bei den *Gewinnen* sorgte. Auch Alphabet lieferte einen positiven Beitrag, nachdem es eine ermutigende *Gewinnmeldung* herausgegeben und die Markterwartungen übertrafen hatte. Accenture profitierte von einer hohen Nachfrage und dem starken Trend zur digitalen Transformation. Infolgedessen meldete die Unternehmensleitung mehrere starke Quartalsergebnisse in Folge. Auch Microsoft profitierte von einem gesunden *Gewinn*profil. Das ganze Unternehmen zeigte Stärke, wobei der Cloud Computing Service Azure mit einem beschleunigten Wachstum das Highlight bildete. Die Aktie von Alibaba hatte aufgrund anhaltender Befürchtungen wegen der regulatorischen Verschärfungen in China zu kämpfen. Zu der Underperformance von Ping An trugen mehrere *aktienspezifische* Faktoren bei, die bei den Anlegern Bedenken auslösten: ein schwaches Wachstum im Lebensversicherungssegment, eine knappere Kapitalausstattung und Befürchtungen wegen der Kapitalallokation und der Anlagenqualität. Die Aktie von Medtronic fiel, nachdem die Umsatzerwartungen für sein Produkt für die renale Denervierung nach unten korrigiert wurden. Hintergrund war eine wesentliche Studie, die noch abgeschlossen werden musste, wodurch sich der Zulassungsantrag bei der US-Lebensmittelüberwachungs- und Arzneimittelzulassungsbehörde (FDA) verzögerte.

In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums wurden Positionen in Novozymes und Amazon aufgenommen. Später im Jahr wurde eine Position in CooperCompanies aufgebaut, ein weltweit führendes Unternehmen auf dem Kontaktlinsenmarkt. Das Unternehmen weist Potenzial für nachhaltiges langfristiges Wachstum auf, unterstützt durch alternde Bevölkerungen und die negativen Auswirkungen der sehr weit verbreiteten Nutzung von Bildschirmen in einer digitalisierten Welt. Es wurde außerdem eine Position in Ecolab aufgebaut, einem Anbieter von Technologien und Dienstleistungen in den Bereichen Wasser, Hygiene und Energie. Durch die Beschleunigung von Trends in den Bereichen *Umwelt, Soziales und Corporate Governance* entstehen kontinuierlich Chancen, die dem Unternehmen zu einer verlässlichen langfristigen Wachstumsstory verhelfen könnten. Der Anlageverwalter nahm ferner die HDFC Bank ins Portfolio auf, Indiens größte Privatbank, die eine starke Erfolgshistorie in Sachen Wachstum und Risikomanagement vorweisen kann.

Die Position in Rolls-Royce wurde zu Beginn des Berichtszeitraums verkauft, da das Unternehmen überwiegend im internationalen Langstreckenverkehr engagiert ist, ein Bereich, der sich wohl nur langsam erholen wird. Die Kasikornbank wurde nach einer starken Performance verkauft, weil die Möglichkeit einer weiteren Disruption der thailändischen Wirtschaft durch Covid-19 bestand. Weitere Verkäufe waren Associated British Foods, Brenntag und Continental.

Da die Entwicklung der *Anleiherenditen* eine wesentliche Determinante für die *Aktienmärkte* sein dürfte, behält der Anlageverwalter für den Fonds einen ausgewogenen Ansatz bei und berücksichtigt dabei, wie schnell sich Rahmenbedingungen verändern können und wie wahrscheinlich *Volatilität* einsetzen dürfte, wenn der Markt auf die Einstellung der *geldpolitischen stimulierenden* Maßnahmen der Zentralbanken reagiert.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

## Globale Aktienmärkte Forts.

### BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 25,35% nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI World NR Index 31,07% und der Sektordurchschnitt des Lipper Global – Equity Global 22,83%. Alle Angaben in Euro.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive Rendite nach Abzug von Gebühren und lag über dem Sektordurchschnitt, aber hinter seinem Referenzwert. Die globalen Aktienmärkte verzeichneten im Berichtszeitraum eine gute Performance dank niedriger Zinsen, staatlicher Stützungsprogramme und eines kräftigen Wachstums der Gewinne. Dies war trotz Lieferkettenunterbrechungen, eines kräftigen Anstiegs der Inflation und der Auswirkungen der Covid-19-Pandemie der Fall.

Auf Sektorebene litt das Portfolio unter dem begrenzten Engagement in Finanzwerten und der schwachen Performance seiner Positionen in diesem Sektor im Vergleich zum Referenzwert. Die Positionen des Fonds im Industriesektor blieben hinter den Sektorrenditen des Referenzwerts zurück, was einen weiteren Underperformance-Faktor darstellte.

Die US-Technologieunternehmen Microsoft und Alphabet lieferten beide positive Beiträge. Microsoft erzielte starke Ergebnisse mit beträchtlichen Umsatz- und Betriebsgewinnsteigerungen sowie ein solides Wachstum im kommerziellen Cloud-Geschäft (wo die Bruttomarge die Gesamtmarke des Unternehmens übertrifft). Microsoft ist es gelungen, Preiserhöhungen von 10-25% für seine Microsoft-365-Angebote durchzusetzen. Diese treten im März 2022 in Kraft.

Auch Alphabet erzielte im Berichtszeitraum ein sehr starkes Wachstum der Gewinne, bei dem alle Unternehmensbereiche (Google Search, Google Network, YouTube und Cloud) gut abschnitten. Die Gewinnmargen des Unternehmens haben sich sequenziell in jedem der letzten fünf Quartale verbessert.

Das Werbegeschäft erholte sich sehr gut von der Schwäche im Jahr 2020, während Online-Marktanteilsgewinne und eine bessere Verbraucherstimmung Google Search Auftrieb gaben.

AIA war im Geschäftsjahr ein deutlicher Underperformer, da dessen Wachstum unter der Ausbreitung der Covid-19-Variante Delta in Asien litt. Das Unternehmen verlor in der zweiten Jahreshälfte 2021 an Schwung, was die Unternehmensleitung auf die Ausbreitung von Covid in mehreren Märkten, u. a. auf dem chinesischen Festland, in Singapur, Vietnam und Malaysia, zurückführt.

Auch Fanuc belastete die Performance, da schwache Umsätze im Robotikbereich sowie Engpässe bei Chips und anderen Bauteilen die Ergebnisse schmälerten. Lieferkettenengpässe, vor allem bei Halbleiter-Chips, hemmten beträchtlich die Produktion. Die Unternehmensleitung von Fanuc geht davon aus, dass dies noch eine Weile anhalten wird, und hat die Ganzjahresprognose entsprechend gesenkt.

Positionen in Cerner, Hong Kong & China Gas, Novartis und Reckitt Benckiser wurden im Berichtszeitraum verkauft. Der Anlageverwalter kaufte das Netzwerksicherheitsunternehmen Fortinet und den panasiatischen Lebensversicherungskonzern Prudential hinzu.

Die weltweiten Rahmenbedingungen dürften 2022 weniger günstig sein, da die US-Notenbank ihre geldpolitischen Stimuli einstellt und die Zinsen erhöht, um die Inflation zu bekämpfen. Andere Zentralbanken könnten ebenfalls ihre Geldpolitik weiter straffen. Das Wirtschaftswachstum könnte durch neue Varianten von Covid-19 sowie durch eine Abschwächung in China, wo der verschuldete Immobiliensektor weiter Schatten wirft, beeinträchtigt werden. Die kräftige Fusions- und Übernahmeaktivität aus 2021 dagegen dürfte sich 2022 fortsetzen, was günstig für die Aktienmärkte sein könnte. Vor diesem Hintergrund dürften nach Einschätzung des Anlageverwalters die Unternehmen, in denen der Fonds investiert ist, weiter von Wachstumstrends profitieren.

Walter Scott & Partners Limited  
Januar 2022

## REGIONALE AKTIEN

### BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -9,51 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von -2,65 % für den MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR und von -1,40 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Asia Pacific ex Japan. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück. Die Auswahl der *Aktien* war der wichtigste Faktor für die negativen relativen *Renditen* des Fonds. Größter Verlierer im Portfolio war New Oriental Education & Technology. Die *Aktie* des Unternehmen gab nach, als überraschend drakonische regulatorische Maßnahmen verkündet wurden, die auf den privaten Bildungssektor abzielten. Tencent Music Entertainment verzeichnete Kursverluste nach Meldungen, dass die chinesische Aufsichtsbehörde Tencent und seinen verbundenen Unternehmen exklusive Musik-Copyright-Verträge untersagen würde. Die chinesische Autoplatzform Autohome entwickelte sich schwach, was teilweise durch den verschärften Wettbewerb bedingt ist, während sich Halbleiter-Chip-Engpässe negativ auf die Produktion auswirkten. Ping An Insurance litt unter Sorgen wegen einer unbegründet stärkeren regulatorischen Kontrolle der Versicherungsbranche und negativer Stimmung in Bezug auf das chinesische Finanzsystem.

Der koreanische Hersteller von Kupferfolien Iljin Materials zählte zu den stärksten Performern im Fondsportfolio. Er verdankte dies vor allem seiner Schlüsselposition in der Lieferkette für Elektrofahrzeuge, da das Unternehmen hochwertige und hoch profitable Kupferfolien für die Batterieproduktion herstellt. ASML erzielte eine gute Performance mit sich füllenden Auftragsbüchern und positiver *Gewinndynamik* dank seiner dominanten Position in der Halbleiterlieferkette. Das indische Internet-Unternehmen Info Edge trug kräftig zur Performance bei in der Erwartung einer schnellen Nachfrageerholung nach den Auswirkungen der Delta-Variante von Covid-19.

In puncto Portfolioveränderungen wurde zu Beginn des Berichtszeitraums eine Position in Tata Consultancy Services gekauft. Dieses indische IT-Unternehmen ist ein profitables Unternehmen mit hohen Kapital*renditen* im Vergleich zum breiteren Technologieuniversum. Im weiteren Jahresverlauf wurde Sungrow Power Supply, der führende chinesische Hersteller von Solar-Wechselrichtern, ins Portfolio aufgenommen. Nach Einschätzung des Anlageverwalters wird die Nachfrage nach Solaranlagen länger und dauerhafter sein als erwartet. Ferner wurde eine Position in Kingdee International Software, einem führenden chinesischen Anbieter von Software-as-a-Service-Unternehmenssoftware, aufgebaut. Kingdee scheint durch die Modernisierung der digitalen Wirtschaft für Unternehmen durch die Regierung interessante langfristige Wachstumschancen zu haben. Ein weiterer Neuzugang war die Bank Rakyat, eine große indonesische Bank.

Angesichts der Schuldenkrise bei dem chinesischen Immobiliengiganten Evergrande entschied sich der Anlageverwalter für einen Verkauf der Position in dem Immobilienverwalter Greentown Service. Die noch verbliebene Position in New Oriental Education wurde ebenfalls verkauft, nachdem es glaubwürdige Berichte gab, die chinesischen Behörden würden privaten Bildungsanbietern verbieten, Gewinne zu machen oder Kapital aufzunehmen. Die Position in Iljin Materials wurde nach einer sehr starken Performance verkauft, nachdem im Zusammenhang mit der Offenlegung der Finanzierungsstruktur für die Expansion in Malaysia zunehmend Bedenken wegen der Unternehmensführung aufkamen.

Trotz offensichtlich anhaltender Gegenwinde sehen wir interessante Innovationen und Veränderungen sowie Bereiche mit nachhaltigem und schnellem Wirtschaftswachstum. Der Anlageverwalter ist der Ansicht, dass die asiatischen Märkte ein guter Ort sind, um nach Unternehmen zu suchen, die so positioniert sind, dass sie von dieser Innovation, dem Wandel und dem Wachstum profitieren können.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 4,81 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die *Rendite* für den FTSE Asia Pacific ex Japan TR Index bei -1,01 % und für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Asia Pacific ex Japan bei -1,40 %. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine positive *Rendite* und übertraf seinen *Referenzwert* und den Sektordurchschnitt. Die Auswahl der *Aktien* auf Sektorebene war positiv und der wichtigste Treiber für die hervorragende relative Performance des Fonds. Elite Materials zählte zu den Aktientiteln mit der besten Wertentwicklung im Fonds. Der Hersteller für kupferkaschierte Laminat lieferte sehr starke Drittquartalsergebnisse, und das Unternehmen konnte die *Kosteninflation* bei *Rohstoffen* an Kunden weitergeben und die Entwicklung seiner Datenzentren-Wachstumsstrategie übertraf die Erwartungen. Die Bankpositionen des Fonds in Singapur, DBS und United Overseas Bank, entwickelten sich gut aufgrund eines für 2022 erwarteten kräftigen Kreditwachstums und den potenziellen Vorteilen steigender Zinsen.

Taiwanische Technologieaktien wie Taiwan Semiconductor und MediaTek erzielten ebenfalls eine gute Performance dank voller Auftragsbücher und einer positiven *Gewinndynamik*. Das fehlende Engagement in Alibaba wirkte sich ebenfalls sehr positiv aus, da diese große *Indexaktie* ebenso wie andere chinesische Internet-Unternehmen unter dem harten Durchgreifen Chinas gegen Internet-Unternehmen litt.

Der Versicherer Ping An Insurance war einer der schwächsten Performer im Fonds und durch Sorgen um eine stärkere regulatorische Kontrolle der Versicherungsbranche und die negative Stimmung in Bezug auf das chinesische Finanzsystem beeinträchtigt.

## REGIONALE AKTIEN Forts.

### BNY MELLON ASIAN INCOME FUND Forts.

Sands China zeigte ebenfalls Schwäche; Glücksspielunternehmen in Macau wurden Opfer der Anleger-Sensibilität gegenüber Chinas regulatorischer Aufsicht mit einer Ankündigung, dass Glücksspielkonzessionen in der Sonderverwaltungsregion einer öffentlichen Konsultation unterzogen werden würden.

In puncto Veränderungen im Portfolio wurde AIA, ein führendes Versicherungsunternehmen in der Asien-Pazifik-Region, zu Beginn des Berichtszeitraums gekauft. Der Anlageverwalter sieht für AIA beträchtliche Chancen in China, da lockerere Bestimmungen es ausländischen Unternehmen ermöglichen werden, stärker im Land tätig zu sein. By-health, Chinas führender Hersteller von Vitaminen und Nahrungsergänzungsmitteln, kam ebenfalls neu hinzu. Eine neue Position in SK Square entstand durch eine Ausgliederung aus der im Fonds vertretenen SK Telecom. SK Square ist eine Investment-Holding-Gesellschaft mit Unternehmen in den Bereichen Halbleiter, Information und Kommunikationstechnologien und könnte von positiven Wachstumstrends in diesen Branchen profitieren. Aufstockungen wurden bei Ping An Insurance, Infosys und Tata Consultancy Services vorgenommen.

Der Singapurische Bodenabfertiger und Flug-Catering-Anbieter SATS wurde verkauft, da das Unternehmen keine Dividende mehr ausschüttete und daher gegen die Renditedisziplin des Fonds verstieß. Sands China wurde infolge reduzierter Dividendenaussichten für die Branche und der im Gange befindlichen öffentlichen Konsultation der Glücksspielkonzessionen in Macau verkauft. Auch Positionen in der singapurischen Bank United Overseas Bank, in Singapurs Parkway Life REIT und Taiwan Semiconductor wurden reduziert.

Angesichts der möglichen Drosselung der *geldpolitischen Stimuli* seitens globaler Zentralbanken und angesichts der hohen Bewertungsniveaus an den *Aktienmärkten* und der unsicheren Aussichten für *Gewinne* in einer fragilen Weltwirtschaft ist der Anlageverwalter der Auffassung, dass die Argumente für Erträge abwerfende Anlagen stärker denn je sind.

Die *Renditedisziplin* des Fonds konzentriert sich auf Bewertungen, während sein Anlageprozess darauf abzielt, Unternehmen mit attraktiven *Ertragsmerkmalen* auszuwählen.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A des Fonds eine *Rendite* von -11,99 %. Im Vergleich dazu verzeichneten der MSCI Brazil 10/40 NR Index eine *Rendite* von -19,63 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Brazil von -21,78 %, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine negative *Rendite*, übertraf jedoch nach Abzug von Gebühren seinen *Referenzwert* und den Sektordurchschnitt.

Auf Branchenebene lieferten *übergewichtete* Positionen in globalen Investitionsgüterherstellern und Lebensmittelverarbeitern die größten positiven Beiträge zur Performance im Vergleich zum *Referenzwert*, ebenso die Allokation und die Auswahl von *Aktien* im Stahlsektor. Eine negative Performance entstand durch die Allokation des Fonds im Bildungssektor, eine *Untergewichtung* des Öl- und Gassektors und die Titelauswahl im Versorgungssektor.

Auf *Aktienebene* profitierte der Fonds am meisten von seinen Engagements in Embraer und Marfrig. Die *Aktie* von Embraer entwickelte sich gut, nachdem sich mit der Wiedereröffnung der Wirtschaft der Flugverkehr und die Flugzeugbestellungen erholten. Darüber hinaus gab das Unternehmen im Dezember eine Transaktion mit dem Akquisitionszweckunternehmen (Spac) Zanite bekannt, die 2022 zu einer Börsennotierung des Geschäftsbereichs urbane Mobilität des Unternehmens in den USA führen wird. Die *Aktie* von Marfrig erzielte 2021 dank ihres starken Engagements im US-Rindfleischmarkt eine Outperformance.

Zu den negativen Highlights auf *Aktienebene* zählten Americanas, C&A, Hapvida, SulAmerica und YDUQS. Die *Aktien* von Americanas und C&A fielen ebenso wie die ihrer größten Wettbewerber, da die Wiedereröffnung der Wirtschaft und schwächere Verbraucherausgaben die Performance von verbraucherorientierten Aktien und E-Commerce-Aktien beeinträchtigten. Das Auftreten neuer Covid-19-Varianten wirkte sich negativ auf die Sektoren Gesundheit und Bildung aus. Die *Aktien* von Hapvida, SulAmerica und YDUQS verzeichneten eine Underperformance in der Erwartung, dass die Erholung von *Umsatz und Margen* länger dauern würde als erwartet.

Im Geschäftsjahr kaufte der Fonds neu C&A (im Sektor *Nicht-Basiskonsumgüter*) und Suzano (Zellstoff und Papier) hinzu. Die Positionen in EDP Brasil (Versorger), Grupo Mateus (*Nicht-Basiskonsumgüter*) und JBS (ein Lebensmittelhersteller) wurden verkauft.

Zum Jahresende schienen die *Aktienkurse* in Brasilien bereits einen unsicheren Konjunkturausblick und einen verstärkten Pessimismus unter den Anlegern widerzuspiegeln. Dennoch scheinen auch bestimmte *Aktienkurse* auf ein schwaches Wachstum der *Gewinne* in den kommenden Jahren hinzudeuten. Selbst wenn die globalen und lokalen Risiken mehr *Volatilität* bringen, erscheinen die erwarteten *Aktienrenditen* in einem mittel- bis langfristigen Szenario doch recht positiv.

Die Anlegerstimmung könnte sich mit dem Herannahen der Präsidentschaftswahl im Oktober langsam verbessern. Ab jetzt wird die Performance von brasilianischen Vermögenswerten davon abhängen, wie die Präsidentschaftskandidaten zum Ausdruck bringen, wie sie Probleme wie *fiskalische* Glaubwürdigkeit und steigende *Inflation* angehen wollen.

## REGIONALE AKTIEN Forts.

### BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND Forts.

Der Anlageverwalter wird die Marktvolatilität weiter nutzen, um den Fonds für langfristiges Wachstum zu positionieren. Der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass es weitere Gelegenheiten geben wird, das Engagement in unterbewerteten Unternehmen kurzfristig zu erhöhen, wenn es die Marktbedingungen erlauben.

ARX Investimentos Ltda  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -6,46% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -2,54% für den MSCI Emerging Markets NR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück. Mehrere der Aktien mit China-Bezug im Fonds verzeichneten eine Underperformance. Der größte negative Beitrag kam von dem chinesischen Nachhilfebeneanbieter New Oriental Education & Technology. Die Aktie des Unternehmens gab nach, als überraschend drakonische regulatorische Maßnahmen verkündet wurden, die auf den privaten Bildungssektor abzielten. Tencent Music Entertainment verzeichnete ebenfalls Kursverluste nach Meldungen, dass die chinesische Aufsichtsbehörde Tencent und seinen verbundenen Unternehmen exklusive Musik-Copyright-Verträge untersagen würde. Autohome, die führende chinesische Autoplattform, verzeichnete eine Underperformance, die durch einen verschärften Wettbewerb und die kurzfristigen Auswirkungen der Mikrochip-Engpässe auf den Fahrzeugabsatz verursacht war. Die chinesische Versicherungsgesellschaft Ping An Insurance litt unter Befürchtungen, dass die Versicherungsbranche stärkeren regulatorischen Kontrollen unterworfen würde.

Auf der positiven Seite erzielte Iljin Materials eine gute Performance; die Anleger erkannten in zunehmendem Maße die bedeutende Position des Unternehmens in der Lieferkette für Elektrofahrzeuge an. Das Unternehmen baute neue Fertigungsstraßen in seinem malaysischen Werk, um die Kapazität deutlich zu erhöhen. EPAM Systems verzeichnete eine starke Entwicklung dank eines anhaltenden, beeindruckenden Wachstums vor dem Hintergrund einer steigenden Nachfrage nach seinen maßgeschneiderten Software- und digitalen Technologielösungen. Das argentinische Unternehmen Globant trug ebenfalls merklich zur Rendite bei, denn das Unternehmen verzeichnete ein kräftiges Wachstum bei seinen Dienstleistungen für digitale Transformation. Globant kündigte zudem eine Partnerschaft mit Pixelynx an, um eine Metaverse-Musikplattform aufzubauen.

In puncto Portfolioveränderungen nahm der Anlageverwalter zu Beginn des Berichtszeitraums eine Position in Tata Consultancy Services ins Portfolio auf, ein gut geführtes und hoch profitables indisches IT-Dienstleistungsunternehmen. Yum China und die ungarische OTP Bank waren weitere Neuzugänge im ersten Halbjahr. Später im Berichtszeitraum nahm der Anlageverwalter eine Position in Advantest ins

Portfolio auf, ein Hersteller von automatisiertem Test-Equipment für die Halbleiterindustrie. Tests im Halbleiterbereich sind dank der Expansion der Halbleiterproduktionslinien ein attraktiver und wachsender Bereich. Es wurde eine Position in Foshan Haitian Flavouring & Food, dem größten Gewürzunternehmen Chinas, aufgebaut.

Dabei handelt es sich nach Einschätzung des Anlageverwalters um ein hochwertiges Unternehmen, das durch die Konsolidierung eines fragmentierten Marktes langfristiges strukturelles Wachstum erzielen könnte. Der Anlageverwalter kaufte außerdem PB Fintech, den größten indischen Online-Markt für Versicherungen, sowie Kingdee International Software, einen führenden chinesischen Anbieter von Software-as-a-Service für Unternehmen.

Positionen in China Harmony, Nippon Life Asset Management und dem australischen Unternehmen IDP Education wurden im ersten Halbjahr verkauft. Später verkaufte der Anlageverwalter die verbleibende kleine Position in New Oriental Education nach Pressemeldungen, dass die chinesischen Behörden privaten Bildungsanbietern verbieten würden, Gewinne zu machen oder Kapital aufzunehmen. Die Position in Prosus wurde verkauft, weil der Anlageverwalter es vorzog, sich direkt in Tencent zu engagieren.

Während es weiter Gegenwind für Schwellenländer in Form von Covid-19 gibt, bedeuten die Straffung der Geldpolitik und ein steigender US-Dollar, dass die langfristigen Chancen in den Schwellenländern nach Einschätzung des Anlageverwalters attraktiv bleiben. Dies beruht auf einem relativ höheren Einkommenswachstum, einer raschen Zunahme der Produktdurchdringung und dem Spielraum für eine Branchenkonsolidierung. Dementsprechend ist der Anlageverwalter der Meinung, dass Anleger, die in Schwellenländern die richtigen Wachstumsthemen und -unternehmen identifizieren, langfristig belohnt werden könnten.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Die Anteilsklasse JPY W des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 11,97% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 8,28% für den Russell/Nomura Small Cap TR Index und 9,18% für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Japan Small & Mid Cap. Alle Angaben in japanischen Yen.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite nach Abzug von Gebühren und übertraf im Berichtszeitraum seinen Referenzwert und den Sektordurchschnitt. Die Auswahl der Aktien erzielte den größten positiven Performancebeitrag für den Fonds. Auf Sektorebene kamen die größten positiven Beiträge von Elektrogeräten und -Dienstleistungen, wo der Fonds übergewichtet war, sowie von einem fehlenden Engagement im Pharmasektor. Die größten negativen Beiträge kamen aus den Sektoren Versicherungen sowie Information & Kommunikation, wo der Fonds übergewichtet war, und einem fehlenden Engagement in der Seefrachtbranche.

## REGIONALE AKTIEN Forts.

### BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND Forts.

Auf Ebene der einzelnen *Aktien* zählten zu den Unternehmen mit dem größten positiven Performancebeitrag die Premium Group (Autokredite und Mikrokredite für Verbraucher), M-up Holdings (ein Unternehmen, das Fan-Club-Seiten elektronische Ticket-Buchungen anbietet) und Insource (Unternehmensschulungen). Die größten negativen Beiträge kamen von Fibergate (drahtlose Telekommunikationsdienste), Anicom Holdings (Krankenversicherungen für Haustiere) und Anritsu (ein global führendes Unternehmen für Test- und Messinstrumente für Mobilfunkmärkte).

Drei neue Positionen wurden im Geschäftsjahr ins Portfolio aufgenommen: Aida Engineering (ein Hersteller von Umformmaschinen), Direct Marketing MiX (ein Anbieter von Marketingdienstleistungen über seine Outbond-Call-Center) und OPTORUN (ein Hersteller von optischen Dünnfilmausrüstungen). Darüber hinaus verkaufte der Fonds BayCurrent Consulting und Osaki Electric. Der Anlageverwalter erhöhte zudem die *Gewichtung* bestimmter *Aktien*, die mittelfristig attraktiv erschienen, und finanzierte diese Zukäufe durch Verkäufe von *Aktien*, die sich relativ gut behauptet hatten.

Ende Dezember 2021 hielt das Portfolio 31 *Aktien* und war *übergewichtet* in Dienstleistungen, Elektrogeräten und sonstigen Finanzierungsgeschäften.

Zu den größten *übergewichteten* Positionen des Fonds zählten RS Technologies, ein bedeutender Anbieter von Dienstleistungen zur Rückgewinnung von Silizium-Wafern für die Halbleiterindustrie, M-up Holdings, Premium Group, Nicfo (ein Hersteller von kunstharzhaltigen Verbindungselementen und Kunststoffkomponenten) und OPTORUN.

Die Covid-19-Impfungen in Japan machen Fortschritte, und der Anlageverwalter geht weiterhin davon aus, dass die Wirtschaft mittelfristig ein deutlich besseres Niveau erreichen wird, auch wenn noch die Sorge zukünftiger Viruswellen besteht, denn die japanische Regierung hat starke *geld- und fiskalpolitische* Unterstützung versprochen.

Im November genehmigte das Kabinett von Ministerpräsident Kishida ein Stützungs paket im Umfang von 55,7 Bio. JPY, das auch Hilfen für Unternehmen beinhaltet, die von der Covid-19-Pandemie hart getroffen waren. Der Plan beinhaltet außerdem Zahlungen von bis zu 100.000 JPY pro Haushalt (einkommensabhängig).

Strategisch wird der Fonds nach wie vor *Aktien* halten, deren Wachstumsaussichten attraktiv erscheinen.

BNY Mellon Asset Management Japan Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

Der Fonds wurde am 15. Januar 2021 geschlossen.

Der einjährige Tracking Error zwischen dem 15. Januar 2020 und 15. Januar 2021 betrug 0,60%.

Der angegebene annualisierte Tracking Error wurde unter Anwendung der monatlichen Bruttoerträge für den betreffenden Zeitraum berechnet. Der Tracking Error ist die *Standardabweichung* der relativen *Renditen* auf annualisierter Basis (multipliziert mit der Quadratwurzel von 12).

Der Fonds zielte darauf ab, die Wertentwicklung und die allgemeinen Merkmale des S&P 500 Index bei kontrolliertem Risiko und kostenwirksam mit einem Ansatz zu erreichen, der auf einer vollständigen Nachbildung basiert.

Mellon Investments Corporation  
Januar 2022

### BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 21,21 % nach Abzug von Gebühren, gegenüber 18,69 % für den S&P EuroZone Small Cap TR Index und 20,83 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity EuroZone Small & Mid Cap. Alle Angaben in Euro.

Der Fonds übertraf seinen *Referenzwert* und den Sektordurchschnitt. Eine positive *Aktienauswahl* in Belgien war maßgeblich für die relative Outperformance, und auch Deutschland lieferte einen positiven Beitrag. Italien hingegen führte die Liste der Titel mit negativen Fondsbeiträgen aufgrund der schwierigen *Aktienauswahl* an, Dänemark belegte in dieser Hinsicht den zweiten Platz. Auf Sektorebene kam der größte Beitrag im Vergleich zum *Referenzwert* aus dem Industriesektor. Auch *Nicht-Basiskonsumgüter* trugen positiv zur Performance bei. Eine erfolgreiche *Aktienauswahl* bei Positionen in Finnland war im Industriesektor der primäre Outperformance-Faktor, insbesondere die Anlage des Fonds in Valmet. Im Sektor *Nicht-Basiskonsumgüter* gab eine Position in der belgischen D'leteren Group der Performance Auftrieb. Auf der negativen Seite belasteten Finanzwerte die relative Performance am meisten, was vor allem durch fehlende Engagements in verschiedenen deutschen und französischen Unternehmen bedingt war. Auch der Sektor Kommunikationsdienstleistungen zählte zu den Verlierern.

Der Anlageverwalter erhöhte das Engagement im Industrie- und Versorgungssektor, indem er im Industriesektor Positionen in Kronos und Rexel aufnahm und im Versorgungssektor mehrere bestehende Positionen, wie z. B. Acciona und Italgas, aufstockte. Das Engagement in *Basiskonsumgütern* wurde durch den Verkauf der Positionen in der Leroy Seafood Group und Royal Unibrew reduziert, ferner wurde eine bestehende Position in HelloFresh reduziert. Der Anlageverwalter reduzierte außerdem das Engagement im Sektor Kommunikationsdienstleistungen.

Vor dem Hintergrund wachsender Sorgen um *Inflation* und Marktbreite bleibt der Ausblick für Euroland-*Aktien* nach Ansicht des Anlageverwalters solide.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

## REGIONALE AKTIEN Forts.

### BNY MELLON U.S. DYNAMIC VALUE FUND

Der Fonds wurde am 5. März 2021 geschlossen.

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im Berichtszeitraum bis zur Schließung des Fonds eine Rendite von 9,07 % nach Abzug von Gebühren, während der Russell 1000 Value TR Index um 7,85 % zulegte, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds übertraf seinen Referenzwert. Auf Sektorbasis lieferte die Positionierung im Grundstoffsektor den größten positiven Beitrag, unterstützt durch eine erfolgreiche Aktienausswahl im Chemiesegment. Im Sektor Kommunikationsdienstleistungen trug ein fehlendes Engagement im Subsektor Unterhaltung positiv bei; im Subsektor Medien und Dienstleistungen zahlte sich die Position des Fonds in Alphabet aus.

Die Aktienausswahl im Sektor *Nicht-Basiskonsumgüter* schmälerte die Renditen. Hotels, Restaurants und Freizeit belasteten, insbesondere die Position in Las Vegas Sands. Im Immobiliensektor wirkte sich eine *Untergewichtung* von Aktien-Real Estate Investment Trusts (REITs) negativ aus.

Positionen im Sektor Kommunikationsdienstleistungen wurden erhöht und Comcast und Vodafone neu ins Portfolio aufgenommen. Im Energiesektor wurden Devon Energy, EQT, Exxon Mobil und Valero Energy aufgenommen. Die Käufe wurden finanziert durch eine Reduzierung der Positionen in den Sektoren Gesundheit und Grundstoffe. Im Gesundheitssektor wurden Anthem, Bristol-Myers Squibb und Humana verkauft. Im Grundstoffsektor trennte sich der Fonds von Positionen in Louisiana-Pacific, Mosaic und Vulcan Materials.

Mellon Investments Corporation  
Januar 2022

### BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD C (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 29,16 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 28,16 % für den S&P 500 NR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert. Auf Sektorbasis lieferten Energie und Finanzen die höchsten relativen Beiträge, während Gesundheit und Kommunikationsdienstleistungen die Performance schmälerten. Die beste Performance erzielte 2021 der Energiesektor, der auch im Portfolio die höchsten Performancebeiträge leistete. Das *übergewichtete* Engagement des Fonds im Sektor und die positive Aktienausswahl, insbesondere mit Devon Energy und Marathon Petroleum, gaben den Renditen Auftrieb. Die deutlich *übergewichtete* Positionierung des Portfolios im Finanzsektor war der Performance ebenfalls zuträglich. Starke Beiträge kamen von der Positionierung in den Segmenten Kapitalmärkte und Verbraucherfinanzierung. Auf der negativen Seite war die Aktienausswahl im Gesundheitssektor im Berichtszeitraum ungünstig. Hier war die Positionierung im Bereich Medizintechnologie aufgrund der immer neuen Covid-19-Varianten schwierig, denn diese dämpften die Nachfrageerholung bei elektiven Eingriffen. Einer der größten negativen Faktoren war die Position des Fonds in Medtronic. Eine fehlende Positionierung im Bereich interaktive Medien und Dienstleistungen schmälerte die Performance.

Der Fonds war 2021 *übergewichtet* in den Sektoren Finanzen, Energie und Versorgung und *untergewichtet* in den Sektoren Technologie, *Nicht-Basiskonsumgüter* und Kommunikationsdienstleistungen. Der Finanzsektor hatte aufgrund attraktiver Bewertungen und ansehnlicher Kapitalrenditen die größte absolute *Gewichtung*.

Der Verbrauchersektor ist offenbar in äußerst guter Verfassung, die Nachfrage ist kräftig und die Beschäftigungstrends verbessern sich. Während sich weiter *Inflationsdruck* aufbaut, signalisiert die US-Notenbank für 2022 bis zu drei Zinserhöhungen. Und schließlich ist nach Einschätzung des Anlageverwalters im Ausblick für die nächsten 12 Monate bereits berücksichtigt, dass der *Inflationsdruck* über dem Trend bleibt, sich aber langsam abschwächen wird. Unternehmen, die so aufgestellt sind, dass sie höhere Preise weitergeben können, könnten letztlich von *Margensteigerungen* profitieren. Während der Markt nach den niedrigen Niveaus von 2020 nun die Hochphase bei *Gewinnen* und *Bruttoinlandsprodukt (BIP)* hinter sich gelassen haben dürfte, bleiben die wirtschaftlichen Rahmenbedingungen in den USA nach Einschätzung des Anlageverwalters solide.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022



## SPEZIALAKTIEN

### BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 9,35 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von 18,54 % für den MSCI AC World NR Index, jeweils in US-Dollar.

Das Engagement in Investmentfonds außerhalb des *Referenzwerts*, und insbesondere in Grayscale Bitcoin Trust, trug am meisten zum Ergebnis bei, gefolgt von Banken und Gesundheitstechnologie. Innerhalb des Bankensektors kamen eine *Übergewichtung* und eine positive *Aktienauswahl* der Performance zugute, u. a. die Position des Fonds in Silvergate Capital, das nicht im *Referenzwert* vertreten ist. Die Positionierung im Sektor Gesundheitstechnologie gab ebenfalls dem relativen Ergebnis einen Schub.

Auf der negativen Seite belastete eine *übergewichtete* Position in Software sowie eine schwierige *Aktienauswahl* innerhalb des Sektors am meisten die relativen *Renditen*. Dies gilt u. a. für die Positionen des Fonds in OneConnect Financial Technology und MicroStrategy. Die Sektoren Kapitalmärkte und Technologiedienstleistungen belasteten ebenfalls die Performance mit *übergewichteten* Positionen und einer ungünstigen *Aktienauswahl*.

Die erfolgreichsten neuen Positionen im Geschäftsjahr waren Signature Bank, Coinbase Global, MicroStrategy und Roblox. Verkauft wurden Grayscale Bitcoin Trust, Lemonade, Alphabet und Tencent Holdings.

Für den Anlageprozess des Anlageverwalters wird es weiterhin entscheidend sein, dass es gelingt, bei der Beurteilung der Unternehmen diejenigen zu finden, die Blockchain-Technologien in ihr Geschäft integrieren, sowie diejenigen, die entsprechende Vorteile daraus ziehen. Covid-19 bringt die digitale Transformation weiter voran. Die Blockchain-Technologie ist weiterhin in einer guten Position, um diese Transformation zu fördern. Angesichts der zunehmenden Bedeutung der Digitalisierung in unserem Leben könnte 2022 spannende Anlagechancen bieten.

Krypto-Vermögenswerte und das Krypto-Ökosystem dürften 2022 von *makroökonomischen* Marktkräften bestimmt werden. Angesichts des begrenzten Angebots von Bitcoin, kann dieser eine attraktive Wertanlage sein, wenn die *Inflationssorgen* anhalten. Laufende Regulierungsbemühungen könnten in den kommenden Monaten mehr Klarheit bringen. Der Anlageverwalter unterstützt die Bemühungen, die Umweltauswirkungen des Krypto-Ökosystems zu verbessern, und erwartet eine kontinuierliche Weiterentwicklung der zugrunde liegenden Netzwerke.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

### BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 29,48 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von 28,16 % für den S&P 500 NR Index, jeweils in US-Dollar.

Die *Leveraged-Equity*-Position, die, über den Einsatz von *Optionen*, im Geschäftsjahr bei durchschnittlich 114 % lag, trug maßgeblich zur Outperformance bei. Trotz der Erholung der *US-Treasury*-Preise nach dem kräftigen Rückgang im ersten Quartal wirkte sich die Allokation des Fonds in *Anleihen* negativ aus.

Der Fonds begann das Jahr mit einer Allokation von 100 % *Aktien* und 10 % *Anleihen*. Im Januar 2021 erhöhte der Anlageverwalter das Engagement in *Aktien* auf 110 %. Kräftiges Wachstum, enge *Kreditspreads* und ein sich verbesserndes *makroökonomisches* Umfeld sorgten für steigende *Aktienprämien*. Die Allokation blieb für den Rest des Jahres unverändert. Durch den Einsatz von *Call-Optionen* konnte der Fonds *Renditen* erzielen, da die Allokation von kräftigen Kursgewinnen bei *Aktien* profitierte.

Der starke Anstieg der *Treasury-Renditen* im ersten Quartal 2021 war der Hauptfaktor für die negative *Rendite* der Positionen des Fonds in *Anleihen*.

Zum Jahresende lag die Zielallokation des Fonds weiterhin bei 110 % *Aktien* und 10 % *Anleihen*. Die *Aktienrisikoprämie* erscheint insgesamt weiterhin attraktiv im Vergleich zu anderen Vermögenswerten. Der Anlageverwalter schätzt die aktuelle *Aktienrisikoprämie* gegenüber *Anleihen* auf 4,0 % gegenüber einem längerfristigen Durchschnitt von rund 3,5 %.

Der Anlageverwalter ist sich des Potenzials für steigende *Anleiherenditen* bewusst. Die Laufzeitprämie für *Anleihen* verringerte sich, nachdem sich die *Renditekurve* in der zweiten Jahreshälfte deutlich abschwächte, wobei *Anleihen* noch immer *Diversifizierungsvorteile* gegenüber *Aktien* bieten. Als eine Kernkomponente des Anlageprozesses überwacht der Anlageverwalter sorgfältig die *Korrelation* zwischen *Aktien* und *Anleihen*, um die Wahrscheinlichkeit steigender Zinsen zu beurteilen. Das Zielengagement in *Anleihen* wurde über das Schlussquartal 2021 stetig bei 10 % gehalten. Die tatsächliche Allokation in *Anleihen* lag angesichts des Potenzials für weiter steigende *Renditen* näher bei 4 %.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

## SPEZIALAKTIEN Forts.

### BNY MELLON FUTURE EARTH FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

Im Zeitraum seit Auflegung des Fonds bis zum 31. Dezember 2021 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds eine *Rendite* von 9,75% nach Abzug von Gebühren, während die *Rendite* des MSCI AC World NR Index 16,10% betrug, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem *Referenzwert* Schritt. Die Position in dem Versorger Orsted war der schwächste Performer, da die *Anleiherenditen* kräftig stiegen. Die *defensiven* Merkmale des Versorgungssektors erwiesen sich in einem Umfeld *fiskal- und geldpolitischer Stimuli* als weniger attraktiv. Darüber hinaus hatte das Unternehmen Probleme mit dem Kabelschutz bei einer Reihe von Offshore-Windparks, was sich negativ auf die *Gewinne* auswirkte. Nach einer starken Performance im Jahr 2020 durch den Fokus auf Technologien für Elektrofahrzeuge war die Performance von Nidec im Berichtszeitraum gedämpft. Viele der globalen Sektoren, die im Berichtszeitraum starke *Renditen* lieferten, wie etwa Öl und Bergbau, lagen außerhalb des Kernbereichs dieses *Portfolios*.

Auf der positiven Seite erzielte Acuity Brands eine starke Performance mit einer positiven *Gewinndynamik* und demonstrierte angesichts der Lieferkettenprobleme seine starken Umsetzungsfähigkeiten. Auch die Position in Ebara war der Performance zuträglich, da die Ergebnisse des Unternehmens die Erwartungen übertrafen, was eine verbesserte Rentabilität in seiner Sparte Fluid-Maschinen und -Systeme sowie *Gewinnwachstum* in der Sparte Präzisionsmaschinen demonstriert. Microsoft erzielte eine gute Performance dank einer ermutigenden Entwicklung bei den *Gewinnen*, der positive Trends bei den meisten Produkten und in den meisten Regionen zugrunde lagen. Dabei ragte das beschleunigte Wachstum bei Azure, dem Cloud Computing Service des Unternehmens etwas heraus.

In puncto Veränderungen im Portfolio kaufte der Anlageverwalter Trane, einen führenden Hersteller von Heizungs-, Lüftungs- und Klimaanlage- und -steuerungen für Gewerbe- und Wohngebäude. Aus Sicht der Industrie erscheinen Energieeffizienz und andere Umweltziele in der Lage, ein höheres und dauerhafteres Wachstum zu schaffen als in der Vergangenheit und als erwartet, so die Einschätzung des Anlageverwalters. Mehrere Positionen wurden aufgestockt, u. a. Weyerhaeuser, Toyota Industries, Genuit und Samsung SDI.

Die kleine Position in Siemens Gamesa wurde verkauft. Das Betriebsergebnis trug zu einer schwindenden Überzeugung hinsichtlich der Aussichten auf eine nachhaltige Verbesserung der Rentabilität bei. Der Anlageverwalter verkaufte außerdem Hella, einen deutschen Automobilzulieferer mit Spezialisierung auf LED-Beleuchtung, nach der Übernahmevereinbarung mit Faurecia zu Jahresbeginn. Reduziert wurden Fondspositionen in Xylem, Acuity Brands, Unilever und Microsoft.

### BNY MELLON FUTURE EARTH FUND Forts.

Während sich das erste Auftreten der Omikron-Variante von Covid-19 negativ auswirkte, sieht es zunehmend danach aus, dass die Auswirkungen dieser Variante relativ kurzlebig sein werden und den Konjunkturaufschwung nur vorübergehend behindern. Wenn es der Weltwirtschaft gelingt – und dies erscheint immer wahrscheinlicher –, im Jahr 2022 Covid schneller abzuschütteln, dann könnten die Märkte wieder florieren. Allerdings gibt es noch weitere Faktoren, wie z. B. die steigende *Inflation* und die Straffung der *Geldpolitik*.

Der primäre Fokus des Fonds wird weiter auf denjenigen Unternehmen liegen, die in der Lage sind, Innovationen zu entwickeln und neue Produkte und Dienstleistungen anzubieten, die Umweltprobleme und den Ressourcendruck mindern. Tatsächlich wird der Fonds weiter entsprechend seinen thematischen und *fundamentalen* Einschätzungen verwaltet, ein Ansatz, der nach Auffassung des Anlageverwalters dem *Portfolio* langfristig gute Dienste leisten wird.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON FUTURE FOOD FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

Im Zeitraum seit Auflegung des Fonds bis zum 31. Dezember 2021 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds eine *Rendite* von 11,11% nach Abzug von Gebühren, während die *Rendite* des MSCI AC World NR Index 16,10% betrug, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem *Referenzwert* Schritt. Das *untergewichtete* Engagement im Informationstechnologie-Sektor und die *übergewichtete* Position im Grundstoffsektor waren negative *Renditefaktoren* im Vergleich zum *Referenzwert*. Sprouts Farmers Market erzielte eine gute Performance; die Ergebnisse für das dritte Quartal übertrafen die Markterwartungen. Nutrien lieferte einen positiven Beitrag, gestützt durch die Stärke des Düngemittelmarkts. Auch die *Aktie* von Mosaic, einem Hersteller und Vertriebs Händler von Getreidedünger, lieferte eine starke Performance. Ein weiterer positiver Performer war Novozymes. Hier begannen die Anleger, die *Gewinndynamik* des Unternehmens zu honorieren.

Dagegen zeigte die *Aktie* von A2 Milk nach diversen Negativkorrekturen des *Gewinnausblicks* für das Gesamtjahr Schwäche. Meituan hatte mit anhaltenden Befürchtungen im Zusammenhang mit den regulatorischen Verschärfungen Chinas im Technologiesektor des Landes zu kämpfen. Die *Aktie* von Vitasoy International verlor aufgrund eines Produktboykotts durch die chinesischen Verbraucher. Die Kerry Group erzielte zwar im dritten Quartal des Berichtszeitraums gegen Ende Oktober ein kräftiges Volumenwachstum, tat sich aber vor dem Hintergrund der Lieferkettenprobleme schwer, die Gunst der Anleger zu gewinnen.

## SPEZIALAKTIEN Forts.

### BNY MELLON FUTURE FOOD FUND Forts.

In puncto Veränderungen im Portfolio kaufte der Anlageverwalter SunOpta, ein führendes Unternehmen im Bereich Beschaffung, Verarbeitung und Herstellung von organischen, natürlichen und nicht genveränderten pflanzen- und fruchtebasierten Nahrungsmitteln und Getränken. Die Kompetenzen von SunOpta in der Beschaffung und Verarbeitung von gesunden Lebensmitteln, verbunden mit seinem Transformationsplan, dürften nach Einschätzung des Anlageverwalters zur Generierung von Shareholder Value führen. Neu ins Portfolio aufgenommen wurde AGCO, ein Unternehmen, das gut positioniert ist, um im Laufe des Jahres 2022 von starken *fundamentalen* Trends zu profitieren. Das Unternehmen verfügt über volle Auftragsbücher und erhöht die Preise.

Der Anlageverwalter reduzierte die Positionen in Symrise und Givaudan nach den jüngsten Kursgewinnen ihrer *Aktien*. Nach einer Phase starker Performance wurde auch Tyson Foods weiter reduziert. Das Fleischgeschäft des Unternehmens könnte nach Einschätzung des Anlageverwalters thematisch vor längerfristigen Herausforderungen stehen.

Der primäre Fokus des Fonds wird weiter der Bedarf der Menschheit an Forschung, Investitionen und Innovationen sein, um neue und bessere Wege zur Ernährung der wachsenden Weltbevölkerung zu finden. Insgesamt orientiert sich das Fondsmanagement weiterhin sehr stark an diesen thematischen und *fundamentalen* Einschätzungen, ein Ansatz, der dem Fonds längerfristig gute Dienste leisten wird, so die Einschätzung des Anlageverwalters.

Die Verbraucher werden weiter höhere Transparenz und Nachverfolgbarkeit von Lebensmitteln fordern, sauberere Etiketten und gesündere Inhaltsstoffe, vielleicht nach der Covid-19-Pandemie umso mehr. Anlagechancen im Ernährungssektor sind ein besonderer Fokus des laufenden Research. Darüber hinaus sieht der Anlageverwalter strukturelle Unterstützung für Agrarmärkte in Bereichen wie Präzisionslandwirtschaft, wo neue, innovative Techniken der Nahrungsmittelproduktion angewandt werden.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON FUTURE LIFE FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

Im Zeitraum seit Auflegung des Fonds bis zum 31. Dezember 2021 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds eine *Rendite* von 17,22 % nach Abzug von Gebühren, während die *Rendite* des MSCI AC NR World NR Index 16,10 % betrug, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine positive *Rendite* und übertraf seinen *Referenzwert*. Die *Aktie* von Novo Nordisk entwickelte sich stark, das Unternehmen wies allgemein starke Quartalsergebnisse aus und die *Gewinnprognosen* wurden erhöht. Das neu zugelassene Medikament des Unternehmens gegen Fettleibigkeit brachte der *Aktie* ebenfalls Unterstützung. Der nachlassende Gegenwind durch Covid-19 kam dem operativen Ausblick von HCA Healthcare zugute (durch die positiven Auswirkungen auf die Hospitalisierungsraten), sodass die *Aktie* eine gute Performance erzielte.

Die Ergebnisse des dritten Quartals von UnitedHealth und der positive Ausblick für das Gesamtjahr gaben dem Kurs der *Aktie* Auftrieb und beruhigten Befürchtungen hinsichtlich höherer Kosten im Zusammenhang mit dem Coronavirus. Abbott Laboratories war ein weiterer starker Performer, der von soliden Ergebnissen im dritten Quartal 2021 profitierte. Umsatz und *Gewinne* übertrafen die Erwartungen, beflügelt durch Coronatests.

Auf der negativen Seite standen die Positionen in AIA Group und Ping An Insurance, die durch Sorgen wegen einer stärkeren regulatorischen Kontrolle der Versicherungsbranche und die negative Stimmung in Bezug auf das chinesische Finanzsystem beeinträchtigt waren. Insbesondere im Fall von Ping An sorgte eine Kombination aus einer schwachen Vertriebsorganisation (viele Teilzeitmitarbeiter), die derzeit vom Unternehmen neu geschult werden, und Überprüfungen der buchhalterischen Behandlung des gesetzlichen Kapitals für Kursschwäche der *Aktie*. Die *Aktie* von Medtronic fiel, nachdem die Umsatzerwartungen für sein Produkt für die renale Denervierung nach unten korrigiert wurden. Hintergrund war eine wesentliche Studie, die noch abgeschlossen werden musste, wodurch sich der Zulassungsantrag bei der US-Lebensmittelüberwachungs- und Arzneimittelzulassungsbehörde (FDA) verzögerte.

Was Veränderungen im Fonds betrifft, so nahm der Anlageverwalter nach einem Kursrutsch der *Aktie* M3 Inc ins Portfolio auf. Die *Aktie* bleibt ein einzigartiger Vermögenswert mit einer starken Präsenz in den USA und im Vereinigten Königreich sowie in Japan. Auch die Position in Jackson Financial wurde aufgestockt. Obwohl die Positionsgröße angesichts des höheren Risikoprofils der Gesellschaft relativ bescheiden ist, erachtete es der Anlageverwalter als sinnvoll, ein gewisses Engagement im US-Lebensversicherungssektor aufzubauen. Fresenius Medical Care wurde reduziert; hier war das Dialyse-Kerngeschäft weiterhin durch Covid-19 beeinträchtigt, und die operativen *Margen* standen durch höhere Arbeitskosten unter Druck. Ansonsten verkleinerte der Anlageverwalter aufgrund des insgesamt hohen Engagements in US-Heimwerkeraktien im Portfolio die Position in Home Depot.

Der primäre Fokus des Fonds wird weiter auf denjenigen Unternehmen liegen, die erstklassige und innovative Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, welche die Bedürfnisse und den Geschmack der alternden Weltbevölkerung bedienen. Diejenigen Unternehmen, die am besten aufgestellt sind, um diese Lösungen anzubieten, könnten von der zukünftigen strukturellen Nachfrage profitieren, die wiederum den langfristigen *Gewinnen* förderlich sein könnte, ungeachtet der kurzfristigen Unsicherheiten am Markt.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

## SPEZIALAKTIEN Forts.

### BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 15,27 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 11,04 % für den S&P Global Infrastructure NR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds übertraf seinen *Referenzwert*. Industrierwerte lieferten die größten Beiträge zur relativen Performance, und zwar insbesondere die *Aktienauswahl* in dem Sektor. Besonders erfolgreich war eine Position in der Deutschen Post. Die *Aktie* des Logistik- und Paketzustellkonzerns legte dank der hohen Nachfrage im Business-to-Consumer-Geschäft und einer sich entwickelnden Erholung des Business-to-Business-Segments zu. Ein fehlendes Engagement in europäischen Flughafenbetreibern wirkte sich ebenfalls positiv auf die relativen *Renditen* aus. Auf der negativen Seite schmälerte das Engagement des Fonds im Bereich Telekommunikationsinfrastruktur außerhalb des *Referenzwerts* die Performance, da Verizon Communications und Orange im Geschäftsjahr Kursverluste verzeichneten.

Der Anlageverwalter erhöhte das Engagement des Fonds in der Immobilienbranche, indem er eine Position in dem *Aktien-Real Estate Investment Trust (REIT)* Omega Healthcare Investors eröffnete; der *Aktien-REIT* American Tower wurde indessen verkauft. Auch das Engagement im Energiesektor wurde über Positionen in den Öl-, Gas- und Kraftstoffunternehmen Antero Midstream und Williams Companies erhöht. Der Anlageverwalter reduzierte die *Gewichtung* des Fonds in Industrierwerten, indem er die Positionen in Aena SME und Vinci verkaufte und bestehende Positionen in Deutsche Post und Atlantia reduzierte.

Ungeachtet unerwarteter Ereignisse, die die Wirtschaft belasten, ist nach Einschätzung des Anlageverwalters das Wirtschaftswachstum intakt, während die *Inflation* eine zentrale Frage bleibt. Der Infrastruktursektor scheint unter den aktuellen Rahmenbedingungen ein widerstandsfähiger Bereich zu sein, weil die entsprechenden Anlagen gebraucht werden und die Betreiber (z. B. von Mautstraßen, Brücken usw.) höhere Kosten an ihre Endnutzer weitergeben können. Auch wenn die Aussichten für die Agenda „Build Back Better“ geringer sind als zunächst erwartet, bringt das jüngst auf den Weg gebrachte Infrastrukturpaket in den USA nach Einschätzung des Anlageverwalters der Anlageklasse Unterstützung. Der europäische „Green Deal“ könnte diese Aussichten weiter bestärken.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

### BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USDA (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 18,12 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI AC World *Mid Cap* TR Index ein Plus von 16,39 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global - Equity Global ein Plus von 14,16 %, jeweils in US-Dollar.

Die Positionierung und die *Aktienauswahl* in Halbleitern und Halbleiterausstattung waren unter den positiven relativen Performern an der Spitze, in erster Linie dank einer Position in Nvidia außerhalb des *Referenzwerts* und einer *übergewichteten* Position in Marvell Technology. Nvidia übertraf die *Gewinnerwartungen* und hob nach der kräftigen Performance seiner Geschäftsbereiche Datenzentren und Gaming die Prognose an. Bei Marvell übertrafen die *Gewinne* die Erwartungen, da sich die Lieferengpässe schneller auflösten als erwartet. Der zweitgrößte relative Beitrag auf Sektorebene kam aus dem Sektor elektrische Ausrüstung. Hier profitierte der Fonds von einem Engagement in einer Reihe von Unternehmen außerhalb des *Referenzwerts*.

Auf der negativen Seite belasteten die Positionierung und *Aktienauswahl* im Softwaresektor am meisten die relative Performance. Eine Position in Everbridge außerhalb des *Referenzwerts* war der größte negative Performancefaktor nach dem abrupten Rücktritt von dessen Chief Executive Officer. Die *übergewichtete* Position des Fonds in dem Softwareunternehmen Splunk belastete ebenfalls die Renditen. Auch der Subsektor Straße und Schiene zeigte im Berichtszeitraum Schwäche.

Der Anlageverwalter erhöhte das Engagement des Fonds in den Subsektoren Straße und Schiene (über neue Positionen in Lyft und Uber Technologies) sowie Halbleiter und Halbleiterausstattung (durch Aufstockung der bestehenden Positionen in Nvidia und Marvell). Das Engagement im Automobilsektor wurde reduziert, indem eine bestehende Position in Tesla reduziert und Workhorse Group verkauft wurde.

Auch wenn die globale Autoproduktion insgesamt weiter unterhalb der Normalität liegt, war der Glanzpunkt auch 2021 das Wachstum bei Elektrofahrzeugen in Europa, China und den USA. Letztere weisen unter den größten Regionen weltweit die geringste Marktdurchdringung mit Elektrofahrzeugen auf. Ein positives Volumenwachstum bei Elektrofahrzeugen führt zu einer höheren Marktdurchdringung weltweit und übertraf die Erwartungen, was für die Aktien mit Elektrofahrzeugbezug im Fonds positiv ist. Der Anlageverwalter erwartet, dass sich dieser Trend durch den Umstieg von Unternehmen und Verbrauchern auf Elektrofahrzeuge fortsetzen wird.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

## SPEZIALAKTIEN Forts.

### BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 0,14 % nach Abzug von Gebühren, gegenüber einer *Rendite* von 18,54 % für den MSCI AC World NR Index.

Der Fonds erzielte eine positive *Rendite*, blieb aber hinter seinem *Referenzwert* zurück. Die Marktstimmung, die im Februar aufkam, verstärkte die Underperformance, die teilweise auf den Markterwartungen steigender Zinsen beruhte. Dies wirkte sich negativ auf Biotechnologie- und Wachstumsaktien aus. Dementsprechend belastete auch die Position in Clinical Pioneers im Portfolio am stärksten die Performance gegenüber dem *Referenzwert*.

Schwächster Titel im Fonds war im Berichtszeitraum Generation Bio. Die Genexpressionsdaten waren im nicht-humanen Primatenmodell viel weniger effektiv als bei Mäusen, was Zweifel an der innovativen Verabreichungstechnologie aufwarf. Ein weiteres Unternehmen mit negativem Performancebeitrag war uniQure. Das Unternehmen meldete frühzeitig Daten zu seiner Gentherapie gegen die Huntington-Krankheit, jedoch waren diese nicht schlüssig.

Intellia Therapeutics lieferte einen deutlichen Beitrag zur Performance dank solider Studiendaten für die Behandlung einer bestimmten Form von Neuropathie. Es war das erste Mal, dass ein Unternehmen erfolgreich die Technologie CRISPR Cas9 *in vivo* (d. h. an einem lebenden Organismus) statt im Labor anwandte. Für den Forschungsbereich stellte dies einen Wendepunkt dar. Charles River Laboratories International lieferte ebenfalls einen beträchtlichen positiven Beitrag mit seinen Investitionen und neuen Angeboten im Bereich Zell- und Gentechnologie.

Der Ausblick des Anlageverwalters für den Fonds bleibt robust. Derzeit laufen 1.300 klinische Programme in der Gentechnik, darunter mehrere bei der US-Lebensmittel- und Arzneimittelzulassungsbehörde (FDA). Möglicherweise hat der Sektor im Jahr 2021 im Bereich Zell- und Gentherapie mehr als 7 Mrd. USD erzielt, und der Anlageverwalter erwartet bis zum Ende des Jahrzehnts eine enorme Steigerung. Der Anlageverwalter erwartet, dass 2022 und darüber hinaus größere Akteure Interesse am Bereich Gentechnologie und -therapie zeigen werden. Der Fonds ist nach wie vor bestrebt, in neue und innovative Chancen zu investieren, die sich aus diesem attraktiven Paradigmenwechsel in der biopharmazeutischen Forschung und Entwicklung ergeben.

Newton Investment Management North America LLC\*  
Januar 2022

## GLOBALE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

### BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -0,73 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von -0,79 % für den Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate TR Index (USD Hedged) und -2,30 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global – Bond Global Corporates USD. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds übertraf nach Abzug von Gebühren seinen *Referenzwert* und den Sektordurchschnitt.

Globale *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* verzeichneten negative *Renditen*, da engere *Spreads* durch die Auswirkungen steigender Zinsen ausgeglichen wurden. Obwohl viele Industrieländer vom Roll-out der Covid-19-Impfungen und diversen *fiskal-* und *geldpolitischen Anreizen* profitierten, wurde die *Inflation* zunehmend zum Problem. Angesichts von 30-Jahres-Hochs bei der *Inflation* in den USA beschleunigte die US-Notenbank das Tempo beim Abbau ihres Anleihekaufprogramms und signalisierte für 2022 sage und schreibe drei Zinserhöhungen. Als erste der großen Zentralbanken erhöhte die Bank of England nach Beginn der Pandemie die Zinsen im Dezember um 25 *Basispunkte*, nachdem der britische *Verbraucherpreisindex* im November auf 5,1 % und damit auf den höchsten Stand seit über einem Jahrzehnt gestiegen war.

Die Europäische Zentralbank hat einen maßvollen Ton angeschlagen und angekündigt, die Notfallanleihekäufe langsam auslaufen zu lassen und gleichzeitig andere Stimuli zu verstärken, um die Erholung in der *Eurozone* zu stützen.

Der Fonds ist so positioniert, dass er ein *diversifiziertes Engagement* in globalen *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* mit ähnlichen *Kredit-, Durations- und Laufzeitmerkmalen* wie der Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index bietet, während er gleichzeitig versucht, das Herabstufungsrisiko und die Transaktionskosten, die mit traditionellen Stichproben- und Nachbildungsansätzen verbunden sind, abzuschwächen und zu minimieren.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -7,85 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von -6,50 % für den JP Morgan Global Government Bond Index (Unhedged) TR, jeweils in US-Dollar. Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück.

Der Fonds litt zunächst unter negativen Beiträgen von *längerfristigen Staatsanleihen* (mit *Laufzeiten* von 20 bis 30 Jahren), die von Industrieländern wie den USA, dem Vereinigten Königreich, Irland, Frankreich und Italien begeben wurden, weil die *Anleiherenditen* stiegen. Die Positionen in *Schwellenländeranleihen* schmälerten ebenfalls die *Renditen*.

## Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

### BNY MELLON GLOBAL BOND FUND FORTS.

Verluste entstanden durch Positionen in Lateinamerika, u. a. in Mexiko und Kolumbien, wo die Renditen stiegen. Die Short-Positionierung des Fonds im US-Dollar erwies sich als nicht hilfreich, obwohl der Anlageverwalter diese im Laufe des Berichtszeitraums reduzierte. Es entstanden Verluste durch das Engagement des Fonds im kolumbianischen Peso sowie in einigen anderen Long-Positionen in Schwellenländerwährungen, die gegenüber dem US-Dollar fielen. Dagegen brachten Short-Positionen auf den Euro, südafrikanischen Rand und die schwedische Krone eine gute Performance, da sich diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abschwächten.

Auf der positiven Seite erwies sich die Untergewichtung des Fonds in der Gesamt-Duration, und insbesondere in der US-Duration als günstig. Gewinne aus einigen Staatsanleihen (in Landeswährungen), und insbesondere in inflationsindexierten Wertpapieren wie indexgebundene Gilts, trugen vor dem Hintergrund steigender Zinserwartungen positiv zur Performance bei. Die Positionen des Fonds in chinesischen Staatsanleihen waren eine willkommene Diversifizierungsquelle, da die Renditen chinesischer Staatsanleihen im Vergleich zu der Volatilität bei traditionellen, als „sichere Häfen“ geltenden Staatsanleihen relativ stabil blieben.

In puncto Portfolioveränderungen reduzierte der Anlageverwalter zu Beginn des Berichtszeitraums die Duration des Fonds, indem er längerfristige Staatsanleihen aus den USA, Australien und Italien verkaufte. Der Fonds ist gegenüber seinem Referenzwert weiterhin untergewichtet in der Duration. In der zweiten Jahreshälfte wurden zwei- und zehnjährige US Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS) gekauft, um eine gewisse Absicherung gegen einen kurzfristigen Anstieg der Inflation hereinzunehmen. In der Schwellenländerpositionierung wurde das Engagement in chinesischen Staatsanleihen angesichts attraktiver Renditegefälle, geringer Inflation und niedriger Korrelationen zu anderen Märkten erhöht.

Die untergewichtete Position des Fonds im US-Dollar wurde taktisch reduziert und schließlich neutralisiert, da die Währung weiter aufwertete. Dies wurde überwiegend durch Diversifizierung der Finanzierungswährungen des Fonds erreicht: Die Short-Position im Euro wurde erhöht, und es wurden einige taktische Short-Positionen in mehreren Schwellenländern eingegangen. Der ungarische Forint wurde gekauft, der kolumbianische Peso indessen verkauft. Eine Untergewichtung des japanischen Yens, die zu Beginn des Berichtszeitraums vorlag, wurde nach der Schwäche des Yens aufgelöst und eine Long-Position eingegangen. Angesichts einer zinsbullischen Haltung der polnischen Nationalbank wurde eine Long-Position im polnischen Zloty eingegangen.

Der Anlageverwalter geht davon aus, dass Anleihen einen volatilen und schwierigen Jahresbeginn 2022 haben werden. Unter der Annahme, dass die Angst vor Covid-19 weiter nachlassen wird, könnten die Anleiherenditen vor dem Hintergrund der höheren Inflation und der Aussicht auf steigende Zinsen zu steigen beginnen. Dementsprechend favorisiert der Anlageverwalter weiterhin höher rentierliche Anlagen gegenüber höherwertigen Staatsanleihen.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -0,45 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -0,95 % für den Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit TR Index (hedged to US Dollars) und -1,04 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond Global Corporates USD. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber sowohl seinen Referenzwert als auch den Sektordurchschnitt. Die Kreditpositionierung des Fonds trug positiv zur Performance bei. Dabei war besonders die Auswahl der Wertpapiere erfolgreich. Auch die Kreditstrategie wirkte sich wertsteigernd aus, unterstützt durch die Long-Position des Fonds in Kreditrisiken, nachdem sich die Spreads weiter verengten. Die Allokation des Fonds in forderungsbesicherten Wertpapieren leistete ebenfalls einen bescheiden positiven Beitrag.

Dagegen belastete im Berichtszeitraum die Zinspositionierung des Fonds die Performance, vor allem wegen eines negativen Effekts aus den Renditekurvenstrategien (besonders im Oktober und November). Negativ wirkten sich aufgrund der September-Performance auch die Schwellenländer aus.

Der Fonds behielt seine Short-Duration-Positionierung bei, da die Anleiherenditen voraussichtlich steigen werden. Das Kreditengagement war neutral, mit einer Long-Position in Hochzinstiteln, ausgeglichen durch eine Short-Position in Investment-Grade-Positionen. Die Hauptpositionen des Fonds in der Länderauswahl waren eine Long-Position in Australien gegenüber einer Short-Position in den USA sowie eine Long-Position in Deutschland gegenüber einer Short-Position in Frankreich. Der Fonds ist nun einer Versteilerung der Renditekurve in Deutschland und einer Abflachung in Japan ausgesetzt.

Das Auftreten der Covid-19-Variante Omikron könnte angesichts der geringeren Schwere der Erkrankungen den Übergang von Covid von einer pandemischen zu einer endemischen Krankheit beschleunigen. Nachdem sich das Wachstum nun abzuschwächen beginnt, hat sich die Aufmerksamkeit darauf verlagert, wie die außerordentlichen fiskal- und geldpolitischen Unterstützungsmaßnahmen zurückgenommen werden.

Engpässe, die bei der Wiedereröffnung der Volkswirtschaften auftreten, verursachen eine höhere Inflation, aber die Beschäftigung nähert sich wieder den Niveaus von vor der Pandemie an. Die Preissteigerungen könnten sich möglicherweise als nicht vorübergehend erweisen, wenn sich die höheren Inflationserwartungen stärker festsetzen, und dann gibt es ein breites Spektrum an möglichen Entwicklungen.

Die strategischen Anleiheprognosen des Anlageverwalters liegen nun unter den Marktpreisen, sodass der Fonds zu einer Short-Duration tendiert.

Innerhalb des Kreditsektors ist der Fonds aufgrund eines sich verschlechternden Mixes aus Geldpolitik, Wachstum und Inflation bei gleichzeitig historisch unattraktiven Bewertungen von einer leicht positiven zu einer neutralen Position übergegangen. Der Anlageverwalter zieht Risikoallokationen in Relative-Value- und idiosynkratischen Transaktionen vor und hält dabei weiter Ausschau nach taktischen Gelegenheiten.

## Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

### BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND Forts.

Nach Einschätzung des Anlageverwalters sind *Investment-Grade*-Anleihen aus den Industrieländern jetzt relativ teuer, aber es gibt noch Chancen in Segmenten, die noch hinterherhinken, etwa bei *forderungsbesicherten Wertpapieren* und *Hochzins*-Staatsanleihen von *Schwellenländern*.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -1,47 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von 2,09 % für seinen *Referenzwert\**, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück. Die Underperformance des Fonds gegenüber seinem *Referenzwert* ergab sich weitgehend durch negative *Renditen* aus *Staatsanleihen* von *Schwellenländern* und Industrieländern. Letztere erlebten im ersten Teil des Berichtszeitraums eine Verkaufswelle, und *US-Staatsanleihen* zählten zu den größten negativen Performern im Portfolio. Die anfängliche *Short*-Positionierung des Fonds im US-Dollar erwies sich ebenfalls als nicht hilfreich.

Positionen in *Hochzins-Anleihen* erzielten in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums starke *Renditen*, generierten aber in der zweiten Hälfte Verluste.

Das Engagement in chinesischen Immobilienunternehmen wie Siunac und Shimao und in asiatischen börsengehandelten High-Yield-ETFs erwies sich als ungünstig, da diese unter der erheblichen *Volatilität* im Immobilienmarkt des Landes litten. Auch *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* waren in der zweiten Jahreshälfte schwach. Weitere negative Beiträge kamen von Positionen in *Anleihen* der Tschechischen Republik und Kolumbiens. Auf Währungsseite lieferten *Short*-Positionen im Euro, südafrikanischen Rand, philippinischen Peso und der schwedischen Krone eine gute Performance, während die *Long*-Position im kolumbianischen Peso die Performance schmälerte. Auch der japanische Yen schwächte sich ab, sodass die *Long*-Position des Fonds ungünstig war.

Engagements in *indexgebundenen Gilts*, anderen *inflationsexponierten Anleihen* und einigen *Staatsanleihen* (in Landeswährungen) waren den Renditen zuträglich.

In puncto Portfolioveränderungen reduzierte der Anlageverwalter zu Beginn des Berichtszeitraums die *Duration* der *Staatsanleihen*positionen im Fonds. **Positionen mit höheren *Durations*, inklusive langfristige US-Treasuries und australische und italienische Staatsanleihen, wurden verkauft.** Zwei- und zehnjährige *US Treasury Inflation-Protected Securities* (TIPS) wurden gekauft, um eine Absicherung gegen einen kurzfristigen Anstieg der Inflation hereinzunehmen. **Das Engagement des Fonds in *Hochzins-Unternehmensanleihen* wurde ebenfalls verstärkt.**

Das Engagement in *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* wurde im ersten Halbjahr verstärkt. Insbesondere wurden in diesem Zeitraum NatWest, Pacific Life und Tritax EuroBox ins Portfolio aufgenommen. Im weiteren Jahresverlauf wurde dieses Engagement aber wieder reduziert und u. a. Total Energies, Lafarge Holcim und Linde verkauft. Die Allokation des Fonds in *Staatsanleihen* von *Schwellenländern* wurde reduziert vor dem Hintergrund von Zentralbankmaßnahmen zum *schrittweisen Abbau* der expansiven *Geldpolitik* sowie der Abschwächung des chinesischen Wachstums. *ETFs* in *Hartwährungen* und Landeswährungen wurden verkauft. Die Anlagen des Fonds in norwegischen und italienischen *Anleihen* wurden zu Beginn des Berichtszeitraums verkauft.

Die *untergewichtete* Position des Fonds im US-Dollar wurde schließlich neutralisiert. Der Anlageverwalter verstärkte die *Euro-Short*-Position und löste die *Pfund Sterling-Short*-Position auf. Eine *untergewichtete* Position im japanischen Yen wurde zum Ende des Berichtszeitraums geschlossen und eine *Long*-Position eröffnet.

Nach Einschätzung des Anlageverwalters wird der Jahresbeginn 2022 eine *volatile* und schwierige Phase für *Anleihen* sein. Wenn die Angst vor Covid-19 weiter nachlassen wird, könnten die *Anleiherenditen* vor dem Hintergrund der höheren *Inflation* und der Aussicht auf steigende Zinsen zu steigen beginnen. In diesem Szenario favorisiert der Anlageverwalter weiterhin höher rentierliche Anlagen gegenüber höherwertigen *Staatsanleihen*.

\*SOFR (30 Tage aufgezinst) +2% p.a. Mit Wirkung vom 1. November 2021 wechselte der *Referenzwert* von der USD London Interbank Offered Rate (LIBOR) zur Secured Overnight Financing Rate (SOFR). Alle Angaben zur Wertentwicklung des *Referenzwerts* in der Vergangenheit vor diesem Datum wurden im Vergleich zum USD-LIBOR berechnet.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

## Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

### BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 4,09 % nach Abzug von Gebühren, während der ICE BofA Developed Markets High Yield Constrained TR Index (hedged to US Dollars) um 5,06 % zulegte.

Zu Beginn des Jahres 2021 befand sich der Markt für Hochzinsanleihen in sehr guter Verfassung und profitierte von einer starken Performance und technischen Marktfaktoren. Trotz eines kräftigen Anstiegs der Treasury-Zinsen im Jahresverlauf boten Hochzinsanleihen hohe Kuponrenditen, da die globale Geldpolitik und die globalen Wirtschaftsaufschwünge die anhaltenden Inflations Sorgen in den Hintergrund treten ließen. Die Spreads von Hochzinsanleihen verengten sich ab Jahresbeginn deutlich. Der Anlageverwalter erwartet, dass die Spreads 2022 volatiler sein werden, geht aber davon aus, dass der Markt gesund bleibt, unterstützt durch die Kreditfundamentaldaten und eine positive Anlegerstimmung. Die Performance war im Berichtszeitraum in allen Kreditratings positiv, wobei das Segment mit den niedrigeren Ratings 2021 die Führungsrolle inne hatte.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite, blieb aber hinter seinem Referenzwert zurück. Die Gewinne waren bestimmt durch eine starke Wertpapierauswahl in den Sektoren Rundfunk, Gaming und Heimwerker. Dies wurde teilweise ausgeglichen durch eine schwächere Aktienauswahl im starken Energiesektor (und eine Untergewichtung des Sektors insgesamt) sowie eine Übergewichtung des Kabelsektors.

Da die langfristige Bedeutung der Omikron-Variante von Covid-19 zu Jahresbeginn 2022 noch unbekannt ist, hat der Anlageverwalter sein Engagement in bestimmten Subsektoren, die stärker von Wiedereröffnungsrisiken betroffen sein dürften, reduziert.

Der globale Hochzinsmarkt hat sich von den Tiefpunkten nach den pandemiebedingten Rückgängen sehr deutlich erholt, was zum Teil einer Kombination aus beispiellosen globalen geldpolitischen Maßnahmen, fiskalischen Anreizen und Impfungen zu verdanken ist. Die Fundamentaldaten erholen sich in vielen Sektoren; diejenigen Sektoren, die sensibler auf die Covid-Entwicklungen reagieren, werden stark durch die Fortschritte bei den Impfkampagnen sowie durch die Ausbreitung neuer Varianten beeinflusst sein.

Der Anlageverwalter rechnet damit, dass die Zahlungsausfälle 2022 unter dem historischen Durchschnitt bleiben werden.

### BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND Forts.

Angesichts dieses optimistischeren Ausblicks sieht der Anlageverwalter Titel im niedrigeren Single-B-Bereich und ausgewählte Gelegenheiten im CCC-Bereich positiv. Zu den größten Risiken zählt in diesem Jahr die Straffung der Geldpolitik vor dem Hintergrund steigender Inflation. Der Fonds ist weiterhin untergewichtet in Vermögenswerten mit längerer Duration und niedrigen Kupons. Es ist zu erwarten, dass viele dieser Emittenten aufgrund besserer Fundamentaldaten in der Lage sein werden, solidere Bilanzen vorzuweisen, und von einer Spread-Verengung profitieren werden. Dazu zählen Emittenten aus den Bereichen Dienstleistungen, Gesundheitswesen, Baustoffe und Verpackung. Insgesamt hält der Anlageverwalter im Bereich festverzinsliche Wertpapiere globale Hochzinsanleihen weiterhin für attraktiv, da sie von ihren höheren Kupons, einem günstigen Ausblick für Zahlungsausfälle und niedriger Duration profitieren.

Alcentra NY, LLC  
Januar 2022

### BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 4,24 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 0,14 % für den Referenzwert\* und 2,61 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global – Bond Global High Yield USD. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert sowie den Sektordurchschnitt. Das Wirtschaftswachstum erholt sich dank umfangreicher fiskal- und geldpolitischer Anreize und des Roll-out der Covid-19-Impfprogramme, und entsprechend sind die Kreditausfälle weiter rückläufig, wenn auch im US-Energiesektor noch relativ hoch. Der Hochzinssektor schnitt dank einer allgemein positiven Risikohaltung und einer anhaltenden „Jagd“ nach Rendite gut ab. Mit zunehmender Erholung der Weltwirtschaft und höheren Inflationszahlen haben die großen Zentralbanken begonnen, ihre Geldpolitik zu straffen, was im Jahresverlauf zu einem deutlichen Anstieg der Renditen von Staatsanleihen geführt hat. Allerdings führte die Ausbreitung der Covid-19-Varianten Delta und Omikron zeitweise zur Einführung neuer Restriktionen, was den Anleihemärkten phasenweise Auftrieb gab (und für sinkende Renditen sorgte), da die Anleger Befürchtungen hinsichtlich der wirtschaftlichen Auswirkungen hegten.

Der Anlageverwalter investiert den Großteil (über 50%) des Vermögens in ein Portfolio aus Hochzinsanleihen mit kurzen Laufzeiten (die voraussichtlich innerhalb von ca. drei Jahren fällig werden) ohne geografischen, Branchen- oder Sektorschwerpunkt. Der Anlageverwalter legt in Schuldtitel und schuldtitelbezogene Wertpapiere der Kategorie Investment-Grade oder Sub-Investment-Grade an.

Das Portfolio enthält nun 88 Titel (Ende Dezember 2020: 77). Das durchschnittliche Kreditrating des Fonds wird mit B und die durchschnittliche Duration mit 1,1 Jahren angegeben.



## Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

### BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND Forts.

In puncto Veränderungen im Portfolio reinvestierte der Anlageverwalter Erlöse aus Calls und erhöhte aufgrund von Zuflüssen das Risiko, um schließlich die Stärke des Markts für einen Verkauf einiger hoch bewerteter Wertpapiere zu nutzen.

Die Renditen von Staatsanleihen dürften nach Einschätzung des Anlageverwalters steigen, aber in den meisten Fällen sind die Spreads weit genug, um angesichts solider Gewinnfundamentaldaten Zinsbewegungen zu bewältigen. Der Anlageverwalter wird selektiv in Unternehmen mit B-Ratings investieren und gegebenenfalls nachrangige Anleihen bis CCC-Rating ins Portfolio aufnehmen. Der Anlageverwalter erwartet, dass die Auswahl der Wertpapiere ein wesentlicher Performancefaktor sein wird, falls es zu irgendeinem Zeitpunkt zu einer Verkaufswelle kommt.

Angesichts der Risiken einer anhaltenden Zinsvolatilität und politischer Ereignisse könnte der Markt kurzfristig schwankungsanfällig sein. Das Angebot dürfte aber Anfang 2022 geringer sein, und einer Verkaufswelle könnte mit zusätzlichen Käufen begegnet werden, wie es bereits im Dezember der Fall war.

\*SOFR (90 Tage aufgezinnt). Mit Wirkung vom 1. November 2021 wechselte der Referenzwert von der USD London Interbank Offered Rate (LIBOR) zur Secured Overnight Financing Rate (SOFR). Alle Angaben zur Wertentwicklung des Referenzwerts in der Vergangenheit vor diesem Datum wurden im Vergleich zum USD-LIBOR berechnet.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -1,39% nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR + 2% p.a. ein Plus von 1,43%, jeweils in Euro.

Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück. Der Hauptfaktor hinter der Underperformance des Fonds war eine negative Rendite aus seinen Positionen in Schwellenländern. Aufgrund dessen eröffnete der Anlageverwalter eine Short-Position in 10-jährigen US-Treasuries, um das Durationsrisiko aus den Schwellenländeranlagen abzusichern. Dies trug zu einer Begrenzung der Verluste bei.

Positionen in Staatsanleihen der Industrieländer und Schwellenländeranlagen trugen negativ zur Performance bei, da beide Sektoren im Berichtsjahr eine Verkaufswelle erlebten. Schwellenländer-Staatsanleihen der Tschechischen Republik, Malaysias und Kolumbiens waren klar schwach. Allerdings konnten durch die Strategie des Anlageverwalters, mithilfe von Derivaten das Durationsrisiko abzusichern, die Auswirkungen der Verkaufswelle teilweise ausgeglichen werden. Die untergewichtete Position des Fonds im US-Dollar schmälerte zusätzlich die Renditen, ebenso eine Long-Position im kolumbianischen Peso. Die höchsten Renditen erzielte der Fonds mit Positionen in

Hochzinsanleihen, wobei die stärkste Performance von diversen Bankanleihen kam, u. a. von ewigen Anleihen von Investec und Société Générale.

Das Engagement in inflationsindexierten Wertpapieren wie indexgebundene Gilts und US Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS) wirkte sich für den Fonds ebenfalls positiv aus.

Der Anlageverwalter reduzierte in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums die Duration. Positionen mit höheren Durationen, inklusive langfristige US-Treasuries und australische und italienische Staatsanleihen, wurden verkauft. Der Fonds nahm an mehreren Neuemissionen im Segment der hochverzinslichen Unternehmensanleihen teil. Der Tiefkühlkosthersteller Nomad Foods und das Chemieunternehmen Nobian wurden neu ins Portfolio aufgenommen. Außerdem eröffnete der Anlageverwalter eine Position in dem Online-Lebensmittelhändler Ocado. Weitere Neuzugänge zu Beginn des Berichtszeitraums waren Anleihen von Bway und Kloeckner.

Vor dem Hintergrund der steigenden Inflation wurden 2- und 10-jährige TIPS gekauft. Die Allokation des Fonds in Staatsanleihen von Schwellenländern wurde reduziert. Ebenso wurde das Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen heruntergefahren. Dies erfolgte in erster Linie durch den Verkauf diverser auf Euro lautender Wertpapiere wie SIG Combibloc. Darin spiegelte sich die Sorge wider, dass die Renditen deutscher Staatsanleihen zu niedrig seien. Auch das Engagement in Meituan wurde angesichts der eskalierenden von China ausgehenden Risiken reduziert.

Auf der Währungsseite wurden der kanadische Dollar und der ungarische Forint gekauft und der kolumbianische Peso verkauft. Später im Berichtszeitraum wurde die Long-Position im südkoreanischen Won verkauft. Der Anlageverwalter nahm vor dem Hintergrund einer zinsbullischen Haltung der polnischen Nationalbank eine Long-Position im polnischen Zloty ins Portfolio auf. Ende November wurde zudem eine Long-Position im japanischen Yen eröffnet, um Risikoanlagen abzusichern. Die untergewichtete Position des Fonds im US-Dollar wurde taktisch reduziert.

Der Anlageverwalter geht davon aus, dass Anleihen einen volatilen und schwierigen Jahresbeginn 2022 haben werden. Unter der Annahme, dass die Angst vor Covid-19 weiter nachlassen wird, könnten die Anleiherenditen vor dem Hintergrund der höheren Inflation und der Aussicht auf steigende Zinsen ihren allmählichen Anstieg wieder aufnehmen. Daher favorisiert der Anlageverwalter weiterhin höher rentierliche Anlagen gegenüber höherwertigen Staatsanleihen.

Newton Investment Management Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 eine Rendite von 3,14% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 3,75% für den Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate USD Hedged TR Index, jeweils in US-Dollar.

## Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

### BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND Forts.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite, hielt aber nicht mit seinem Referenzwert Schritt. Positive Renditen bei Hochzinsanleihen erhielten Unterstützung durch die wachsende Risikobereitschaft der Anleger, die angesichts ermutigender Konjunkturindikatoren und steigender Unternehmensgewinne optimistischer wurden. Abgesehen von einer gewissen kurzfristigen Volatilität ignorierte der Markt im Allgemeinen die Risiken, die mit einer steigenden weltweiten Inflation und dem Auftreten der Omikron-Variante von Covid-19 im November verbunden waren. Die Kreditspreads verengten sich über den gesamten Berichtszeitraum, lagen aber deutlich unter den historischen Durchschnitten. Das Kreditrating für diesen Bereich verbesserte sich im Vergleich zu 2020, worin sich niedrige Ausfallquoten, eine verbesserte Rentabilität bei den Unternehmen und sinkende Verschuldungsgrade widerspiegeln. Trotz rekordniedriger Spreads sieht der Anlageverwalter bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen im Vergleich zu anderen Kreditprodukten noch attraktive Renditechancen.

Der Fonds ist so positioniert, dass er ein diversifiziertes Engagement in globalen hochverzinslichen Unternehmensanleihen mit ähnlichen Kredit-, Durations- und Laufzeitmerkmalen wie im Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate Index bietet, während er gleichzeitig versucht, das Ausfallrisiko und die Transaktionskosten, die mit traditionellen Muster- und Nachbildungsansätzen verbunden sind, abzuschwächen und zu minimieren.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

## Regionale & Spezialanleihen

### BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 5,35 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 6,57 % für den Bloomberg Barclays US HY Fallen Angels 3% Cap Total Return Index Value Unhedged, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive Rendite, hielt aber nicht mit seinem Referenzwert Schritt. Der Fallen Angel Index erzielte im Berichtsjahr eine solide Gesamtrendite, zu der u. a. eine Verengung der Spreads beitrug, da die Anleger weiter einen starken Appetit nach Risikoanlagen an den Tag legten und ihre Nachfrage nach Erträgen intakt blieb.

Allerdings wurde der positive Effekt engerer Spreads teilweise ausgeglichen durch einen Anstieg der Rendite fünfjähriger US Treasuries, da die steigende Inflation (bedingt durch steigende Energiepreise und Lieferkettenunterbrechungen) die großen Zentralbanken, allen voran die US-Notenbank, veranlasste, eine Straffung der Geldpolitik einzuleiten. Während sich die Spreads im Jahresverlauf insgesamt weiter verengten, erweiterten sie sich im November spürbar, als die Omikron-Variante von Covid-19 entdeckt wurde und die Anleger befürchteten, die Variante könnte den Impfschutz umgehen und weitere Lockdowns auslösen. Die beruhigende Nachricht, dass die neue Variante relativ mild sei, führte dann dazu, dass die Spreads ihren Verengungstrend im Dezember wieder aufnahmen.

Auf Indexebene brachte der Energiesektor die stärkste Performance (unterstützt durch ein günstiges Verhältnis zwischen Angebot und Nachfrage), dicht gefolgt vom Transportsektor (durch die Erholung der Geschäftsaktivitäten). Dagegen verzeichnete der relativ defensive Kommunikationssektor eine Underperformance.

Im Jahr 2021 gab es Neuzugänge im Universum der Fallen Angels (Anleihen, die ihren Investment-Grade-Status verloren haben) in einem Volumen von ca. 10 Mrd. USD nach ausstehenden Beträgen, während Rising Stars (diejenigen, die das Potenzial haben, kurzfristig zu Investment-Grade aufzusteigen) mit einem Volumen von 26 Mrd. USD das Universum der Fallen Angels verließen. Rising Stars lieferten im Berichtsjahr einen bedeutenden Beitrag zur Outperformance der Fallen Angels gegenüber Hochzinsanleihen, denn 11,5 % des Fallen-Angels-Universums wurden zu Rising Stars, verglichen mit nur 3,6 % des breiteren Hochzinsuniversums.

In puncto Performancebeiträge lieferten die Faktoren Umwelt, Soziales und Corporate Governance sowie die jüngsten strukturell übergewichteten Positionen in Fallen Angels marginal positive Beiträge. Dagegen schmälerten das Kreditmodell, die Wertpapierauswahl und Transaktionskosten für Neugewichtungen die Performance.

Die Kreditspreads von Fallen Angels nähern sich nun wieder historisch engen Niveaus an, und der Anlageverwalter ist der Meinung, dass diese durch sehr positive wirtschaftliche Rahmenbedingungen gerechtfertigt sind. Dies hat mehrere Gründe. Erstens dürften die Unternehmen auch 2022 hohe Gewinne erzielen, solange es keine größeren Schocks gibt.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND Forts.

Zweitens könnten die *Zahlungsausfälle* auf historisch niedrigen Niveaus bleiben, nachdem es 2021 fast keine Ausfälle gegeben hat. Drittens erscheinen die Bewertungen im Verhältnis zu den erwarteten *Zahlungsausfällen* attraktiv. Angesichts günstiger wirtschaftlicher Rahmenbedingungen und eines hohen Maßes an Liquidität in den Unternehmensbilanzen dürften nach Einschätzung des Anlageverwalters mehr *Rising Stars* den *High Yield Index* verlassen als *Fallen Angels* hinzukommen. Allerdings könnten anhaltende Befürchtungen im Zusammenhang mit Covid-19 idiosynkratische oder sektorspezifische Auswirkungen haben.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 4,89 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von 5,28 % für den Bloomberg Barclays US Corporate High Yield TR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem *Referenzwert* Schritt.

Der *High Yield Index* erzielte im Berichtsjahr eine solide *Gesamtrendite*, zu der u.a. eine Verengung der *Spreads* beitrug, da die Anleger weiter einen starken Appetit nach *Risikoanlagen* an den Tag legten und ihre Nachfrage nach Erträgen intakt blieb. Allerdings wurde der positive Effekt engerer *Spreads* teilweise ausgeglichen durch einen Anstieg der *Rendite* fünfjähriger US-*Treasuries*, da die höhere *Inflation* (bedingt durch steigende Energiepreise und anhaltende Lieferkettenunterbrechungen) die großen Zentralbanken, allen voran die US-Notenbank, veranlasste, eine Straffung der *Geldpolitik* einzuleiten. Während sich die *Spreads* im Jahresverlauf insgesamt weiter verengten, erweiterten sie sich im November spürbar, als die Omikron-Variante von Covid-19 entdeckt wurde und sich ausbreitete und die Anleger befürchteten, die Variante könnte den Impfschutz umgehen und weitere Lockdowns auslösen. Die beruhigende Nachricht, dass die neue Variante relativ mild sei, führte dann dazu, dass die *Spreads* ihren Verengungstrend im Dezember wieder aufnahmen.

Auf *Indexe*ebene brachte der Energiesektor die stärkste Performance (unterstützt durch ein günstiges Verhältnis zwischen Angebot und Nachfrage), dicht gefolgt vom Transportsektor (durch die Erholung der Geschäftsaktivitäten).

Dagegen verzeichnete der relativ *defensive* Kommunikationssektor eine Underperformance.

Die Performancebeiträge des *Kreditmodells* und der *Wertpapierauswahl* im Portfolio waren im Berichtsjahr gedämpft.

Die *Kreditspreads* von *Hochzinsanleihen* nähern sich nun wieder historisch engen Niveaus an, und der Anlageverwalter ist der Meinung, dass diese durch sehr positive wirtschaftliche Rahmenbedingungen gerechtfertigt sind. Dies hat mehrere Gründe. Erstens dürften die Unternehmen auch 2022 hohe *Gewinne* erzielen, solange es keine größeren Schocks gibt. Zweitens könnten die *Zahlungsausfälle* auf historisch niedrigen Niveaus bleiben, nachdem es 2021 fast keine Ausfälle gegeben hat. Drittens erscheinen die Bewertungen im Verhältnis zu den erwarteten *Zahlungsausfällen* attraktiv.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -2,56 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von 0,91 % für den JP Morgan Corporate EMBI Broad Diversified TR Index und -2,48 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond Emerging Markets Global Corporates. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* und dem Sektordurchschnitt zurück. Auf regionaler Ebene belastete Asien deutlich die Performance, aus dem Nahen Osten und Afrika sowie Lateinamerika kamen leicht negative Beiträge. Dagegen trugen Mittel- und Osteuropa positiv zur Performance bei.

China belastete im Berichtszeitraum deutlich die Performance, und auch Russland, Indien und Jamaika lieferten negative Beiträge. Von Argentinien, der Türkei und der Ukraine kamen die größten positiven Beiträge.

Auf Sektorebene belasteten Finanzwerte erheblich die Performance. Auch Öl und Gas brachten negative Beiträge. Die größten positiven Beiträge kamen aus den Sektoren *Grundstoffe*, Konsumgüter und Verbraucherdienstleistungen.

*Hochzinsanleihen*, insbesondere aus dem breiten Segment der Titel mit BB- und B-Ratings (von BB+ bis B-), belasteten dagegen die Performance. Titel mit niedrigeren Ratings im breiten CCC-Segment (von CCC+ bis CCC-) dagegen trugen positiv zur Performance bei. *Investment-Grade-Anleihen* (mit Ratings von BBB- oder höher) lieferten insgesamt negative Beiträge. *Anleihen mit Fälligkeiten* von weniger als einem Jahr und, in geringerem Umfang, von 10 oder mehr Jahren belasteten die Performance; *Fälligkeiten* von 3-5 Jahren und, in geringerem Umfang, von 5-10 Jahren trugen positiv zur Performance bei.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND Forts.

Der Anlageverwalter nahm im Berichtszeitraum verschiedene Anpassungen der Fondspositionen vor. Die *übergewichtete* Position im *Hochzinssektor* wurde im Laufe des Jahres reduziert; der Anlageverwalter hatte sie ursprünglich aufgrund des sich verbessernden Wachstumsausblicks ins Portfolio aufgenommen. In Erwartung einer steigenden *Inflation*, die zu höheren Zinsen führt, wurde auch die *Übergewichtung* des Fonds in der *Duration* reduziert. Der Anlageverwalter nahm attraktiv bewertete Neuemissionen ins Portfolio auf, erhöhte aber zum Ende des Berichtszeitraums die Liquidität. Die bevorzugten *übergewichteten* Positionen von Ländern waren Brasilien, Mexiko, Chile und Russland. Viele der Faktoren, die 2021 zu der Underperformance von *Schwellenländeranlagen* geführt haben, sind auch weiterhin gegeben: ein Umfeld steigender Zinsen in den USA, anhaltende *Inflationsbefürchtungen* und Sorgen angesichts der relativ langsamen geldpolitischen Reaktion aus China sowie um den Zustand des chinesischen Immobiliensektors. Ein Großteil dieser Faktoren spiegelt sich aber bereits in deutlich schwächeren Bewertungen und einem hohen Maß an Liquidität bei den Anlegern wider.

Die wichtigsten kurzfristigen Faktoren in den *Schwellenländern* dürften die Neukalibrierung zwischen Markterwartungen und der US-Notenbank hinsichtlich Timing, Tempo und Schlusspunkt des bevorstehenden Zinserhöhungszyklus sein, die Wachstums- und politische Richtung in China sowie angebotstechnische Faktoren. Daher ist der Fonds vorerst etwas vorsichtig positioniert. Längerfristig werden sich nach Einschätzung des Anlageverwalters die *Marktfundamentaldaten in den Schwellenländern* verbessern, und das über dem Trend liegende Wachstum erscheint attraktiv.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -2,54 % nach Abzug von Gebühren, während der JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global TR Index 1,51 % verlor, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück. Hintergrund war eine Eintrübung der Marktstimmung wegen des verlangsamten globalen Wachstums, höherer *Inflation* und steigender Covid-19-Fallzahlen. Der Fonds profitierte in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums von *übergewichteten* Allokationen in *Grenzmärkten* und *Unternehmensanleihen*, insbesondere im BB-Rating-Segment (*Kreditrating*). Eine *Übergewichtung* von *Unternehmensanleihen* und eine Allokation in *Quasi-Staatsanleihen* trugen positiv zur Performance bei, während sich eine *Untergewichtung* von *Staatsanleihen* leicht negativ auswirkte.

2021 wurde die Strategie einer *Long*-Positionierung in Risiken durch *übergewichtete* Positionen in *Grenzmärkten* und *Unternehmensanleihen* beibehalten. Zum Jahresende reduzierte der Anlageverwalter das aktive Risiko des Fonds infolge eines Abbaus *übergewichteter* Positionen im *Hochzinsteil* des *Portfolios*.

Der größte Teil des Risikos stammt von *Spreads*, ein kleiner Teil ist der marginalen *Untergewichtung* des Fonds in der *Duration* zuzurechnen. Der Fonds war *übergewichtet* in *B/BB-Unternehmensanleihen* und *übergewichtet* in *Unternehmensanleihen* gegenüber *Staatsanleihen*.

Die Nachfrageerholung, die schneller vonstatten ging, als die Lieferketten wieder Kapazitäten aufbauen konnten, sorgte in bestimmten Sektoren für Preisauftrieb. Dies wurde verstärkt durch erhöhte Lieferkosten und kräftig steigende *Rohstoffpreise*. Die *Inflation* hat sich beschleunigt, weshalb mit unterschiedlichen Dringlichkeitsgraden eine Normalisierung der *Geldpolitik* angestrebt wird. In einigen *Schwellenländern* hat der Straffungszyklus bereits begonnen. In *Industrieländern* werden Anleihekaufprogramme beendet, und die Bank of England hat die Zinsen erhöht. In den USA werden die beispiellosen *fiskalische Anreize* wohl noch für einige Jahre bestehen bleiben, doch in den meisten anderen Ländern ist im kommenden Jahr ein gewisses Maß an fiskalischer Straffung zu erwarten.

Insight Investment Management (Global) Limited\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -9,36 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -8,75 % für den JP Morgan GBI-EM Global Diversified TR Index, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück. Hintergrund war eine Eintrübung der Marktstimmung wegen des verlangsamten globalen Wachstums, höherer *Inflation* und steigender Covid-19-Fallzahlen. Der Fonds profitierte von lokalen Zinssätzen und der *Spread*-Positionierung, insbesondere von einer *übergewichteten* Position in Polen und dem Engagement in *Quasi-Staatsanleihen* in Mexiko und Kolumbien. Diese Gewinne wurden teilweise ausgeglichen durch eine schwächere Währungs-Performance in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums, als *übergewichtete* Positionen im kolumbianischen und chilenischen Peso die Performance schmälerten.

Der Anlageverwalter reduzierte das Risiko des Fonds und behielt gleichzeitig eine strategische Position durch *Long*-Positionen in ausgewählten *Schwellenländerwährungen* bei, finanziert durch eine Kombination aus überwiegend Euro und dem US-Dollar. In der ersten Jahreshälfte wurde die Finanzierungswährung vom US-Dollar in einen Mix aus US-Dollar und Euro rotiert.

Die Nachfrageerholung, die schneller vonstatten ging, als die Lieferketten wieder Kapazitäten aufbauen konnten, sorgte in bestimmten Sektoren für Preisauftrieb. Dies wurde verstärkt durch erhöhte Lieferkosten und kräftig steigende *Rohstoffpreise*.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND Forts.

Die *Inflation* hat sich beschleunigt, weshalb mit unterschiedlichen Dringlichkeitsgraden eine Normalisierung der *Geldpolitik* angestrebt wird. In einigen *Schwellenländern* hat der Straffungszyklus bereits begonnen. In Industrieländern werden Anleihekaufprogramme beendet, und die Bank of England hat die Zinsen erhöht. In den USA werden die beispiellosen *fiskalische Anreize* wohl noch für einige Jahre bestehen bleiben, doch in den meisten anderen Ländern ist im kommenden Jahr ein gewisses Maß an fiskalischer Straffung zu erwarten.

Insight Investment Management (Global) Limited\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -5,76 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -4,68 % für den *Referenzwert*, einen zusammengesetzten Index, der sich zu 50 % aus dem JP Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified TR Index, zu 25 % aus dem JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global TR Index und zu 25 % aus dem JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified TR Index zusammensetzt, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück. Hintergrund war eine Eintrübung der Marktstimmung wegen des verlangsamten globalen Wachstums, höherer *Inflation* und steigender Covid-19-Fallzahlen. Der Fonds profitierte in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums von *übergewichteten* Allokationen in *Grenzmärkten* und *Unternehmensanleihen*, insbesondere im BB-Rating-Segment (Kreditrating). Eine *Übergewichtung* von *Unternehmensanleihen* und eine Allokation in *Quasi-Staatsanleihen* trugen positiv zur Performance bei, während sich eine *Untergewichtung* von *Staatsanleihen* leicht negativ auswirkte.

2021 wurde die Strategie einer *Long-Positionierung* in Risiken durch *Übergewichtung* von *Grenzmärkten* und *Unternehmensanleihen* beibehalten. Zum Jahresende reduzierte der Anlageverwalter das aktive Risiko des Fonds infolge eines Abbaus *übergewichteter* Positionen im *Hochzinsteil* des *Portfolios*. Der größte Teil des Risikos stammt von *Spreads*, ein kleiner Teil ist der marginalen *Untergewichtung* des Fonds in der *Duration* zuzurechnen. Der Fonds war *übergewichtet* in *Unternehmensanleihen* der Rating-Kategorien B/BB und *übergewichtet* in *Unternehmensanleihen* gegenüber *Staatsanleihen*.

Die Nachfrageerholung, die schneller vonstatten ging, als die Lieferketten wieder Kapazitäten aufbauen konnten, sorgte in bestimmten Sektoren für Preisauftrieb. Dies wurde verstärkt durch erhöhte Lieferkosten und kräftig steigende *Rohstoffpreise*. Die *Inflation* hat sich beschleunigt, weshalb mit unterschiedlichen Dringlichkeitsgraden eine Normalisierung der *Geldpolitik* angestrebt wird. In einigen *Schwellenländern* hat der Straffungszyklus bereits begonnen.

In Industrieländern werden Anleihekaufprogramme beendet, und die Bank of England hat die Zinsen erhöht. In den USA werden die beispiellosen *fiskalische Anreize* wohl noch für einige Jahre bestehen bleiben, doch in den meisten anderen Ländern ist im kommenden Jahr ein gewisses Maß an fiskalischer Straffung zu erwarten.

Insight Investment Management (Global) Limited\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -7,90 %, verglichen mit einer Rendite von -3,25 % für den *Referenzwert\** und -8,28 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global – Bond Emerging Markets Global LC. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* und dem Sektordurchschnitt zurück. Auf regionaler Ebene belastete insbesondere Lateinamerika die Performance sowie Asien, Mittel- und Osteuropa und *Portfolioabsicherungen*. Kleine positive Beiträge kamen dagegen aus dem Nahen Osten & Afrika sowie aus Industrieländern.

Die Währungsallokationen belasteten in erheblichem Maße die Performance. Die größten negativen Beiträge kamen dabei aus Brasilien, Kolumbien und Chile, während die USA, Indien und Polen positiv zur Performance beitrugen.

Auch auf US-Dollar lautende *Staatsanleihen* schmälerten etwas die Performance: Ägypten, die Ukraine und die USA brachten leicht negative Beiträge, Deutschland einen kleinen positiven.

*Unternehmensanleihen* in US-Dollar lieferten dank Mexiko leicht positive Beiträge. Es gab in dieser Kategorie keine Positionen, die Verluste brachten.

Auch Positionen in Landeswährungen hatten einen kleinen positiven Effekt auf die *Renditen*. Ägypten, Argentinien und Südafrika lieferten positive Beiträge, Brasilien, Kolumbien und Malaysia negative.

In puncto *Portfolioveränderungen* behielt der Anlageverwalter eine *übergewichtete* Allokation in externen staatlichen *Hochzinsanleihen* bei (Anleihen, die ein Land an Kreditgeber außerhalb des Landes ausgibt), die auf historischer Basis attraktiv bewertet erschienen. Die bevorzugten Länder des Anlageverwalters in diesem Bereich waren Ägypten, Argentinien, die Bahamas, die Dominikanische Republik, Ecuador, die Elfenbeinküste, Ghana, Nigeria, Serbien, Tunesien und die Ukraine. Der Fonds war ferner in ausgewählten lokalen Zinspositionen engagiert. Bevorzugte *übergewichtete* Länderpositionen in diesem Bereich waren Brasilien, Mexiko, Chile und Russland.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND Forts.

Viele der Faktoren, die 2021 zu der Underperformance von *Schwellenländer*anlagen geführt haben, sind auch weiterhin intakt: ein Umfeld steigender Zinsen in den USA, anhaltende *Inflations*befürchtungen und Sorgen angesichts der relativ langsamen geldpolitischen Reaktion aus China sowie um den Zustand des chinesischen Immobiliensektors. Ein Großteil dieser Faktoren spiegelt sich aber nach Ansicht des Anlageverwalters bereits in deutlich schwächeren Bewertungen und einem hohen Maß an Liquidität bei den Anlegern wider.

Die wichtigsten kurzfristigen Faktoren in den *Schwellenländern* dürften die Neukalibrierung zwischen Markterwartungen und der US-Notenbank hinsichtlich Timing, Tempo und Schlusspunkt des bevorstehenden Zinserhöhungszyklus sein, die Wachstums- und politische Richtung in China sowie angebotstechnische Faktoren.

Daher ist der Fonds vorerst etwas vorsichtig positioniert.

Längerfristig werden sich nach Einschätzung des Anlageverwalters die *Marktfundamental*daten in den *Schwellenländern* verbessern, und das über dem Trend liegende Wachstum erscheint attraktiv.

\*Bestehend aus 1/3 JP Morgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified TR Index, 1/3 JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified TR Index, 1/3 JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified TR Index.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -3,83 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der Boomerang Barclays Euro Aggregate Bond TR Index eine *Rendite* von -2,85 %, jeweils in Euro.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem *Referenzwert* zurück.

Die Underperformance des Fonds war zurückzuführen auf einen negativen Beitrag aus der Auswahl der *Wertpapiere*, der *Renditekurven*- und *Durations*positionierung und der Sektorallokation. Sowohl eine *übergewichtete* Allokation in *Schwellenländern* als auch eine *untergewichtete* Allokation in *Staatsanleihen* waren der Performance zuträglich. Die Währungsengagements brachten leichte Verluste.

Der Anlageverwalter reduzierte im Laufe des Monats September sein Engagement in *Investment-Grade*-Unternehmensanleihen, als sich die *Spread*-Verengung dem vom Anlageverwalter als angemessen erachteten Wert näherten. Bis zum Ende des Berichtszeitraums stockte der Anlageverwalter dann jedoch angesichts erneut attraktiver Bewertungen wieder *Investment-Grade*-Unternehmensanleihen auf. Das Engagement des Fonds lag zum Jahresende bei 16,1 % und blieb im Index *untergewichtet* (19,1 %).

Der Anlageverwalter nahm im Berichtszeitraum auch an Neuemissionen in unterschiedlichen Sektoren teil.

Die *Inflation* liegt in den USA auf dem höchsten Niveau seit Jahrzehnten. Die Lieferkettenunterbrechungen und die schnelle Wiedereröffnung ermöglichten Kursgewinne auf breiterer Front. Vor diesem Hintergrund erwartet der Anlageverwalter, dass die US-Notenbank 2022 dreimal die Zinsen erhöht, um der hohen *Inflation* entgegenzuwirken. Das Programm zur *Reduzierung* der Anleihekäufe dürfte im März enden, und der Anlageverwalter erwartet ab der zweiten Jahreshälfte 2022 eine Reduzierung der Bilanz.

Kurzfristige Wachstumsrisiken gibt es in China angesichts der anhaltenden Probleme im Immobiliensektor. Hinzu kommt, dass die Verlagerung der globalen Nachfrage von Waren zurück zu Dienstleistungen die Exporte belasten wird. Die lokalen Staatsausgaben dürften aber in der zweiten Jahreshälfte steigen, was nach Einschätzung des Anlageverwalters einen Teil dieser Gegenwinde ausgleichen dürfte.

In der *Eurozone* ist neben den Auswirkungen der neuen Covid-19-Varianten auf die globale Nachfrage die *Inflation* nach wie vor ein zentrales Risiko aufgrund der Exportabhängigkeit der Region. Angesichts eines schwachen mittelfristigen *Inflations*ausblicks geht der Anlageverwalter davon aus, dass die *Geldpolitik* locker bleiben wird. Allerdings sind die *Inflations*risiken klar gestiegen, was für die Europäische Zentralbank problematisch werden könnte.

Insight Investment Management (Global) Limited\*  
Januar 2022

### BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -0,66 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer *Rendite* von -1,08 % für den Markt iBoxx Euro Corporates TR Index und -0,82 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond EUR Corporates. Alle Angaben in Euro.

Der Fonds verzeichnete eine negative *Rendite*, übertraf aber sowohl seinen *Referenzwert* als auch den Sektordurchschnitt. Die Auswahl der *Wertpapiere* war im Berichtszeitraum in einer Reihe von Sektoren einheitlich stark. Auch die *Kreditstrategie* des Fonds trug zur Outperformance gegenüber dem *Referenzwert* bei. Innerhalb der Sektorallokation lieferten Automobile, Immobilien und *forderungsbesicherte Wertpapiere* positive Beiträge, während Energie und die Absicherung über den iTraxx Main die Performance schmälerten. Positionen im BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund und im BNY Mellon Emerging Market Corporate Debt Fund trugen ebenfalls positiv zur Performance bei.

Das allgemeine Engagement in *Unternehmensanleihen* trug in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums positiv zur Performance bei, was der *Übergewichtung* des Fonds in Kreditrisiken bei sich verengenden *Spreads* zu verdanken war. In der zweiten Jahreshälfte wirkte sich diese Positionierung negativ aus, weil sich die *Spreads* erweiterten (vor allem im November). *Durations*- und *Renditekurvenstrategien* brachten leicht negative Beiträge.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND Forts.

Insbesondere wirkte sich die *Short-Duration*-Position des Fonds im November bei fallenden *Renditen* negativ aus. Ein Großteil dieses Effekts wurde jedoch im Dezember ausgeglichen, als die *Renditen* wieder nach oben tendierten.

Der Anlageverwalter nahm im Berichtszeitraum an Neuemissionen in unterschiedlichen Sektoren teil.

In der *Eurozone* ist neben den Auswirkungen etwaiger neuer Covid-19-Varianten auf die globale Nachfrage die *Inflation* nach wie vor ein zentrales Risiko aufgrund der Exportabhängigkeit der Region. Angesichts eines schwachen mittelfristigen *Inflations*ausblicks geht der Anlageverwalter davon aus, dass die *Geldpolitik* locker bleiben wird. Allerdings sind die *Inflationsrisiken* hoch, was für die Europäische Zentralbank problematisch werden könnte.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

### BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USDC (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von 1,06 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu *rentierte* der Referenzwert (50% Bloomberg Barclays US Municipal Bond TR Index, 50% Bloomberg Barclays Taxable US Municipal Bond TR Index) mit 1,24 %, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive *Rendite*, hielt aber nicht mit seinem Referenzwert Schritt. Steuerbefreite US-Kommunalanleihen überflügelten im Berichtsjahr steuerpflichtige US-Kommunalanleihen. Dagegen brachten US-Treasuries im Berichtsjahr eine negative *Rendite*, ebenso *Investment-Grade*-Unternehmensanleihen aus den USA – wenn auch in geringerem Maße, da sich bei letzteren die *Spreads* weiter verengten.

Das Bruttovolumen der gesamten Neuemissionen von Kommunalanleihen blieb im jährlichen Berichtszeitraum mit 473 Mrd. USD sehr hoch. Die Zuflüsse in kommunale Investmentfonds stützten weiter die Nachfrage und beliefen sich 2021 auf 82 Mrd. USD.

Das Engagement des Fonds in steuerbefreiten *Wertpapieren* lag bei ca. 33 %, der Rest des Fondsvermögens war in steuerpflichtigen Kommunalanleihen, Anleihen von Non-Profit-Unternehmen und in Liquidität angelegt. Das Risiko des Fonds konzentriert sich in erster Linie auf seine Positionierung auf der Zins- und *Renditekurve* sowie ein *übergewichtetes* Engagement in steuerpflichtigen Instrumenten.

Der Anlageverwalter bevorzugte weiterhin *Revenue Bonds*, und im Dezember hielt der Fonds zu 79,7 % diese Titel, gegenüber 63,9 % im Referenzwert. *Übergewichtete* Positionen hielt der Fonds in den Subsektoren Krankenhäuser, Transport und Flughäfen. Der Anlageverwalter ist der Auffassung, dass diese Sektoren weiter von erheblichen *fiskalischen Anreizen* profitieren werden. Gut aufgestellte Emittenten verfügten vor der Pandemie über eine hohe *Liquidität*.

Der Fonds war stark *untergewichtet* in *General Obligation Securities* (GO) auf Emittentenebene: Nur 2,5 % wurden in GO der Staaten Kalifornien und New York gehalten, gegenüber ca. 14,3 % in allen Staaten innerhalb des Referenzwerts.

57,0 % des Fondsvermögens entfielen auf die fünf größten Positionen und umfassten *Anleiheemittenten* in Kalifornien, New York, Pennsylvania, Illinois und Florida.

Der Fonds hatte eine *Long-Duration*-Position gegenüber dem Referenzwert. Das durchschnittliche *Kreditrating* des Fonds war A+, etwas niedriger als das gewichtete durchschnittliche *Kreditrating* des Referenzwerts (AA-). Der Anlageverwalter erwartet, dass Wiedereröffnungen der Wirtschaft und *Fiskalpolitik* den *Fundamentaldaten* auf dem Kommunalanleihemarkt Unterstützung bringen werden. Zudem wird die Performance von Kommunalanleihen auch weiterhin durch einen soliden technischen Hintergrund unterstützt, insbesondere durch ein steuerbares Angebot und positive Zuflüsse von Investmentfonds. Allerdings haben der weitere Fortschritt der Impfungen, zusätzliche *fiskalische Anreize* und ein Wirtschaftswachstum oberhalb der Konsenserwartungen sowie die *Inflationsdaten* alle das Potenzial, Zinsen und *Volatilität* weiter nach oben zu treiben als es derzeit erwartet wird.

Insight North America LLC\*  
Januar 2022

### RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Der Fonds wurde am 27. März 2021 aufgelegt.

Am 26. März 2021 wurde der Insight Sustainable Euro Corporate Bond Fund mit dem Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund verschmolzen. Die Performancedaten für Zeiträume vor diesem Datum betreffen den Insight Sustainable Euro Corporate Bond, Anteilsklasse EUR A (Acc).

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine *Rendite* von -1,03 %, verglichen mit einer *Rendite* von -0,97 % für den Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporates TR Index und -0,82 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond EUR Corporates. Alle Angaben in Euro.

Der Fonds erzielte eine negative *Rendite* und blieb hinter seinem Referenzwert und dem Sektordurchschnitt zurück. Die Auswahl der *Wertpapiere* war im Berichtszeitraum in einer Reihe von Sektoren einheitlich stark. Die *Kreditstrategie* des Fonds schmälerte jedoch die Performance. Das allgemeine Engagement in *Unternehmensanleihen* trug in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums positiv zur Performance bei, was der *Übergewichtung* des Fonds in *Kreditrisiken* bei sich verengenden *Spreads* zu verdanken war. In der zweiten Jahreshälfte wirkte sich diese Positionierung negativ aus, weil sich die *Spreads* erweiterten. Innerhalb der Sektorallokation lieferten Automobile, Immobilien und *forderungsbesicherte Wertpapiere* positive Beiträge, während Energie und die Absicherung über den iTraxx Main die Performance schmälerten.

## REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

### RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND Forts.

Die Position des Fonds im BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund trug ebenfalls positiv zur Performance bei. Die *Durations-* und *Renditekurvenstrategien* trugen insgesamt leicht positiv zur Performance bei.

Der Anlageverwalter nahm im Berichtszeitraum an Neuemissionen in unterschiedlichen Sektoren teil. Hierzu zählten *grüne Anleihen* von verschiedenen Unternehmen wie CaixaBank, Intesa Sanpaolo, Bank of Ireland, UniCredit, Sabadell und Kutxabank im Bankensektor sowie *Nachhaltigkeitsanleihen* von FedEx und *soziale Anleihen* von SBB.

Ende Dezember 2021 waren 24,6% des Fonds in *Impact Bonds* investiert (gegenüber einem Anteil von 19,2% im Referenzwert). Allgemein beträgt der gewichtete Durchschnitts-Score für *Umwelt, Soziales und Corporate Governance (ESG)* 2,2 gegenüber einem Score von 2,4 im Referenzwert. (Je niedriger der Score, desto besser die ESG-Performance. Diese Scores werden von der Prime ESG-Rating-Methode von Insight abgeleitet.) Außerdem beträgt die CO<sub>2</sub>-Intensität des Fonds 51 % des Scores des Vergleichsindex (die CO<sub>2</sub>-Intensität misst, wie viel Kohlendioxid Emittenten im Verhältnis zum Umsatz erzeugen).

Die *Inflation* in den USA bleibt erhöht, maßgeblich dafür sind Lieferkettenprobleme. Nach Einschätzung des Anlageverwalters wird die US-Notenbank früher Zinserhöhungen einleiten als bisher erwartet und das *Zurückfahren* ihres Anleihekaufprogramms bald abschließen, da ein *geldpolitischer* Straffungszyklus eingeleitet wird.

In der *Eurozone* ist neben den Auswirkungen von Covid-19 auf die globale Nachfrage die *Inflation* nach wie vor ein zentrales Risiko aufgrund der Exportabhängigkeit der *Eurozone*. Angesichts eines schwachen mittelfristigen *Inflationsausblicks* geht der Anlageverwalter davon aus, dass die *Geldpolitik* locker bleiben wird. Allerdings erscheint das *Inflationsrisiko* hoch.

Insight Investment Management (Global) Limited  
Januar 2022

Alle Daten von Lipper, Stand: 31. Dezember 2021. Gesamtrendite, ohne Ausgabeaufschlag jedoch einschließlich Jahresgebühren bei Wiederanlage der Erträge, vor Steuern. Der Ausgabeaufschlag kann sich erheblich auf die Wertentwicklung Ihrer Anlage auswirken. Zahlen zur Wertentwicklung unter Berücksichtigung des Ausgabeaufschlags sind auf Anfrage erhältlich. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für die Wertentwicklung in der Zukunft. Die bisherige Wertentwicklung ist in der Währung der Anteilsklasse angegeben.

^ Eine Erläuterung zu den kursiv gedruckten Begriffen ist im Glossar auf den Seiten 46 bis 49 zu finden.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.



# GLOSSAR FINANZBEGRIFFE (UNGEPRÜFT)

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
<b>Alternative Anlage</b>	Eine alternative Anlage ist ein finanzieller Vermögenswert, der nicht unter eine der konventionellen Anlagekategorien fällt. Konventionelle Kategorien umfassen Aktien, Anleihen und Barmittel. Alternative Anlagen umfassen Private Equity oder Risikokapital, Hedgefonds, verwaltete Fonds, Kunst und Antiquitäten, Rohstoffe und Derivatkontrakte. Immobilien werden ebenfalls häufig als eine alternative Anlage klassifiziert.	<b>Korrelation(en)/ korreliert</b>	Die Korrelation ist ein Maß für den Grad, in dem zwei Variablen sich in Bezug zueinander bewegen.
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (Asset-Backed Securities, ABS)</b>	Pools von Krediten, die verpackt und als Wertpapiere verkauft werden – ein Prozess, der als „Verbriefung“ bekannt ist. Typischerweise handelt es sich bei den zugrunde liegenden Vermögenswerten um Hypotheken oder Kreditkartenforderungen.	<b>Kupon(s)</b>	Die Zinsen, die der Emittent auf eine Anleihe über die Laufzeit des Wertpapiers zahlt.
<b>Grundstoffe</b>	Der Sektor mit Unternehmen, die sich mit der Entdeckung, Entwicklung und Verarbeitung von Rohmaterialien befassen. Der Sektor umfasst den Abbau und die Raffination von Metallen sowie von chemischen und forstwirtschaftlichen Erzeugnissen.	<b>Anleihen</b>	In diesem Kontext steht der Begriff für Unternehmensanleihen, also Schuldtitel, die von Unternehmen ausgegeben werden.
<b>Basispunkte (Bp.)</b>	Basispunkt (Bp.) bezieht sich auf eine gemeinsame Messeinheit für Zinssätze und sonstige finanziellen Prozentsätze. Ein Basispunkt (Bp.) entspricht 1/100 von 1 % oder 0,01 % oder 0,0001.	<b>Kreditrating(s)</b>	Eine Bewertung der Bonität eines Kreditnehmers, z. B. eines bestimmten Unternehmens oder einer Regierung. Ein Unternehmen, dessen Schulden ein AAA-Rating haben, gilt als kreditwürdiger als ein Unternehmen mit Schulden, die mit BBB bewertet werden.
<b>Referenzwert</b>	Eine Vergleichsgrundlage, an der die Wertentwicklung, die Positionen oder die Duration eines Fonds gemessen werden kann. In der Regel ist dies ein Index.	<b>Kreditspreads</b>	Der Renditeunterschied zwischen zwei Anleihen mit ähnlicher Laufzeit, aber unterschiedlicher Kreditqualität. Wenn beispielsweise die 10-jährige US-Staatsanleihe mit einer Rendite von 6 % und eine 10-jährige Unternehmensanleihe mit einer Rendite von 8 % gehandelt werden, hat die Unternehmensanleihe einen Spread von 200 Basispunkten gegenüber der Staatsanleihe. Eine Ausweitung der Kreditspreads deutet auf eine wachsende Besorgnis über die Fähigkeit der Kreditnehmer hin, ihre Schulden zu bedienen. Sich verengende Kreditspreads deuten auf eine Verbesserung der privaten Kreditwürdigkeit hin. Siehe hierzu auch die Definitionen von Rendite und Basispunkten.
<b>Anleihe(n)</b>	Ein Darlehen seitens eines Anlegers an ein Unternehmen oder eine Regierung für einen festgelegten Zeitraum gegen Zahlung eines festen Zinssatzes und Rückzahlung des ursprünglichen Betrags bei dessen Beendigung.	<b>Zyklischer/Zyklizität</b>	Eine zyklische Aktie oder eine zyklische Branche ist eine Aktie oder ein Wirtschaftszweig, der als konjunkturabhängig gilt. Dementsprechend sind ihre Erträge in Zeiten des wirtschaftlichen Wohlstands und der Expansion normalerweise höher und in Zeiten des wirtschaftlichen Abschwungs und der Schrumpfung niedriger.
<b>Call-Option(en)</b>	Ein Optionskontrakt, der dem Inhaber das Recht gibt, eine bestimmte Menge eines zugrunde liegenden Wertpapiers zu einem bestimmten Preis innerhalb einer bestimmten Zeit zu kaufen, ohne dass dieser dazu verpflichtet ist.	<b>Ausfall/Ausfälle</b>	Wenn ein Schuldner Zinsen oder Kapital bei einem Darlehen oder Wertpapier bei Fälligkeit nicht zurückzahlen kann.
<b>Rohstoff/Rohstoffe</b>	Ein Vermögenswert in Form eines Rohstoffs, der ge- und verkauft werden kann, z. B. Gold, Öl, Kaffee, Weizen.	<b>Defensiv</b>	Eine defensive Aktie oder Branche ist weniger anfällig gegenüber der Wirtschaftslage, so dass die Erträge und Dividenden im Allgemeinen stabil sind.
<b>Zyklische Konsumgüter</b>	Waren und Dienstleistungen, die von den Verbrauchern als nicht lebensnotwendig angesehen werden, aber bei ausreichendem Einkommen als wünschenswert gelten.	<b>Derivat(e)</b>	Ein Wertpapier, dessen Wert von einem Basiswert oder einer Gruppe von Basiswerten abhängt oder davon abgeleitet wird. Das Derivat selbst ist ein Vertrag zwischen zwei oder mehreren Parteien auf der Grundlage des Vermögenswerts oder der Vermögenswerte. Sein Preis bestimmt sich durch Schwankungen des Basiswerts. Die häufigsten zugrunde liegenden Vermögenswerte sind Aktien, Anleihen, Rohstoffe, Währungen, Zinsen und Marktindizes.
<b>Verbraucherpreisindex (VPI)</b>	Ein Index zur Messung der Inflation, der auf den Preisen eines Korbs von Waren und Dienstleistungen basiert, die dafür repräsentativ sind, wofür wir normalerweise unser Geld ausgeben.	<b>Diversifiziert/ Diversifizierung</b>	Anlage in eine Vielzahl von Unternehmen oder Finanzinstrumenten, die sich in der Regel unterschiedlich entwickeln. Zum Beispiel eine Anlage in verschiedenen Regionen oder Sektoren mit dem Ziel, eine schlechte Performance in einer Region durch eine positive Wertentwicklung in einer anderen auszugleichen.
<b>Basiskonsumgüter</b>	Waren und Dienstleistungen, die Menschen unabhängig von ihrer finanziellen Situation nicht aus ihrem Budget streichen können oder wollen.	<b>Dividende(n)</b>	Betrag, den ein Unternehmen regelmäßig als Vergütung für das Halten von Aktien an seine Anleger bezahlt.
<b>Wandelanleihe(n)</b>	Eine Wandelanleihe ist ein festverzinslicher Schuldtitel, der in eine vorher festgelegte Anzahl von Aktien umgewandelt werden kann. Die Umwandlung der Anleihe in Aktien kann zu bestimmten Zeitpunkten während der Laufzeit der Anleihe erfolgen und erfolgt normalerweise nach Wahl des Anleiheinhabers.		

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
<b>Duration(en)</b>	Die Duration misst die Sensitivität eines festverzinslichen Wertpapiers oder Anleihefonds gegenüber Zinsänderungen. Je größer die Duration einer Anleihe ist, desto höher ist ihre Sensitivität gegenüber Zinsänderungen.	<b>Fundamentaldaten (Unternehmen)</b>	Ein Grundprinzip, eine Regel, ein Gesetz oder Ähnliches, das als Grundlage für ein System dient. Fundamentaldaten von Unternehmen sind Faktoren wie sein Geschäftsmodell, seine Erträge, Bilanz und Schulden.
<b>Einkünfte</b>	Für Arbeit oder Dienstleistungen erhaltenes Geld.	<b>Fundamentaldaten (Wirtschaft)</b>	Ein Grundprinzip, eine Regel, ein Gesetz oder Ähnliches, das als Grundlage für ein System dient. Wirtschaftliche Fundamentaldaten sind Faktoren wie Inflation, Beschäftigung und Wirtschaftswachstum.
<b>Schwellenland/ Schwellenländer</b>	Im Wandel zu industrialisierten Volkswirtschaften befindliche Länder; die Volkswirtschaft einer sich entwickelnden Nation oder eines Schwellenlandes engagiert sich bei ihrem Wachstum stärker auf globalen Märkten. Länder wie Indien und Brasilien gelten als „aufstrebend“.	<b>Terminkontrakte (Futures)</b>	Futures sind Terminkontrakte, bei denen der Käufer bzw. der Verkäufer verpflichtet ist, einen Vermögenswert, wie einen physischen Rohstoff oder ein Finanzinstrument, an einem bestimmten Termin und zu einem bestimmten Preis in der Zukunft zu kaufen bzw. zu verkaufen. In den Terminkontrakten sind die Qualität und die Menge des zugrunde liegenden Vermögenswerts aufgeführt; die Kontrakte sind standardisiert, um den Handel an Terminbörsen zu erleichtern.
<b>Umwelt, Soziales und Corporate Governance (ESG)</b>	Eine Art des verantwortungsbewussten Investierens, die aus einer Reihe von Standards besteht, anhand derer die Geschäftstätigkeit eines Unternehmens vor einer Anlage geprüft wird.	<b>Allgemeine Kommunalanleihen/ Instrumente/ Wertpapiere</b>	Kommunalanleihen werden durch die Steuereinnahmen der emittierenden Körperschaft besichert. Bei einem Zahlungsausfall haben allgemeine Kommunalanleihen oft höherrangige Ansprüche auf das Vermögen einer Kommune bzw. deren Steuereinnahmen als andere Schuldtitel.
<b>Aktie/Aktien</b>	Von einem Unternehmen ausgegebene Anteile, die einen Eigentumsanteil darstellen.	<b>Geopolitik/ Geopolitisch</b>	Geografische Einflüsse auf die Machtverhältnisse in internationalen Beziehungen.
<b>Aktienrisikoprämie</b>	Bezieht sich auf die zu erwartende Differenz zwischen der Anlage in einer Position oder einem Aktienmarkt und einem „risikofreien“ Nominalzinssatz (häufig von längerfristigeren Staatsanleihen, unter Annahme eines Ausfallrisikos von null seitens der Regierung). Diese Rendite stellt für Anleger eine Kompensation für das im Verhältnis höhere Risiko einer Aktienanlage dar. Die Höhe der Prämie variiert und ist abhängig vom Risiko einer bestimmten Position, eines Index oder eines Portfolios. Sie verändert sich auch mit der Zeit aufgrund von Schwankungen der Marktrisiken.	<b>Gilt(s)</b>	Festverzinsliches Wertpapier, das von der Regierung des Vereinigten Königreichs ausgegeben wird.
<b>Eurozone</b>	Die Wirtschaftsregion, die alle Mitglieder der Europäischen Union umfasst, die den Euro als Währung verwenden.	<b>Grüne Anleihen</b>	Festverzinsliche Finanzinstrumente, die einen positiven Klima- oder Umweltbeitrag leisten können.
<b>Börsengehandelter Fonds (Exchange-Traded Fund, ETF)</b>	Eine Art von Investmentfonds, der an einer Börse gehandelt wird und in der Regel einen Aktienindex, einen Rohstoff, Anleihen oder einen Korb von Vermögenswerten nachbildet.	<b>Bruttoinlandsprodukt (BIP)</b>	Das Bruttoinlandsprodukt ist ein monetäres Maß für den Marktwert aller in einem bestimmten Zeitraum produzierten Waren und Dienstleistungen.
<b>Fallen Angel(s) – gefallene Engel</b>	Eine Anleihe oder Anleihen, deren Kreditwürdigkeit von Investment Grade auf Hochzinsniveau herabgestuft wurde.	<b>Hartwährung</b>	Hartwährungen werden von Industrieländern mit starker Industriewirtschaft und einer stabilen Regierung ausgegeben. Im Allgemeinen werden damit das Pfund Sterling, der Euro und der US-Dollar bezeichnet.
<b>Fiskalpolitisch/ Fiskalpolitik/ Fiskalausgaben</b>	Ein wirtschaftspolitisches Instrument des Staats zur Beeinflussung von Steuern und Staatsausgaben.	<b>Falke(n)/zinsbullisch</b>	Ein Falke, auch Zinsfalke genannt, ist ein geldpolitischer Entscheidungsträger oder Berater, der sich vorrangig um Zinssätze im Zusammenhang mit der Fiskalpolitik sorgt. Ein Falke favorisiert im Allgemeinen relativ hohe Zinsen, um die Inflation unter Kontrolle zu halten. Anders ausgedrückt, Falken sind weniger um das Wirtschaftswachstum als um Reflationsdruck, der hohe Inflationsraten mit sich bringt, besorgt.
<b>Fiskalische Anreize</b>	Ein wirtschaftspolitisches Instrument des Staats zur Beeinflussung von Steuern und Staatsausgaben zur Ankurbelung der Wirtschaft.		
<b>Anleihen/ Festverzinsliche Wertpapiere</b>	Ein Darlehen seitens eines Anlegers an ein Unternehmen oder eine Regierung für einen festgelegten Zeitraum gegen Zahlung eines festen Zinssatzes und Rückzahlung des ursprünglichen Betrags bei dessen Beendigung. (Auch Anleihen genannt)		
<b>Grenzmarkt/ Grenzmärkte</b>	Grenzmärkte sind weniger entwickelte Volkswirtschaften in den Entwicklungsländern und weniger etabliert als Schwellenländer. Viele Grenzmärkte haben keine entwickelten Aktienmärkte, und obwohl sie kleiner, weniger zugänglich und riskanter sind als Schwellenländer, gelten sie als rentable Anlagen.		

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
<b>Absicherung(en)/ abgesichert/absichern</b>	Eine Methode, um ein unnötiges oder unbeabsichtigtes Risiko zu mindern.	<b>Makroökonomisch</b>	Bezieht sich auf das gesamtwirtschaftliche Verhalten. Dazu gehören auch verschiedene Faktoren, wie die Wirtschaftsleistung, die Beschäftigungslage, Inflation und Investitionen.
<b>Hochzinsanleihen</b>	Festverzinsliche Wertpapiere mit einem niedrigen Kreditrating, das mit einem höheren Ausfallrisiko verbunden ist als bei besser bewerteten Wertpapieren. Sie bieten jedoch potenziell höhere Renditen.	<b>Marge(n)</b>	Steht dafür, welcher Prozentsatz vom Umsatz eines Geschäfts oder Unternehmens Gewinne darstellt.
<b>Impact-Anleihen</b>	Eine Art von festverzinslichen Wertpapieren, bei denen die Erlöse ausschließlich für Projekte verwendet werden, die ökologischen oder sozialen Kriterien entsprechen und bestimmte Ergebnisse erzielen sollen.	<b>Laufzeit/Laufzeiten/ Fälligkeit</b>	Die Zeit, bis der ursprüngliche Anlagebetrag eines festverzinslichen Wertpapiers an den Wertpapierinhaber zurückgezahlt werden muss.
<b>Index/Indizes</b>	Ein Portfolio von Anlagen, die einen bestimmten Markt oder einen Teil davon repräsentieren. Zum Beispiel ist der FTSE 100 ein Index der Aktien der 100 größten Unternehmen an der Londoner Börse.	<b>Fusionen und Übernahmen (M&amp;A)</b>	Der Kauf, der Verkauf, die Aufteilung und die Zusammenlegung von verschiedenen Unternehmen.
<b>Indexgebundene Gilts</b>	Festverzinsliche Wertpapiere, die von der britischen Regierung ausgegeben werden, bei denen sowohl der Wert des Darlehens als auch die Zinszahlungen während der Laufzeit des Wertpapiers entsprechend der Inflation angepasst werden. Sie werden auch als inflationsindexierte Anleihen bezeichnet.	<b>Mid-Cap</b>	Dies bezieht sich auf ein Unternehmen mit einem mittleren Marktkapitalisierungswert. Er basiert auf dem Marktwert der ausstehenden Aktien eines börsennotierten Unternehmens.
<b>Inflation/Inflationär</b>	Der prozentuale Anstieg der Lebenshaltungskosten. Die Inflation wird normalerweise als jährlicher prozentualer Anstieg in einem Monat gegenüber dem Durchschnittspreis im Vorjahresmonat angegeben.	<b>Geldpolitik</b>	Die Regulierung des Geldumschs und der Zinssätze durch eine Zentralbank.
<b>Inflationsindexierte Anleihen/Wertpapiere</b>	Festverzinsliche Wertpapiere, bei denen sowohl der Wert der Anleihe als auch die Zinszahlungen während der Laufzeit des Wertpapiers an die Inflation angepasst werden. Sie werden auch als indexgebundene Anleihen bezeichnet.	<b>Monetäre Impulse</b>	Ein Versuch einer Regierung, das Wirtschaftswachstum zu beschleunigen, indem sie die Geldmenge in der Wirtschaft erhöht oder die Zinssätze senkt.
<b>Investment Grade</b>	Festverzinsliche Wertpapiere mit mittlerem oder hohem Kreditrating, die als weniger ausfallgefährdet gelten als solche mit einem niedrigeren Kreditrating.	<b>Option(en)</b>	Finanzkontrakte, die das Recht, aber nicht die Pflicht beinhalten, einen Vermögenswert an oder vor einem späteren Zeitpunkt zu einem vereinbarten Preis zu kaufen oder zu verkaufen.
<b>Leverage/ fremdfinanziert</b>	In Bezug auf ein Unternehmen bezeichnet Leverage die Höhe der Verschuldung des Unternehmens in Bezug auf sein vorhandenes Vermögen. Ein Unternehmen, das wesentlich höhere Schulden als Kapital hat, gilt als fremdfinanziert. Der Begriff kann auch auf einen Fonds angewandt werden, der Geld ausleiht oder Derivate einsetzt, um eine Anlageposition zu vergrößern.	<b>Übergewichtung(en)</b>	Mehr in ein Unternehmen, eine Region oder einen Sektor investiert zu sein als der Referenzwert oder ein Vergleichsprodukt.
<b>Liquidität</b>	Liquidität beschreibt das Ausmaß, in dem eine Anlage oder ein Wertpapier schnell am Markt gekauft oder verkauft werden kann, ohne dass sich das auf ihren bzw. seinen Preis auswirkt. Die Marktliquidität bezieht sich darauf, in welchem Maß Vermögenswerte in einem Markt, zum Beispiel dem Aktienmarkt eines Landes, zu stabilen Preisen gekauft und verkauft werden können.	<b>Ewige Anleihen</b>	Ewige Anleihen sind Anleihen ohne Fälligkeitsdatum. Obwohl ewige Anleihen rückzahlbar sind, zahlen sie ohne Fälligkeitsdatum einen kontinuierlichen Zins.
<b>Long(s)</b>	Bezieht sich auf ein Wertpapier, das in der Erwartung gehalten wird, dass es im Wert steigt.	<b>Portfolio</b>	Eine Sammlung von Anlagen.
<b>Lang-/längerfristig</b>	Eine bestimmten ertragsgenerierenden Vermögenswerten hinzugefügte Beschreibung zur Hervorhebung, dass das Fälligkeitsdatum noch in weiter Ferne liegt.	<b>Put-Optionen</b>	Ein Optionskontrakt, der dem Inhaber das Recht gibt, eine bestimmte Menge eines zugrunde liegenden Wertpapiers zu einem bestimmten Preis innerhalb eines bestimmten Zeitraums zu verkaufen, ohne dass dieser dazu verpflichtet ist.
		<b>Quantitative Straffung</b>	Wenn Zentralbanken die Zinsen erhöhen oder Wertpapiere auf dem offenen Markt verkaufen, um die umlaufende Geldmenge zu reduzieren.
		<b>Quasi-staatlich/ halbstaatlich</b>	Eine Art von privatwirtschaftlichem Unternehmen, das von einem staatlichen Zweig/von staatlicher Seite unterstützt wird. Die meisten quasi-staatlichen Unternehmen beginnen als Regierungsbehörden und werden dann zu eigenständigen Unternehmen.
		<b>Reale Vermögenswerte</b>	Reale Vermögenswerte sind greifbare physische Vermögenswerte (z. B. eine Immobilie oder ein Grundstück). Zu den realen Vermögenswerten gehören Edelmetalle, Rohstoffe, Infrastruktur, Immobilien, landwirtschaftliche Flächen, Maschinen und Öl.
		<b>Relativer Wert</b>	Die Attraktivität eines Finanzinstruments im Vergleich zu einem anderen, gemessen an Risiko, Liquidität und Rendite.

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
Rendite(n)/rentiert	Der Gewinn oder Verlust aus einer Anlage über einen festgelegten Zeitraum – ausgedrückt entweder in Prozent oder in Beträgen.	Spread(s)	Die Differenz zwischen der Rendite einer Unternehmensanleihe und einer Staatsanleihe mit derselben Laufzeit. Rendite bezieht sich auf den Ertrag aus der Anlage und wird in Prozent des aktuellen Marktwerts der Anlage ausgedrückt.
Umsatzerlöse	Oftmals als Umsätze bezeichnet handelt es sich um die aus der normalen Geschäftstätigkeit und anderen geschäftlichen Aktivitäten eines Unternehmens erzielten Einnahmen.	Standardabweichung	Ein statistisches Maß, um die Abweichung eines Datensatzes von seinem Mittelwert zu messen.
Revenue Bonds	Diese Kommunalanleihen sind zweckgebunden und werden mit den Erträgen eines bestimmten Projekts besichert. Normalerweise können Revenue Bonds von allen staatlichen Behörden oder Fonds ausgegeben werden, die wie ein Unternehmen betrieben werden, d. h. operative Einnahmen und Ausgaben haben.	Aktie(n)	Hierbei handelt es sich um ein Wertpapier, welches das Eigentum an einem Bruchteil eines am Aktienmarkt notierten Unternehmens darstellt.
Rising Star(s)	Eine Anleihe oder Anleihen, die das Potenzial haben, dass in Kürze das Kreditrating auf Investment Grade hochgestuft wird.	Sub-Investment-Grade	Festverzinsliche Wertpapiere, die mit einem niedrigen Rating emittiert werden. Ihr Ausfallrisiko gilt als höher.
Risikoanlage(n)	Eine Risikoanlage ist ein mit einem gewissen Risiko behafteter Vermögenswert. Zu den Risikoanlagen zählen im Allgemeinen Vermögenswerte mit einer hohen Preisvolatilität, wie Aktien, Rohstoffe, Hochzinsanleihen und Währungen.	Nachrangige Anleihen	Ein Kredit oder ein Wertpapier, das im Hinblick auf die Ansprüche auf Vermögenswerte oder Erträge hinter anderen Krediten oder Wertpapieren rangiert.
Risikoprämienstrategien	Zielen darauf ab, mit der Preisbildung am Markt verbundene Risikoprämien zu erzielen, wobei sich der Begriff „Risikoprämie“ auf die Überrendite bezieht, die aus einer Anlage gegenüber der Rendite aus einem „risikofreien“ Vermögenswert erzielt werden kann.	Nachhaltigkeitsanleihen	Festverzinsliche Finanzinstrumente, deren Erlöse für die Finanzierung oder Refinanzierung einer Kombination aus ökologischen (grünen) und sozialen Projekten verwendet werden.
„Sicherer Hafen“, Zuflucht	Bezieht sich auf Vermögenswerte, die Anleger für relativ sicher halten und die in unruhigen Marktzeiten keinen Verlust erleiden.	Reduzierung von Anleihekäufen	Die Reduzierung der quantitativen Lockerung bzw. der Anleihekaufprogramme.
Wertpapier/ Wertpapiere	Ein handelbarer finanzieller Vermögenswert, zum Beispiel ein Anteil an einem Unternehmen oder ein festverzinsliches Wertpapier, das auch als Anleihe bezeichnet wird.	Gesamtrendite(n)	Der Begriff für den Gewinn oder Verlust aus einer Anlage über einen bestimmten Zeitraum. Die Gesamtrendite enthält den Ertrag (in Form von Zins- oder Dividendenzahlungen) und Kapitalerträge.
Anteil(e)	Auch Aktie genannt, wobei es sich um ein Wertpapier handelt, welches das Eigentum an einem Bruchteil eines am Aktienmarkt notierten Unternehmens darstellt.	Treasury/Treasuries	US-Staatsanleihen mit einer Laufzeit von über 10 Jahren. Zinszahlungen auf Treasury-Anleihen erfolgen halbjährlich.
Short	Beschreibt die Ansicht eines Fondsmanagers, dass der Markt oder ein Wertpapier an Wert verlieren könnte.	Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS)	Staatliche US-Schuldtitel, bei denen sowohl der Wert des Kredits als auch die Zinszahlungen während der Laufzeit des Wertpapiers an die Inflation, wie im Verbraucherpreisindex angegeben, angepasst werden.
Kurzfristig	Eine bestimmten ertragsgenerierenden Vermögenswerten hinzugefügte Beschreibung zur Hervorhebung der Tatsache, dass das Fälligkeitsdatum sehr kurz oder bald bevorsteht.	Untergewichtung(en)	Weniger in ein Unternehmen, eine Region oder einen Sektor investiert zu sein als der Referenzwert oder ein Vergleichsprodukt.
Small-Cap	Der Begriff bezeichnet Unternehmen mit einem geringen Marktkapitalisierungswert. Er basiert auf dem Marktwert der ausstehenden Aktien eines börsennotierten Unternehmens.	Volatil/Volatilität	Große und/oder häufige Auf- und Abwärtsbewegungen im Preis oder Wert einer Anlage oder des Marktes.
Soziale Anleihen	Soziale Anleihen sind festverzinsliche Instrumente, deren Erlöse oft vollständig in Projekte oder Aktivitäten fließen, die eine Verbesserung der sozialen Wohlfahrt und eine direkte positive Wirkung für gefährdete, unterversorgte oder anderweitig ausgeschlossene oder benachteiligte Bevölkerungsteile fördern.	Gewicht/ Gewichtung(en)	Das Engagement in einem Unternehmen, Sektor oder Markt in einem Fonds, üblicherweise in Prozent ausgedrückt – d. h. der Fonds hat eine Gewichtung von 20 % in US-Unternehmen.
		Rendite(n)	Einkünfte aus Anlagen, entweder ausgedrückt als Prozentsatz des aktuellen Marktwerts der Anlage oder als vom Inhaber erhaltene Dividenden.
		Renditekurve(n)	Die Renditekurve ist eine Linie, die die Zinsen von Anleihen derselben Bonität, aber verschiedener Laufzeit, zu verschiedenen Zeitpunkten darstellt.

# BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Irland - 38.545.235</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
34.086.600	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund ^	38.545.235	9,16
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>38.545.235</b>	<b>9,16</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 15.540.661</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 22.129.960)</b>			
500.000	AFG 2021-2 Trust '2021-2 B' FRN 1.315% 10-Mar-2053	319.515	0,08
3.700.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 0.650% 21-Nov-2022	3.281.471	0,78
2.320.000	Bluestone Sapphire XXV 2021-1 '2021-1 A1L' FRN 1.083% 21-Sep-2053	1.489.943	0,35
530.000	Flexi ABS Trust 2021-2 '2021-2 C' FRN 1.515% 12-Aug-2027	338.661	0,08
197.462	Interstar Millennium Series 2006-1 Trust '2006-1 A' FRN 0.430% 27-Mar-2038	116.553	0,03
175.258	Interstar Millennium Series 2006-4H Trust '2006-4H A2' FRN 0.509% 07-Nov-2039	106.343	0,02
500.000	Latitude Australia Personal Loans Series 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 1.473% 17-Apr-2030	320.200	0,08
1.314.254	Liberty Series 2018-3 '2018-3 A2' FRN 1.910% 25-Oct-2050	846.618	0,20
944.000	Liberty Series 2020-3 '2020-3 B' FRN 2.110% 25-Dec-2051	612.030	0,14
582.000	Liberty Series 2021-1 0.000% 10-Nov-2053	372.797	0,09
700.000	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 2.062% 22-Jan-2053	457.224	0,11
2.670.000	Pepper I-Prime 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 1.415% 15-Jul-2053	1.705.662	0,40
278.363	Pepper Residential Securities Trust No 18 FRN 2.115% 12-Aug-2058	178.941	0,04
352.007	Pepper Residential Securities Trust No 18 FRN 2.765% 12-Aug-2058	226.647	0,05
1.000.000	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 1.815% 15-Jan-2063	640.095	0,15
1.030.000	Pepper Residential Securities Trust No. 31 1.020% 23-Apr-2063	658.499	0,16
500.000	Pepper Residential Securities Trust No. 31 FRN 1.220% 23-Apr-2063	319.662	0,08
700.000	Pepper SPARKZ Trust No.3 'SPK-3 C' FRN 1.915% 17-Aug-2028	451.396	0,11
410.000	Perenti Finance Pty Ltd 'REGS' 6.500% 07-Oct-2025	375.551	0,09
1.130.000	Resimac Bastille Trust Series 2021-2NC '2021-2NCX C' FRN 1.763% 03-Feb-2053	723.303	0,17
708.000	Ruby Bond Trust '2021-1 B' FRN 1.515% 12-Mar-2053	453.930	0,11
1.635.000	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 2.015% 15-Jun-2052	1.050.998	0,25
770.000	Think Tank Residential Series 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 1.767% 10-Mar-2054	494.622	0,12
<b>Österreich - 5.850.765</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.794.640)</b>			
800.000	Erste Group Bank AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.375% 15-Apr-2027	775.440	0,18
3.300.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 2.100% 20-Sep-2117	5.075.325	1,21
<b>Belgien - 694.143</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 586.500)</b>			
600.000	Ethias SA 5.000% 14-Jan-2026	694.143	0,17
<b>Bermudas - 141.692</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 115.334)</b>			
137.000	PartnerRe Ireland Finance DAC 1.250% 15-Sep-2026	141.692	0,03
<b>Brasilien - 4.483.106</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.277.496)</b>			
1.490.000	Arcos Dorados Holdings Inc 'REGS' 5.875% 04-Apr-2027	1.360.568	0,33

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Brasilien Forts.</b>			
20.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	3.122.538	0,74
<b>Kanada - 766.481</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 745.073)</b>			
584.862	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030	526.370	0,12
249.175	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust '144A' 5.250% 01-Apr-2029	240.111	0,06
<b>Chile - 1.582.969</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
550.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.300% 01-Oct-2028	469.572	0,11
1.100.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	1.113.397	0,27
<b>China - 15.989.082</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
6.500.000	China Government Bond 3.020% 27-May-2031	915.740	0,22
6.600.000	China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030	946.484	0,22
96.000.000	China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	14.126.858	3,36
<b>Kolumbien - 1.954.448</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.213.778)</b>			
750.000	Colombia Government International Bond 3.875% 25-Apr-2027	667.933	0,16
880.500.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	173.277	0,04
3.324.600.000	Colombian TES 7.250% 18-Oct-2034	666.672	0,16
2.100.000.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	446.566	0,10
<b>Zypern - 1.107.760</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.070.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	1.107.760	0,26
<b>Dominikanische Republik - 315.107</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
350.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	315.107	0,08
<b>Ägypten - 3.494.848</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.599.768)</b>			
400.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033	325.918	0,08
500.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 31-Jan-2027	461.003	0,11
15.500.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2022	868.125	0,20
22.000.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 01-Mar-2022	1.217.669	0,29
12.000.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 06-Sep-2022	622.133	0,15
<b>Frankreich - 16.636.121</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 19.981.703)</b>			
200.000	BPCE SA FRN 2.125% 13-Oct-2046	195.020	0,05
2.872.000	BPCE SA 'MTN' FRN 1.051% 31-May-2022	2.544.119	0,60
2.800.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022	2.800.812	0,66
2.800.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2022	2.801.540	0,66
2.810.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Mar-2022	2.813.470	0,67
900.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031	890.055	0,21
200.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN (Perpetual) 3.500% 21-Dec-2028	200.060	0,05
1.600.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	1.669.952	0,40
2.300.000	Orano SA 'EMTN' 3.375% 23-Apr-2026	2.469.476	0,59
250.000	Parts Europe SA 'REGS' FRN 4.000% 20-Jul-2027	251.617	0,06



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Spanien Forts.</b>				
1.100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	1.144.665	0,27	
1.100.000	Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029	1.095.622	0,26	
2.400.000	Liberbank SA FRN 6.875% 14-Mar-2027	2.435.208	0,58	
3.365.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	3.436.641	0,81	
6.400.000	Spain Letras del Tesoro (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2022	6.401.280	1,52	
6.400.000	Spain Letras del Tesoro (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2022	6.406.080	1,52	
413.131	TDA 18-Mixto FTA FRN 0.162% 22-Jun-2045	408.966	0,10	
200.000	Unicaja Banco SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Nov-2026	198.550	0,05	
<b>Schweden - 1.820.236</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.685.211)</b>		<b>1.820.236</b>	<b>0,43</b>	
2.050.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'REGS' FRN 0.846% 12-Dec-2022	1.820.236	0,43	
<b>Schweiz - 928.939</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.971.622)</b>		<b>928.939</b>	<b>0,22</b>	
400.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 6.375% 21-Aug-2026	381.782	0,09	
250.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023	239.107	0,06	
340.000	Credit Suisse Group AG FRN (Perpetual) 7.125% 29-Jul-2022	308.050	0,07	
<b>Ukraine - 854.601</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 263.663)</b>		<b>854.601</b>	<b>0,20</b>	
350.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2022	307.599	0,07	
650.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2027	547.002	0,13	
<b>Vereinigtes Königreich - 50.725.984</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 38.596.726)</b>		<b>50.725.984</b>	<b>12,05</b>	
627.704	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0.462% 17-Mar-2039	702.343	0,17	
424.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 1.550% 25-Jul-2058	506.912	0,12	
704.000	BAT Capital Corp 5.282% 02-Apr-2050	705.058	0,17	
2.390.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	2.849.332	0,68	
1.742.663	British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.250% 15-Nov-2032	1.636.154	0,39	
2.396.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	2.351.099	0,56	
948.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029	929.263	0,22	
1.287.635	Canada Square Funding 2019-1 Plc '2019-1 A' FRN 1.150% 17-Oct-2051	1.536.591	0,37	
640.000	CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027	765.984	0,18	
500.000	esure Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jul-2026	597.749	0,14	
902.771	Eurosail 2006-1 Plc '2006-1X B1A' FRN 0.000% 10-Jun-2044	874.403	0,21	
3.079.000	Greene King Finance Plc FRN 2.178% 15-Mar-2036	3.010.630	0,72	
2.850.000	Harbour Energy Plc 'REGS' 5.000% 15-Oct-2026	2.501.709	0,59	
2.072.000	Hastings Group Finance Plc 3.000% 24-May-2025	2.596.969	0,62	
1.715.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 04-Jul-2029	1.890.359	0,45	
1.715.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	1.729.106	0,41	
1.750.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026	1.586.402	0,38	
1.226.934	Landmark Mortgage Securities No 1 Plc FRN 0.000% 17-Jun-2038	1.152.596	0,27	
1	Ludgate Funding Plc '2006-1X BB' FRN 0.000% 01-Dec-2060	1	0,00	
1.073.089	Marston's Issuer Plc FRN 1.454% 15-Oct-2027	1.193.180	0,28	
523.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 1.696% 15-Jul-2029	622.304	0,15	
500.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-3 '2021-3X C' FRN 0.000% 15-Nov-2029	595.844	0,14	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>				
499.000	Newday Partnership Funding 2020-1 Plc '2020-1X B' FRN 2.300% 15-Nov-2028	597.048	0,14	
1.224.962	Oranje European Loan Conduit NO 32 DAC FRN 1.000% 22-Nov-2028	1.229.323	0,29	
500.000	Provident Financial Plc 'EMTN' FRN 8.875% 13-Jan-2032	635.462	0,15	
4.358.000	Prudential Plc 'EMTN' FRN 2.950% 03-Nov-2033	3.821.917	0,91	
152.000	Ripon Mortgages Plc FRN 1.614% 20-Aug-2056	181.172	0,04	
508.647	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS2X B1C' FRN 0.245% 12-Jun-2044	482.718	0,11	
535.636	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS3X M1C' FRN 0.000% 12-Jun-2044	510.441	0,12	
159.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 2.804% 23-Jan-2029	189.795	0,05	
462.000	Stanlington No 1 Plc '2017-1 D' FRN 2.945% 12-Jun-2046	553.164	0,13	
1.597.000	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc '2019-1 D' FRN 2.550% 25-May-2051	1.903.772	0,45	
386.000	Stratton Mortgage Funding 2021-3 Plc '2021-3 D' FRN 1.650% 12-Dec-2043	455.834	0,11	
1.492.396	Together Asset Backed Securitisation 2021-CRE1 Plc '2021-CRE1 A' FRN 1.446% 20-Jan-2055	1.783.917	0,42	
1.753.676	Towd Point Mortgage Funding 2019-Auburn 13 Plc '2019-A13X A1' FRN 0.950% 20-Jul-2045	2.091.626	0,50	
2.756.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	3.275.435	0,78	
830.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.125% 15-Aug-2030	977.747	0,23	
1.440.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	1.702.625	0,40	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 60.424.210</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 53.426.151)</b>		<b>60.424.210</b>	<b>14,36</b>	
695.000	Citigroup Capital XVIII FRN 1.137% 28-Jun-2067	747.652	0,18	
610.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	534.225	0,13	
2.245.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	2.079.845	0,49	
415.000	PartnerRe Finance B LLC FRN 4.500% 01-Oct-2050	386.230	0,09	
625.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	574.701	0,14	
21.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	18.553.689	4,41	
21.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	18.553.406	4,41	
21.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2022	18.994.462	4,51	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>317.678.716</b>	<b>75,49</b>	
<b>Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)</b>				
<b>Frankreich - 1.955.449</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 966.783)</b>		<b>1.955.449</b>	<b>0,46</b>	
1.000.000	Odyssee Investment BidCo Cirtet Europe Term Loan 0.000% 09-Jul-2028	1.001.460	0,24	
972.010	SFR Group S.A. EUR Term Loan B 3.000% 21-Jun-2025	953.989	0,22	
<b>Irland - 1.185.558</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>1.185.558</b>	<b>0,28</b>	
1.000.000	Platform Bidco Limited Valeo Foods Term Loan 0.000% 28-Jun-2028	1.185.558	0,28	
<b>Niederlande - 3.999.130</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>3.999.130</b>	<b>0,95</b>	
1.000.000	Corialis International NV Term Loan 3.500% 17-Jul-2028	997.500	0,24	
1.000.000	Kouti B.V. Titan Holdings Term Loan 3.750% 30-Jun-2028	1.002.815	0,24	
1.000.000	Kraton Polymers Holdings B.V. Term Loan 0.000% 18-Nov-2028	1.003.750	0,24	
1.000.000	UPC Broadband Holding B.V. Term Loan 3.000% 31-Jan-2029	995.065	0,23	
<b>Schweden - 1.000.875</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.005.235)</b>		<b>1.000.875</b>	<b>0,24</b>	
1.000.000	Verisure Holding AB Term Loan 3.250% 09-Jul-2026	1.000.875	0,24	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts.</b>				
<b>Vereinigtes Königreich - 8.117.495</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 7.122.782)</b>				
1.000.000	CD&R Firefly Bidco Limited Term Loan 4.906% 23-Jun-2025	1.185.569	0,28	
1.000.000	Constellation Automotive Group Limited Term Loan 4.800% 28-Jul-2028	1.191.546	0,29	
1.000.000	Eagle Bidco Limited Term Loan 0.000% 31-Jan-2029	1.186.802	0,28	
1.000.000	IVC Acquisition Ltd Term Loan 4.667% 13-Feb-2026	1.189.873	0,28	
416.839	Project Jura Credit Senior Term Loan 2.930% 25-Jan-2022	495.924	0,12	
395.614	Project Panther Term Loan 3.800% 29-Oct-2021	164.859	0,04	
1.292.008	TC Funding I Limited Term Loan 2.504% 26-Sep-2023	1.522.127	0,36	
1.000.000	Zephyr Bidco Limited Term Loan 4.813% 06-Jun-2025	1.180.795	0,28	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 3.379.326</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.025.293)</b>				
1.000.000	Solera Polaris Newco LLC Term Loan 5.298% 02-Jun-2028	1.191.362	0,28	
1.858.750	Virgin Media SFA Finance Ltd Term Loan 3.304% 10-Nov-2027	2.187.964	0,52	
<b>Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)</b>				
		<b>19.637.833</b>	<b>4,66</b>	
<b>Credit Default Swaps - 6.851.302</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 10.676.955)</b>				
(1.450.000)	CDS Altice France SA 5.000% 20-Dec-2026	95.338	0,02	
(5.800.000)	CDS Barclays Bank Plc 1.000% 20-Dec-2023	66.418	0,02	
3.200.000	CDS Barclays Bank Plc 1.000% 20-Dec-2028	54.703	0,01	
(9.000.000)	CDS BNP Paribas SA 1.000% 20-Jun-2022	34.391	0,01	
(1.200.000)	CDS Cellnex Telecom SA 5.000% 20-Dec-2026	213.908	0,05	
(4.400.000)	CDS Danske Bank A/S 1.000% 20-Dec-2023	73.094	0,02	
(1.800.000)	CDS Danske Bank A/S 1.000% 20-Dec-2023	17.936	0,00	
900.000	CDS Danske Bank A/S 1.000% 20-Dec-2028	28.241	0,01	
(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	15.662	0,00	
(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	1.740	0,00	
(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	15.662	0,00	
(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	1.740	0,00	
(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	1.740	0,00	
(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	15.662	0,00	
(1.000.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	17.402	0,00	
(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Jun-2024	1.740	0,00	
(85.990.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	2.227.152	0,53	
(153.700.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	3.430.391	0,82	
(6.200.000)	CDS Naturgy Energy Group, S.A. 1.000% 20-Mar-2022	10.837	0,00	
(800.000)	CDS OI European Group BV 5.000% 20-Dec-2026	79.693	0,02	
(3.700.000)	CDS Societe Generale 1.000% 20-Dec-2022	25.498	0,01	
1.800.000	CDS Societe Generale 1.000% 20-Dec-2027	23.715	0,01	
(1.650.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2026	190.662	0,05	
(1.650.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2026	207.977	0,05	
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>				
		<b>6.851.302</b>	<b>1,63</b>	
<b>Währungsoptionen - 115.538</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 149.741)</b>				
3.200.000	Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.380	78.334	0,02	
3.600.000	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.123	4.408	0,00	
3.600.000	US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.132	14.076	0,00	
3.600.000	US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.138	10.231	0,00	
3.600.000	US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190	12	0,00	
3.600.000	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650	166	0,00	
3.600.000	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800	8.311	0,00	
<b>Währungsoptionen insgesamt</b>				
		<b>115.538</b>	<b>0,02</b>	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Zinsswaps - 896.802</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
9.500.000	IRS Pay Fixed 0.5287% Receive 1 Year GBP SONIA OIS Compound 10-Dec-2051	896.802	0,21	
<b>Zinsswaps insgesamt</b>				
		<b>896.802</b>	<b>0,21</b>	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Swaptions - 143.013</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.456.782)</b>				
153.700.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Put 16-Mar-2022 1.100	4.523	0,00	
56.800.000	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.425	47.560	0,01	
56.800.000	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Call 16-Mar-2022 0.425	57.248	0,02	
56.800.000	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Call 19-Jan-2022 0.425	33.682	0,01	
<b>Swaptions insgesamt</b>				
		<b>143.013</b>	<b>0,04</b>	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe	
<b>Offene Terminkontrakte - 3.776.347</b>						
<b>(31. Dezember 2020: 157.757)</b>						
(21)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.798.040)	19.721	0,00		
(192)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(25.582.080)	143.413	0,03		
(245)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(36.017.450)	722.004	0,17		
(596)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(67.294.360)	340.661	0,08		
(1)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(171.370)	2.429	0,00		
(145)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(29.977.300)	1.293.487	0,31		
(75)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(87.255.344)	272.855	0,07		
466	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	41.540.571	22.417	0,01		
(416)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(47.929.480)	87.287	0,02		
(3)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(446.160)	1.747	0,00		
(382)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(56.811.051)	870.326	0,21		
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>					<b>3.776.347</b>	<b>0,90</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 6.248.056 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.499.543)					6.248.056	1,48
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>					<b>393.892.842</b>	<b>93,59</b>

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Credit Default Swaps - (9.301.741)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (14.557.919))</b>				
780.000	CDS Anglo American 5.000% 20-Dec-2026	(150.611)	(0,04)	
4.750.000	CDS BNP Paribas SA 1.000% 20-Jun-2027	(12.507)	(0,00)	
1.083.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(16.603)	(0,00)	
1.625.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(24.575)	(0,01)	
1.192.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(18.274)	(0,00)	
37.900.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 37 5.000% 20-Dec-2026	(3.072.063)	(0,73)	
97.900.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 36 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	(2.185.005)	(0,52)	
69.207.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	(1.481.008)	(0,35)	
2.200.000	CDS Danske Bank A/S 1.000% 20-Dec-2028	(81.475)	(0,02)	
200.000	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Dec-2022	(1.221)	(0,00)	
1.800.000	CDS Deutsche Bank AG 1.000% 20-Dec-2022	(10.988)	(0,00)	
780.000	CDS Glencore Finance Europe SA 5.000% 20-Dec-2026	(145.817)	(0,04)	



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Credit Default Swaps Forts.</b>			
780.000	CDS Heidelbergcement AG 5.000% 20-Dec-2026	(159.784)	(0,04)
780.000	CDS Holcim Ltd 1.000% 20-Dec-2026	(10.748)	(0,00)
3.350.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026	(397.626)	(0,10)
44.350.000	CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2024	(973.625)	(0,23)
22.150.000	CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2031	(283.016)	(0,07)
610.000	CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026	(35.758)	(0,01)
1.040.000	CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026	(60.964)	(0,02)
(1.650.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026	(53.606)	(0,01)
(1.450.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026	(47.109)	(0,01)
(341.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2026	(1.572)	(0,00)
100.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(1.174)	(0,00)
400.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(4.695)	(0,00)
800.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(9.390)	(0,00)
760.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(8.921)	(0,00)
800.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(9.390)	(0,00)
390.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(4.578)	(0,00)
(3.350.000)	CDS Unibail-Rodamco-Westfield 1.000% 20-Dec-2026	(39.638)	(0,01)
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>(9.301.741)</b>	<b>(2,21)</b>
<b>Währungsoptionen - (58.992)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (91.280))</b>			
(3.200.000)	Euro/Chinese yuan Call 11-Feb-2022 7.589	(634)	(0,00)
(3.200.000)	Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.280	(41.642)	(0,01)
(3.600.000)	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.105	(365)	(0,00)
(5.400.000)	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.108	(792)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Euro Call 21-Jan-2022 1.113	(2.140)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.150	(1.368)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.148	(3.562)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190	(12)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650	(166)	(0,00)
(3.600.000)	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800	(8.311)	(0,00)
<b>Währungsoptionen insgesamt</b>		<b>(58.992)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Swaptions - (4.605.316)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (524.840))</b>			
(155.500.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 36 Put 17-Mar-2022 3.000	(91)	(0,00)
(141.000.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 35 Put 17-Mar-2022 2.900	(8)	(0,00)
(83.300.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 36 Version 1 Put 22-Sep-2022 3.000	(11.497)	(0,00)
(123.700.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.525	(225.323)	(0,06)
(106.300.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 17-Feb-2022 0.525	(193.629)	(0,05)
(123.700.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.525	(128.210)	(0,03)
(106.300.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 17-Feb-2022 0.525	(110.176)	(0,03)
(251.200.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 20-Oct-2022 3.000	(79.027)	(0,02)
(153.700.000)	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Call 16-Mar-2022 1.100	(3.827.559)	(0,91)
(56.800.000)	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.825	(6.705)	(0,00)
(56.800.000)	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Put 16-Mar-2022 0.850	(12.714)	(0,00)
(56.800.000)	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Put 19-Jan-2022 0.725	(2.803)	(0,00)
(166.600.000)	iTraxx Europe Series 35 Version 1 Put 22-Sep-2022 3.000	(7.574)	(0,00)
<b>Swaptions insgesamt</b>		<b>(4.605.316)</b>	<b>(1,10)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (1.976.470)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (767.997))</b>				
346	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	59.294.020	(887.066)	(0,21)
1.032	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022	115.614.960	(139.351)	(0,04)
(6)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(691.290)	(5.435)	(0,00)
(282)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(36.418.655)	(552.285)	(0,13)
(1.509)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(161.194.036)	(389.317)	(0,09)
(7)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.209.469)	(3.016)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(1.976.470)</b>	<b>(0,47)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (5.644.555) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.543.654))			(5.644.555)	(1,34)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(21.587.074)</b>	<b>(5,13)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>48.527.461</b>	<b>11,54</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>420.833.229</b>	<b>100,00</b>

^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.  
 Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Bank of America Merrill Lynch, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.  
 Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, Morgan Stanley und UBS AG.  
 Die Kontrahenten für Swaptions sind BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited und Goldman Sachs.  
 Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	79,41
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	4,38
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,84
Derivative OTC-Finanzinstrumente	3,18
Sonstiges Umlaufvermögen	12,19
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>							
Euro	US-Dollar	859.888	970.000	7. Jan. 22	UBS AG	2.937	
Euro	US-Dollar	291.890	330.000	7. Jan. 22	UBS AG	350	
US-Dollar	Euro	497.000	428.125	7. Jan. 22	Barclays Bank PLC	10.952	
US-Dollar	Euro	1.570.000	1.368.022	7. Jan. 22	Morgan Stanley	19.002	
US-Dollar	Euro	196.000	168.630	7. Jan. 22	Morgan Stanley	4.527	
Euro	Japanischer Yen	97.306	12.500.000	12. Jan. 22	UBS AG	1.382	
Euro	Japanischer Yen	64.816	8.320.000	12. Jan. 22	UBS AG	969	
Euro	Japanischer Yen	7.644.885	981.589.000	12. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	112.257	
Euro	Japanischer Yen	174.293	22.300.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	3.165	
Euro	Japanischer Yen	125.177	16.000.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	2.394	
Euro	Japanischer Yen	4.232.246	542.280.000	12. Jan. 22	BNP Paribas	70.836	
Euro	Japanischer Yen	5.421.737	696.082.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	80.065	
Euro	Japanischer Yen	7.324.386	942.796.000	12. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	89.451	
Euro	Japanischer Yen	314.176	40.350.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	4.534	
US-Dollar	Chilenischer Peso	1.301.093	1.100.000.000	12. Jan. 22	BNP Paribas	10.130	
US-Dollar	Chilenischer Peso	534.087	425.000.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	31.645	
Australischer Dollar	Neuseeländischer Dollar	1.750.000	1.821.132	13. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	21.932	
Australischer Dollar	US-Dollar	2.620.903	1.900.000	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	187	
Australischer Dollar	US-Dollar	2.522.089	1.800.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	25.236	
Brasilianischer Real	US-Dollar	3.100.000	536.930	13. Jan. 22	BNP Paribas	16.230	
Kanadischer Dollar	Euro	2.233.050	1.600.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	18.013	
Euro	US-Dollar	3.189.374	3.600.000	13. Jan. 22	UBS AG	9.329	
Euro	US-Dollar	878.000	985.904	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	7.105	
Indische Rupie	US-Dollar	83.925.000	1.113.683	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	12.499	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	38.603.441	1.800.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	75.469	
Norwegische Krone	Euro	16.472.484	1.600.000	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	48.567	
Norwegische Krone	US-Dollar	13.228	1.488	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	9	
Norwegische Krone	US-Dollar	11.867.565	1.311.000	13. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	29.640	
Norwegische Krone	US-Dollar	20.713.205	2.289.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	50.999	
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.635.648	648.000	13. Jan. 22	UBS AG	845	
Russischer Rubel	US-Dollar	8.032.000	106.103	13. Jan. 22	Morgan Stanley	702	
Pfund Sterling	Euro	649.690	763.000	13. Jan. 22	Morgan Stanley	10.373	
Taiwan-Dollar	US-Dollar	34.842.000	1.258.670	13. Jan. 22	BNP Paribas	919	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	202.183	255.464	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	1.428	
US-Dollar	Chilenischer Peso	37.598	32.024.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	52	
US-Dollar	Euro	1.787.115	1.570.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	8.641	
US-Dollar	Ungarischer Forint	782.041	254.861.622	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	2.425	
US-Dollar	Ungarischer Forint	792.000	258.835.342	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	489	
US-Dollar	Koreanischer Won	664.242	782.103.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	5.619	
US-Dollar	Norwegische Krone	3.780.649	33.365.900	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	360	
US-Dollar	Russischer Rubel	472.499	34.968.000	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	6.280	
US-Dollar	Schwedische Krone	1.814.715	16.202.611	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	23.340	
US-Dollar	Taiwan-Dollar	1.260.077	34.842.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	324	
US-Dollar	Türkische Lira	279.901	3.166.299	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	39.797	
Australischer Dollar	Euro	650.000	409.218	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	7.028	
Australischer Dollar	Euro	750.000	474.609	19. Jan. 22	BNP Paribas	5.675	
Australischer Dollar	Euro	880.000	556.022	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	7.511	
Euro	Australischer Dollar	996.126	1.630.000	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	6.347	
Euro	Australischer Dollar	12.107.510	18.785.000	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	77.998	
Euro	Australischer Dollar	134.857	210.000	19. Jan. 22	Barclays Bank PLC	377	
Australischer Dollar	US-Dollar	494.202	354.000	20. Jan. 22	UBS AG	3.811	
Australischer Dollar	US-Dollar	63.146	45.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	692	
Australischer Dollar	US-Dollar	92.630	66.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	1.025	
Australischer Dollar	US-Dollar	71.995	52.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	176	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.</b>							
Australischer Dollar	US-Dollar	54.516	39.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	464	
Brasilianischer Real	US-Dollar	119.000	21.002	20. Jan. 22	BNP Paribas	245	
Brasilianischer Real	US-Dollar	13.000	2.318	20. Jan. 22	Morgan Stanley	6	
Brasilianischer Real	US-Dollar	266.000	46.293	20. Jan. 22	UBS AG	1.123	
Chilenischer Peso	US-Dollar	74.947.000	86.064	20. Jan. 22	UBS AG	1.504	
Euro	US-Dollar	94.375	106.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	753	
Euro	US-Dollar	41.591	47.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	80	
Euro	US-Dollar	128.513	145.180	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	287	
Indische Rupie	US-Dollar	5.876.000	78.483	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	370	
Indische Rupie	US-Dollar	382.000	5.102	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	25	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	161.608.000	11.233	20. Jan. 22	BNP Paribas	98	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	229.372.000	16.077	20. Jan. 22	Goldman Sachs	21	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	158.027.000	11.081	20. Jan. 22	UBS AG	10	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	81.325.000	5.649	20. Jan. 22	BNP Paribas	53	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	793.193	38.000	20. Jan. 22	UBS AG	612	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	84.204	57.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	452	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	47.510	32.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	397	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	4.413	3.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	13	
Norwegische Krone	US-Dollar	268.792	30.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	397	
Norwegische Krone	US-Dollar	163.940	18.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	505	
Norwegische Krone	US-Dollar	452.164	50.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	1.079	
Norwegische Krone	US-Dollar	1.042.566	116.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	1.858	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	228.295	14.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	248	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	658.880	41.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	190	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	464.490	29.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	49	
Pfund Sterling	US-Dollar	73.860	98.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	1.351	
Pfund Sterling	US-Dollar	61.583	82.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	871	
Pfund Sterling	US-Dollar	1.490	2.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	7	
Pfund Sterling	US-Dollar	45.652	61.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	458	
Pfund Sterling	US-Dollar	57.916	77.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	804	
Pfund Sterling	US-Dollar	34.836	46.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	833	
Schwedische Krone	US-Dollar	355.279	39.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	189	
Schwedische Krone	US-Dollar	544.279	60.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	67	
Schwedische Krone	US-Dollar	699.579	77.000	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	192	
Schwedische Krone	US-Dollar	326.760	36.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	59	
Schweizer Franken	US-Dollar	18.453	20.000	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	194	
US-Dollar	Australischer Dollar	743.298	1.023.936	20. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	799	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	68.000	86.346	20. Jan. 22	Morgan Stanley	186	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	36.000	45.474	20. Jan. 22	Morgan Stanley	264	
US-Dollar	Chilenischer Peso	273.968	229.174.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	4.937	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	13.654	54.532.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	250	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	20.985	84.457.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	244	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	10.361	41.599.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	142	
US-Dollar	Euro	15.000	13.223	20. Jan. 22	Morgan Stanley	25	
US-Dollar	Japanischer Yen	28.000	3.174.230	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	374	
US-Dollar	Japanischer Yen	71.000	8.050.272	20. Jan. 22	Morgan Stanley	938	
US-Dollar	Japanischer Yen	27.000	3.104.949	20. Jan. 22	UBS AG	22	
US-Dollar	Japanischer Yen	4.000	460.189	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	2	
US-Dollar	Japanischer Yen	81.000	9.214.498	20. Jan. 22	BNP Paribas	836	
US-Dollar	Japanischer Yen	22.000	2.513.295	20. Jan. 22	UBS AG	146	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	34.000	49.445	20. Jan. 22	BNP Paribas	202
US-Dollar	Russischer Rubel	53.332	3.968.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	491
US-Dollar	Russischer Rubel	21.889	1.636.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	114
US-Dollar	Russischer Rubel	127.826	9.493.000	20. Jan. 22	UBS AG	1.382
US-Dollar	Russischer Rubel	29.407	2.180.000	20. Jan. 22	UBS AG	364
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	695.680	11.055.397	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	3.648
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	6.000	95.907	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	1
US-Dollar	Türkische Lira	182.299	2.362.240	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	7.226
US-Dollar	Euro	1.040.000	918.357	21. Jan. 22	UBS AG	172
Pfund Sterling	Euro	1.000.000	1.177.074	25. Jan. 22	BNP Paribas	12.972
Pfund Sterling	Euro	408.000	477.471	25. Jan. 22	Morgan Stanley	8.067
Pfund Sterling	Euro	801.000	937.335	25. Jan. 22	RBC Capital Markets	15.891
Pfund Sterling	Euro	194.000	227.186	25. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	3.683
Pfund Sterling	Euro	398.000	464.744	25. Jan. 22	RBC Capital Markets	8.894
Pfund Sterling	Euro	730.000	854.308	25. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	14.425
Pfund Sterling	Euro	261.000	304.904	25. Jan. 22	UBS AG	5.698
Pfund Sterling	Euro	785.000	917.364	25. Jan. 22	Barclays Bank PLC	16.822
Pfund Sterling	Euro	510.000	605.435	25. Jan. 22	Morgan Stanley	1.489
Euro	US-Dollar	1.526.606	1.725.000	28. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	3.303
US-Dollar	Euro	4.000.000	3.529.441	28. Jan. 22	UBS AG	2.856
Brasilianischer Real	US-Dollar	4.200.000	735.844	2. Feb. 22	BNP Paribas	11.249
Euro	US-Dollar	1.237.310	1.400.000	4. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	1.182
US-Dollar	Euro	27.000	23.824	4. Feb. 22	UBS AG	16
Euro	US-Dollar	2.371.277	2.680.000	9. Feb. 22	Barclays Bank PLC	5.198
Indische Rupie	US-Dollar	49.500.000	659.235	9. Feb. 22	Morgan Stanley	3.492
Indische Rupie	US-Dollar	50.000.000	658.717	9. Feb. 22	BNP Paribas	9.863
Russischer Rubel	US-Dollar	50.000.000	662.227	9. Feb. 22	UBS AG	988
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.743.694	6.803.022.000	9. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	70.174
US-Dollar	Koreanischer Won	211.11	25.000.000	9. Feb. 22	Morgan Stanley	77
US-Dollar	Russischer Rubel	2.599.155	187.928.000	9. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	93.522
Euro	US-Dollar	459.105	520.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	59
US-Dollar	Rumänischer Leu	664.907	2.895.000	14. Feb. 22	Goldman Sachs	4.544
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	551.554	8.503.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	19.005
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	56.902	874.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	2.138
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.003.880	15.900.000	14. Feb. 22	UBS AG	11.273
<b>EUR</b>						<b>1.337.554</b>
Euro	US-Dollar	528.590	600.000	7. Jan. 22	BNP Paribas	(1.482)
Euro	US-Dollar	882.996	1.000.000	7. Jan. 22	BNP Paribas	(459)
Euro	US-Dollar	34.069.243	39.615.000	7. Jan. 22	Lloyds Bank plc	(928.813)
Euro	US-Dollar	719.359	837.000	7. Jan. 22	Goldman Sachs	(20.092)
Euro	US-Dollar	549.663	642.000	7. Jan. 22	Lloyds Bank plc	(175.15)
Euro	US-Dollar	519.270	605.000	7. Jan. 22	Lloyds Bank plc	(15.220)
US-Dollar	Euro	635.000	565.299	7. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(4.305)
US-Dollar	Euro	20.988.000	18.671.010	7. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(129.064)
Euro	Chinesischer Yuan	13.705.944	101.964.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	(466.810)
Japanischer Yen	Euro	25.000.000	194.918	12. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.070)
Australischer Dollar	US-Dollar	2.616.236	1.900.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	(2.803)
Chilenischer Peso	US-Dollar	60.896.000	72.078	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(614)
Euro	Australischer Dollar	870.000	1.376.781	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(11.753)
Euro	Norwegische Krone	1.600.000	16.402.165	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(41.529)
Euro	Pfund Sterling	1.212.000	1.025.464	13. Jan. 22	BNP Paribas	(8.684)
Euro	US-Dollar	1.680.660	1.911.281	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(7.662)
Euro	US-Dollar	606.000	686.090	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(55)
Ungarischer Forint	US-Dollar	506.936.834	1.584.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	(29.970)
Indonesische Rupiah	US-Dollar	12.241.000.000	863.314	13. Jan. 22	UBS AG	(3.735)
Japanischer Yen	US-Dollar	8.613.387	75.806	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(865)
Koreanischer Won	US-Dollar	782.103.000	659.113	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.088)
Neuseeländischer Dollar	Australischer Dollar	1.820.359	1.750.000	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(22.399)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.</b>						
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	47.899	33.564	13. Jan. 22	BNP Paribas	(747)
Russischer Rubel	US-Dollar	1.636.000	21.931	13. Jan. 22	BNP Paribas	(139)
Russischer Rubel	US-Dollar	24.948.000	337.700	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(5.005)
Schwedische Krone	Euro	16.189.633	1.600.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(21.585)
Türkische Lira	US-Dollar	3.166.299	245.356	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(8.282)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.835.848	2.532.229	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(64)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.800.000	2.525.561	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(27.460)
US-Dollar	Brasilianischer Real	566.682	3.186.000	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(3.557)
US-Dollar	Chilenischer Peso	33.274	28.872.000	13. Jan. 22	UBS AG	(504)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	319.773	2.051.204	13. Jan. 22	BNP Paribas	(2.619)
US-Dollar	Tschechische Krone	254.807	5.736.955	13. Jan. 22	BNP Paribas	(5.446)
US-Dollar	Euro	3.800.000	3.375.524	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(18.810)
US-Dollar	Euro	163.723	144.714	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(90)
US-Dollar	Euro	3.753.948	3.326.039	13. Jan. 22	UBS AG	(10.005)
US-Dollar	Euro	705.322	624.000	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(957)
US-Dollar	Indische Rupie	1.107.190	83.925.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(18.234)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	850.128	12.241.000.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(7.912)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.800.000	38.943.546	13. Jan. 22	BNP Paribas	(90.143)
US-Dollar	Polnischer Zloty	701.045	2.916.784	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(15.136)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.118.698	3.803.329	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(5.796)
Euro	Australischer Dollar	485.874	770.000	19. Jan. 22	Morgan Stanley	(7.217)
Euro	Australischer Dollar	202.225	320.000	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.696)
Euro	Australischer Dollar	1.523.102	2.421.000	19. Jan. 22	BNP Paribas	(27.255)
Euro	Australischer Dollar	287.510	450.000	19. Jan. 22	BNP Paribas	(661)
Euro	Australischer Dollar	190.172	300.000	19. Jan. 22	HSBC Bank plc	(1.942)
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.049.367	830.767	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(6.106)
Chilenischer Peso	US-Dollar	32.354.000	39.009	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(990)
Chilenischer Peso	US-Dollar	91.509.000	112.096	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(4.357)
Chilenischer Peso	US-Dollar	8.567.000	10.037	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(4)
Chilenischer Peso	US-Dollar	32.024.000	37.567	20. Jan. 22	BNP Paribas	(57)
Chilenischer Peso	US-Dollar	33.203.000	39.236	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(312)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	888.390.000	224.426	20. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(5.820)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	118.287.000	30.260	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.109)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	96.957.000	24.225	20. Jan. 22	BNP Paribas	(398)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	125.679.000	31.630	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(719)
Japanischer Yen	US-Dollar	22.682.948	199.015	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(1.724)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	114.404	80.051	20. Jan. 22	BNP Paribas	(1.689)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	21.926	15.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(21)
Russischer Rubel	US-Dollar	39.635.000	532.721	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(4.908)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	397.510	25.000	20. Jan. 22	UBS AG	(119)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	111.170	7.000	20. Jan. 22	UBS AG	(41)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	10.889.065	684.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(2.521)
Schwedische Krone	US-Dollar	3.445.473	384.305	20. Jan. 22	UBS AG	(3.537)
Schwedische Krone	US-Dollar	504.719	56.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(257)
Türkische Lira	US-Dollar	2.362.240	205.375	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(27.608)
US-Dollar	Australischer Dollar	37.000	51.384	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(226)
US-Dollar	Brasilianischer Real	35.738	203.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(496)
US-Dollar	Brasilianischer Real	23.396	133.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(342)
US-Dollar	Brasilianischer Real	4.703	27.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(110)
US-Dollar	Brasilianischer Real	16.790	95.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(174)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	290.000	374.247	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.374)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	14.000	18.021	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(131)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	46.000	58.991	20. Jan. 22	UBS AG	(277)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	59.000	75.212	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(43)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	37.000	32.737	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(58)
US-Dollar	Euro	35.000	31.031	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(119)
US-Dollar	Indische Rupie	13.039	977.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(71)
US-Dollar	Indische Rupie	37.566	2.846.000	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	(574)
US-Dollar	Indische Rupie	28.063	2.114.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(285)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	9.047	130.680.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(111)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	18.922	271.398.000	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(114)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	70.000	1.478.737	20. Jan. 22	UBS AG	(1.886)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	22.000	455.799	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(207)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	71.154	1.500.642	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(1.811)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	14.000	302.057	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	(649)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	33.000	716.061	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(1.705)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	52.000	1.110.675	20. Jan. 22	BNP Paribas	(1.926)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	41.000	60.523	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(298)
US-Dollar	Norwegische Krone	144.290	1.286.939	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.321)
US-Dollar	Norwegische Krone	13.000	115.824	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(107)
US-Dollar	Russischer Rubel	105.944	8.032.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(782)
US-Dollar	Pfund Sterling	82.103	61.036	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(128)
US-Dollar	Schwedische Krone	76.000	693.280	20. Jan. 22	UBS AG	(461)
US-Dollar	Schweizer Franken	59.000	54.410	20. Jan. 22	UBS AG	(547)
US-Dollar	Schweizer Franken	31.000	28.625	20. Jan. 22	BNP Paribas	(323)
US-Dollar	Schweizer Franken	28.000	25.721	20. Jan. 22	UBS AG	(163)
US-Dollar	Schweizer Franken	54.000	49.567	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(276)
US-Dollar	Schweizer Franken	19.000	17.737	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(385)
US-Dollar	Schweizer Franken	43.773	40.523	20. Jan. 22	BNP Paribas	(556)
Euro	US-Dollar	540.050	625.000	21. Jan. 22	Morgan Stanley	(11.951)
Euro	US-Dollar	1.025.499	1.185.000	21. Jan. 22	Morgan Stanley	(21.095)
Euro	US-Dollar	578.591	673.000	21. Jan. 22	Natwest Markets Plc	(15.803)
Euro	US-Dollar	28.336	33.000	21. Jan. 22	RBC Capital Markets	(810)
Euro	US-Dollar	30.772.564	35.795.000	21. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(841.617)
US-Dollar	Euro	700.000	618.769	21. Jan. 22	BNP Paribas	(528)
US-Dollar	Euro	3.900.000	3.457.644	21. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(13.160)
Euro	Pfund Sterling	1.688.068	1.440.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(25.598)
Euro	Pfund Sterling	793.816	680.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(15.415)
Euro	Pfund Sterling	454.931	390.000	25. Jan. 22	UBS AG	(9.186)
Euro	Pfund Sterling	1.687.288	1.440.000	25. Jan. 22	Goldman Sachs	(26.378)
Euro	Pfund Sterling	189.923	163.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(4.054)
Euro	Pfund Sterling	36.402.476	31.270.000	25. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(810.254)
Euro	Pfund Sterling	249.928	213.000	25. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(3.552)
Euro	Pfund Sterling	3.269.661	2.775.000	25. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(32.716)
Euro	Pfund Sterling	705.096	600.000	25. Jan. 22	BNP Paribas	(8.931)
Euro	Pfund Sterling	873.317	740.000	25. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(7.317)
Euro	Pfund Sterling	493.666	420.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(6.153)
Pfund Sterling	Euro	750.000	892.832	25. Jan. 22	UBS AG	(297)
Euro	US-Dollar	137.917	1.610.000	28. Jan. 22	Morgan Stanley	(4.257)
Euro	US-Dollar	28.754.261	33.350.000	28. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(696.263)
Euro	US-Dollar	3.386.133	3.936.000	28. Jan. 22	Morgan Stanley	(89.647)
Euro	US-Dollar	385.100	446.000	28. Jan. 22	Morgan Stanley	(8.752)
US-Dollar	Euro	1.136.000	1.007.037	28. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(3.865)
US-Dollar	Euro	1.560.000	1.380.523	28. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.927)
US-Dollar	Brasilianischer Real	402.105	2.300.000	2. Feb. 22	BNP Paribas	(6.917)
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.983.739	22.634.407	2. Feb. 22	HSBC Bank plc	(44.583)
Euro	US-Dollar	716.230	822.000	4. Feb. 22	RBC Capital Markets	(9.554)
Euro	US-Dollar	29.268.601	33.585.000	4. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(385.234)
US-Dollar	Euro	2.000.000	1.772.598	4. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(6.700)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	652.764	9.410.000.000	9. Feb. 22	HSBC Bank plc	(6.778)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	713.011	10.255.954.000	9. Feb. 22	Morgan Stanley	(6.006)
Euro	US-Dollar	23.056.755	26.166.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(42.113)
Ungarischer Forint	US-Dollar	330.000.000	1.015.509	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(8.414)
Ungarischer Forint	US-Dollar	5.224.000	16.261	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(297)
Polnischer Zloty	US-Dollar	8.300.000	2.039.478	14. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(444)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.</b>							
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	181.000	11.300	14. Feb. 22	UBS AG	(16)	
Thailändischer Baht	US-Dollar	59.500.000	1.819.071	14. Feb. 22	Goldman Sachs	(33.838)	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	2.082.859	13.370.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(14.408)	
US-Dollar	Tschechische Krone	1.345.662	29.796.000	14. Feb. 22	BNP Paribas	(4.999)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	4.382.043	91.310.000	14. Feb. 22	BNP Paribas	(47.024)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	750.000	3.075.042	14. Feb. 22	BNP Paribas	(4.779)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	681.373	2.800.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(5.715)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	672.780	2.750.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(2.457)	
US-Dollar	Thailändischer Baht	742.413	25.000.000	14. Feb. 22	Goldman Sachs	(5.118)	
Euro	US-Dollar	375.025	425.000	17. Feb. 22	UBS AG	(138)	
Euro	US-Dollar	32.994.540	37.501.000	17. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(108.782)	
US-Dollar	Euro	18.017.000	15.915.051	17. Feb. 22	UBS AG	(10.874)	
						<b>EUR</b>	<b>(5.499.392)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse CHFT (Hedged)</b>							
Schweizer Franken	Euro	12.447	11.915	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	130	
						<b>EUR</b>	<b>130</b>
						<b>CHF</b>	<b>134</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling T (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	Euro	10.594.038	12.378.211	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	232.351	
						<b>EUR</b>	<b>232.351</b>
						<b>GBP</b>	<b>195.152</b>
Euro	Pfund Sterling	2.264	1.929	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(33)	
						<b>EUR</b>	<b>(33)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(28)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	Pfund Sterling	198	166	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	Euro	44.742	53.208	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	63	
Euro	Pfund Sterling	8.623	7.242	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	Pfund Sterling	1	1	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	Euro	2.000	2.347	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	34	
Pfund Sterling	Euro	4.918	5.801	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	52	
Pfund Sterling	Euro	19.608	23.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	290	
Pfund Sterling	Euro	245.445	287.308	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.856	
Pfund Sterling	Euro	89.245.267	104.275.319	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.957.352	
Pfund Sterling	Euro	166	197	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>EUR</b>	<b>1.962.649</b>
						<b>GBP</b>	<b>1.648.429</b>
Euro	Pfund Sterling	61.757	52.081	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(237)	
Euro	Pfund Sterling	10.937.949	9.289.893	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(120.229)	
Euro	Pfund Sterling	5.769	4.918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(84)	
Euro	Pfund Sterling	37.421	31.984	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(651)	
Euro	Pfund Sterling	2.560	2.198	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(57)	
Euro	Pfund Sterling	53.182	44.742	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(77)	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Pfund Sterling	Euro	7.242	8.623	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(3)
						<b>EUR</b>	<b>(121.338)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(101.912)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	Euro	9.933	11.605	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		218
						<b>EUR</b>	<b>218</b>
						<b>GBP</b>	<b>183</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	Euro	10.000.000	11.796.773	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		106.678
Pfund Sterling	Euro	118.931.869	138.961.527	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.608.447
						<b>EUR</b>	<b>2.715.125</b>
						<b>GBP</b>	<b>2.280.433</b>
Euro	Pfund Sterling	64.757	55.000	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(712)
Pfund Sterling	Euro	664.390	792.401	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.547)
						<b>EUR</b>	<b>(2.259)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(1.897)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD R (Hedged)</b>							
US-Dollar	Euro	4.794	4.236	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	915.445	810.420	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.781)
						<b>EUR</b>	<b>(1.782)</b>
						<b>USD</b>	<b>(2.017)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD T (Hedged)</b>							
US-Dollar	Euro	50.364	44.498	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(10)
US-Dollar	Euro	9.249.628	8.188.452	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(17.998)
						<b>EUR</b>	<b>(18.008)</b>
						<b>USD</b>	<b>(20.382)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	21.522	24.331	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		29
						<b>EUR</b>	<b>29</b>
						<b>USD</b>	<b>33</b>
US-Dollar	Euro	24.331	21.524	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(28)
US-Dollar	Euro	4.720	4.170	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	880.809	779.757	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.714)
						<b>EUR</b>	<b>(1.743)</b>
						<b>USD</b>	<b>(1.973)</b>

# BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Guernsey - 3.237.321</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.893.613)</b>			
5.395.536	Sherborne Investors Guernsey C Ltd	3.237.321	2,62
<b>Vereinigtes Königreich - 12.319.172</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 23.874.449)</b>			
451.497	Electra Private Equity Plc	312.436	0,25
12.006.736	Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	12.006.736	9,71
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>15.556.493</b>	<b>12,58</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Deutschland - 4.005.140</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
4.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.875% 15-Mar-2022	4.005.140	3,24
<b>Vereinigtes Königreich - 4.997.275</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.004.160)</b>			
5.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-May-2022	4.997.275	4,04
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>9.002.415</b>	<b>7,28</b>
<b>Einlagezertifikate</b>			
<b>Australien - 4.986.482</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.000.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 0.000% 05-Sep-2022 CD	4.986.482	4,03
<b>Belgien - 3.999.167</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.999.961)</b>			
4.000.000	Euroclear Bank SA/NV 0.000% 18-Feb-2022 CD	3.999.167	3,23
<b>Kanada - 5.003.046</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.001.123)</b>			
5.000.000	Toronto-Dominion Bank/The 0.620% 01-Dec-2022 CD	5.003.046	4,04
<b>Schweiz - 2.001.669</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 17.003.555)</b>			
2.000.000	UBS AG/London 0.650% 07-Dec-2022 CD	2.001.669	1,62
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 4.499.494</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.000.376)</b>			
2.500.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 0.000% 14-Mar-2022 CD	2.499.325	2,02
2.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 0.000% 18-Mar-2022 CD	2.000.169	1,62
<b>Vereinigtes Königreich - 4.998.303</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 13.999.733)</b>			
5.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 28-Feb-2022 CD	4.998.303	4,04
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 4.997.084</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.999.297)</b>			
5.000.000	Bank of America Corp 0.000% 29-Apr-2022 CD	4.997.084	4,04
<b>Gesamtanlagen in Einlagezertifikaten</b>		<b>30.485.245</b>	<b>24,64</b>
<b>Commercial Paper</b>			
<b>Finnland - 8.987.166</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.000.000	Nordea Bank Abp 0.000% 25-Feb-2022 CP	4.999.578	4,04
4.000.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.000% 03-Aug-2022 CP	3.987.588	3,22
<b>Frankreich - 11.995.984</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 25.998.018)</b>			
5.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.000% 14-Mar-2022 CP	4.998.431	4,04
5.000.000	Dexia Credit Local SA 0.000% 01-Apr-2022 CP	4.997.657	4,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Commercial Paper Forts.</b>			
<b>Frankreich Forts.</b>			
2.000.000	Societe Nationale SNCF SA 0.000% 14-Jan-2022 CP	1.999.896	1,62
<b>Spanien - 4.999.180</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.000.000	Banco Santander SA 0.000% 01-Feb-2022 CP	4.999.180	4,04
<b>Schweden - 9.995.997</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.999.127)</b>			
5.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.000% 22-Mar-2022 CP	4.998.933	4,04
5.000.000	Swedbank AB 0.000% 10-May-2022 CP	4.997.064	4,04
<b>Vereinigtes Königreich - 5.999.521</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.499.917)</b>			
3.000.000	Jyske Bank A/S 0.000% 01-Feb-2022 CP	2.999.731	2,42
3.000.000	PACCAR Financial Plc 0.000% 21-Jan-2022 CP	2.999.790	2,43
<b>Gesamtanlagen in Commercial Paper</b>		<b>41.977.848</b>	<b>33,93</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Bermudas - 754.687</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.028.500)</b>			
175.000	Conduit Holdings Ltd	754.687	0,61
<b>Guernsey - 23.683</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.057.289)</b>			
18.387.629	Sherborne Investors Guernsey B Ltd	23.683	0,02
<b>Jersey - 455.750</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
50.000	Sanne Group Plc	455.750	0,37
<b>Niederlande - 1.275.599</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
81.000	CTP NV '144A'	1.275.599	1,03
<b>Spanien - 3.184.653</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.434.850)</b>			
377.453	Grifols SA ADR	3.184.653	2,57
<b>Schweiz - 2.260.209</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.542.827)</b>			
7.334	Roche Holding AG	2.260.209	1,83
<b>Vereinigtes Königreich - 3.110.162</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.590.869)</b>			
599.141	Applied Graphene Materials Plc	140.798	0,11
6.000	Electrocomponents Plc	72.630	0,06
1.329.491	Hostmore Plc	1.538.221	1,24
162.845	JD Sports Fashion Plc	353.862	0,29
465.116	Stelrad Group Plc	1.004.651	0,81
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 281.610</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
270.000	Diversified Energy Co Plc	281.610	0,23
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>11.346.353</b>	<b>9,17</b>
<b>Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)</b>			
<b>Kanada - 6.057.510</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.010.125)</b>			
3.000.000	Bank of Montreal FRN 1.192% 09-Jan-2023	3.028.380	2,45
3.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 'EMTN' FRN 1.177% 20-Jan-2023	3.029.130	2,45
<b>Deutschland - 2.556.387</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
2.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' FRN 1.177% 14-Jun-2024	2.556.387	2,06

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
<b>Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN) Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich - 5.018.450</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.000.000	HSBC UK Bank Plc 'EMTN' FRN 0.932% 17-Sep-2022	5.018.450	4,06
<b>Gesamtanlagen in variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)</b>		<b>13.632.347</b>	<b>11,02</b>
<b>Aktienindex-Swaps</b>			
<b>Europa - 191.912</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 172.800)</b>			
(2.500)	JPMorgan Index EUIB 04-Nov-2022	6.247	0,00
(18.402)	JPMorgan Index EUR Capital Goods 04-Nov-2022	7.285	0,00
(8.500)	JPMorgan Index PNB 04-Nov-2022	76.676	0,06
(27.070)	JPMorgan Index RESM 04-Nov-2022	44.563	0,04
(1.705)	STOXX® Europe 600 Consumer Products and Services Index 13-Jan-2022	17.305	0,02
(3.270)	STOXX® Europe 600 Oil & Gas Index 18-Oct-2022	39.836	0,03
<b>Deutschland - 2.554</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
(21)	DAX Index 04-Nov-2022	2.554	0,00
<b>Vereinigtes Königreich - 43.461</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 55.791)</b>			
(20)	FTSE 350 Mining Index 04-Nov-2022	24.590	0,02
(4.825)	JPMorgan Index MEDA 04-Nov-2022	10.641	0,01
(4.115)	JPMorgan Index UKFM 04-Nov-2022	8.230	0,01
<b>Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps</b>		<b>237.927</b>	<b>0,19</b>
<b>Aktien-Swaps</b>			
<b>Österreich - 38.722</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
26.000	Erste Group Bank AG 27-Jun-2022	38.722	0,03
<b>Belgien - 812.012</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.515.381)</b>			
20.302	D'ieteren Group 27-Jun-2022	602.776	0,49
3.150	KBC Group NV 18-Oct-2022	1.101	0,00
18.312	Mithra Pharmaceuticals SA 18-Oct-2022	7.690	0,01
27.000	Recticel SA 04-Nov-2022	34.535	0,03
(13.000)	Umicore SA 18-Oct-2022	165.910	0,13
<b>Dänemark - 153.390</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 534.095)</b>			
13.775	Carlsberg AS 13-Jan-2022	112.249	0,09
(3.387)	Chr Hansen Holding A/S 27-Jun-2022	9.945	0,01
(6.656)	Orsted SA '144A' 18-Oct-2022	31.196	0,02
<b>Ägypten - 24.469</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
(300.000)	Centamin Plc 18-Oct-2022	24.469	0,02
<b>Finnland - 179.308</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 61.431)</b>			
22.601	Fortum Oyj 27-Jun-2022	14.142	0,01
298.669	Nokia Oyj 27-Jun-2022	165.166	0,13
<b>Frankreich - 470.116</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.022.373)</b>			
(3.724)	Aeroports de Paris 27-Jun-2022	6.959	0,01
9.779	Air Liquide SA 18-Oct-2022	82.955	0,07
9.764	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 18-Oct-2022	90.414	0,07
(22.969)	Danone SA 18-Oct-2022	54.885	0,04
7.500	Eurazeo SE 27-Jun-2022	17.784	0,01
(225)	Kering SA 27-Jun-2022	1.067	0,00
(22.073)	Kleppierre SA (REIT) 13-Jan-2022	16.500	0,01
38.500	Societe Generale SA 27-Jun-2022	32.482	0,03
56.661	SPIE SA 04-Nov-2022	67.577	0,06
8.399	Trigano SA 18-Oct-2022	99.493	0,08
<b>Deutschland - 404.557</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.274.747)</b>			
(22.051)	BASF SE 27-Jun-2022	51.787	0,04
175.000	Commerzbank AG 18-Oct-2022	36.704	0,03
9.042	Daimler Truck Holding AG 18-Oct-2022	245.374	0,20
(3.232)	Deutsche Post AG 27-Jun-2022	222	0,00

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
<b>Aktien-Swaps Forts.</b>			
<b>Deutschland Forts.</b>			
8.000	Hannover Rueck SE 27-Jun-2022	42.536	0,04
(38.850)	Softwareone Holding AG 18-Oct-2022	13.578	0,01
16.435	Takkt AG 18-Oct-2022	14.356	0,01
<b>Irland - 61.057</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 517.088)</b>			
25.194	CRH Plc 18-Oct-2022	29.907	0,02
17.500	Smurfit Kappa Group Plc 04-Nov-2022	31.150	0,03
<b>Italien - 476.341</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 579.355)</b>			
(400.000)	Intesa Sanpaolo SpA 27-Jun-2022	64.891	0,05
(40.000)	Nexi SpA '144A' 18-Oct-2022	20.916	0,02
74.893	Salvatore Ferragamo SpA 27-Jun-2022	238.829	0,19
90.000	UniCredit SpA 27-Jun-2022	151.705	0,12
<b>Jersey - 3.830</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 36.019)</b>			
45.062	Sanne Group Plc 13-Jan-2022	3.830	0,01
<b>Niederlande - 249.932</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.460.590)</b>			
14.142	Aalberts NV 27-Jun-2022	37.137	0,03
20.000	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A' 27-Jun-2022	3.141	0,00
22.427	EXOR NV 27-Jun-2022	138.825	0,11
26.250	NN Group NV 27-Jun-2022	46.393	0,04
67.193	Royal Dutch Shell Plc 27-Jun-2022	24.436	0,02
<b>Norwegen - 140.704</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
72.000	DNB Bank ASA 18-Oct-2022	30.241	0,02
52.442	Equinor ASA 27-Jun-2022	110.463	0,09
<b>Portugal - 35.315</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 151.916)</b>			
332.259	EDP - Energias de Portugal SA 18-Oct-2022	35.315	0,03
<b>Südafrika - 67.981</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
44.900	Anglo American Plc 04-Nov-2022	67.981	0,05
<b>Spanien - 723.762</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 700.844)</b>			
320.000	CaixaBank SA 18-Oct-2022	29.417	0,02
35.000	Corp ACCIONA Energias Renovables SA 27-Jun-2022	97.262	0,08
(230.217)	Grifols SA 04-Nov-2022	382.368	0,31
13.926	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA 18-Oct-2022	206.443	0,17
58.975	Merlin Properties Socimi SA (REIT) 18-Oct-2022	8.272	0,01
<b>Supranational - 139.699</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
8.000	Endeavour Mining Plc 04-Nov-2022	7.066	0,00
37.465	STMicroelectronics 27-Jun-2022	132.633	0,11
<b>Schweden - 216.600</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 196.579)</b>			
43.004	AAK AB 27-Jun-2022	18.226	0,02
18.668	Atlas Copco AB 18-Oct-2022	97.539	0,08
(45.323)	Sinch AB '144A' 27-Jun-2022	100.835	0,08
<b>Schweiz - 142.532</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.464.942)</b>			
8.474	Cie Financiere Richemont SA 04-Nov-2022	142.225	0,12
(1.000.000)	Meyer Burger Technology AG 27-Jun-2022	307	0,00
<b>Vereinigtes Königreich - 949.251</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.328.498)</b>			
(185.000)	abrdn plc 13-Jan-2022	34.040	0,03
27.500	Admiral Group Plc 04-Nov-2022	73.841	0,06
(212.500)	Ashmore Group Plc 13-Jan-2022	87.437	0,07
6.300	AstraZeneca Plc 13-Jan-2022	6.504	0,00
90.000	Beazley Plc 18-Oct-2022	21.667	0,02
29.079	Bellway Plc 04-Nov-2022	34.895	0,03
20.000	Berkeley Group Holdings Plc 13-Jan-2022	86.800	0,07
30.000	Blue Prism Group plc 18-Oct-2022	10.950	0,01
40.000	Computacenter Plc 18-Oct-2022	21.839	0,02

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
<b>Aktien-Swaps Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
(34.916)	Deliveroo Plc - Class A '144A' 13-Jan-2022	23.237	0,02
5.000	Entain Plc 13-Jan-2022	3.389	0,00
66.659	GlaxoSmithKline Plc 18-Oct-2022	61.460	0,05
150.000	Hiscox Ltd 18-Oct-2022	15.300	0,01
285.000	HSBC Holdings Plc 18-Oct-2022	23.885	0,02
175.000	Indivior Plc 13-Jan-2022	13.536	0,01
12.000	Intermediate Capital Group Plc 04-Nov-2022	8.633	0,01
620.000	Jupiter Fund Management Plc 13-Jan-2022	24.688	0,02
350.000	Petershill Partners Plc '144A' 18-Oct-2022	71.332	0,06
150.000	Phoenix Group Holdings Plc 18-Oct-2022	14.720	0,01
(18.000)	Schroders Plc 18-Oct-2022	22.590	0,02
131.217	Smiths Group Plc 18-Oct-2022	133.865	0,11
(15.000)	Softcat Plc 18-Oct-2022	3.870	0,00
80.000	SSE Plc 13-Jan-2022	33.771	0,03
100.000	Superdry Plc 13-Jan-2022	-	-
70.500	Tate & Lyle Plc 13-Jan-2022	3.666	0,00
380.000	Tesco Plc 18-Oct-2022	39.045	0,03
175.000	TP ICAP Group Plc 13-Jan-2022	24.688	0,02
47.302	Watches of Switzerland Group Plc '144A' 18-Oct-2022	34.057	0,03
155.000	WPP Plc 18-Oct-2022	15.546	0,01
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 276.768</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 19.010)</b>		<b>276.768</b>	<b>0,22</b>
(15.000)	DraftKings Inc - Class A 04-Nov-2022	163.773	0,13
5.400	Ferguson Plc 13-Jan-2022	112.995	0,09
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps</b>		<b>5.566.346</b>	<b>4,50</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 129.730 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 61.505)			
		129.730	0,11
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>127.934.704</b>	<b>103,42</b>
<b>Aktienindex-Swaps</b>			
<b>Europa - (709.367)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (1.381.430))</b>		<b>(709.367)</b>	<b>(0,57)</b>
(8.889)	EU Value Cheap Long Basket Index 27-Jun-2022	(26.877)	(0,02)
(13.418)	EURO STOXX® Banks Index 18-Oct-2022	(37.802)	(0,03)
(5.446)	EURO STOXX® Utilities Index 04-Nov-2022	(66.253)	(0,05)
(14.000)	JPMorgan Index COVU 04-Nov-2022	(78.676)	(0,06)
(6.500)	JPMorgan Index EUR Capital Goods 04-Nov-2022	(4.741)	(0,00)
(4.500)	JPMorgan Index PNB 04-Nov-2022	(11.511)	(0,01)
(4.300)	JPMorgan Index REIN 04-Nov-2022	(8.306)	(0,01)
(2.674)	JPMorgan Index RESM 04-Nov-2022	(4.629)	(0,00)
(48.439)	JPMorgan Index VLL 04-Nov-2022	(40.395)	(0,03)
(7.500)	JPMorgan Index WIND 04-Nov-2022	(9.111)	(0,01)
(2.303)	STOXX® Europe 600 Automobiles & Parts Index 13-Jan-2022	(36.092)	(0,03)
(7.000)	STOXX® Europe 600 Banks Index 04-Nov-2022	(24.837)	(0,02)
(1.415)	STOXX® Europe 600 Consumer Products and Services Index 13-Jan-2022	(19.056)	(0,02)
(2.168)	STOXX® Europe 600 Health Care Index 13-Jan-2022	(144.817)	(0,12)
(3.958)	STOXX® Europe 600 Industrial Goods & Services Index 13-Jan-2022	(140.419)	(0,11)
(5.750)	STOXX® Europe 600 Insurance Index 04-Nov-2022	(32.423)	(0,03)
(312)	STOXX® Europe 600 Technology Index 13-Jan-2022	(10.783)	(0,01)
(2.654)	STOXX® Europe 600 Telecommunications Index 04-Nov-2022	(12.639)	(0,01)
<b>Vereinigtes Königreich - (452.699)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (2.508.616))</b>		<b>(452.699)</b>	<b>(0,37)</b>
(196)	FTSE 250 Index 13-Jan-2022	(118.852)	(0,10)
(660)	FTSE 350 General Retailers Index 04-Nov-2022	(61.542)	(0,05)
(60)	FTSE 350 - Food Producers & Processors Index 04-Nov-2022	(17.256)	(0,01)
(502)	FTSE 350 - Industrial Goods & Services Index 18-Oct-2022	(1.571)	(0,00)
(1.500)	JP Morgan Index UKCURF 04-Nov-2022	(20.986)	(0,02)
(1.125)	JPINCAPR 04-Nov-2022	(718)	(0,00)
(13.550)	JPINHOME 04-Nov-2022	(136.224)	(0,11)
(5.000)	JPMorgan Index MEDA 04-Nov-2022	(22.440)	(0,02)
(13.731)	JPMorgan Index UKBP 04-Nov-2022	(37.790)	(0,03)
(9.000)	JPMorgan Index UKFM 04-Nov-2022	(35.320)	(0,03)
<b>Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps</b>		<b>(1.162.066)</b>	<b>(0,94)</b>

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
<b>Aktien-Swaps</b>			
<b>Australien - (124.623)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(124.623)</b>	<b>(0,10)</b>
(66.201)	BHP Group Plc 04-Nov-2022	(124.623)	(0,10)
<b>Belgien - (133.923)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (3.583))</b>		<b>(133.923)</b>	<b>(0,11)</b>
(8.164)	Gruppe Bruxelles Lambert SA 27-Jun-2022	(13.646)	(0,01)
16.850	KBC Group NV 18-Oct-2022	(40.529)	(0,03)
(20.000)	Warehouses De Pauw CVA (REIT) 27-Jun-2022	(79.748)	(0,07)
<b>China - (49.689)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(49.689)</b>	<b>(0,04)</b>
25.000	Prosus NV 04-Nov-2022	(49.689)	(0,04)
<b>Dänemark - (18.400)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (96.471))</b>		<b>(18.400)</b>	<b>(0,02)</b>
2.956	Carlsberg AS 13-Jan-2022	(16.358)	(0,02)
(2.410)	Carlsberg AS 18-Oct-2022	(2.042)	(0,00)
<b>Ägypten - (9.841)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(9.841)</b>	<b>(0,01)</b>
(150.000)	Centamin Plc 18-Oct-2022	(9.841)	(0,01)
<b>Frankreich - (186.434)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (402.589))</b>		<b>(186.434)</b>	<b>(0,15)</b>
(23.525)	AXA SA 27-Jun-2022	(10.769)	(0,01)
(90.000)	Credit Agricole SA 27-Jun-2022	(19.245)	(0,02)
13.800	Eurazeo SE 27-Jun-2022	(59.764)	(0,05)
(843)	Kering SA 27-Jun-2022	(25.980)	(0,02)
(19.694)	Klepierre SA (REIT) 13-Jan-2022	(6.289)	(0,00)
6.798	Safran SA 27-Jun-2022	(64.387)	(0,05)
<b>Deutschland - (308.705)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (1.402.036))</b>		<b>(308.705)</b>	<b>(0,25)</b>
(2.950)	Allianz SE 27-Jun-2022	(11.408)	(0,01)
43.116	Bayer AG 27-Jun-2022	(7.460)	(0,01)
(8.354)	Bayerische Motoren Werke AG 18-Oct-2022	(15.401)	(0,01)
20.506	Covestro AG '144A' 18-Oct-2022	(37.030)	(0,03)
18.085	Daimler AG 18-Oct-2022	(216.680)	(0,18)
(100.000)	Deutsche Bank AG 27-Jun-2022	(2.096)	(0,00)
10.000	Deutsche Boerse AG 27-Jun-2022	(3.459)	(0,00)
(9.950)	Deutsche Post AG 27-Jun-2022	(15.171)	(0,01)
<b>Irland - (14.102)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (35.302))</b>		<b>(14.102)</b>	<b>(0,01)</b>
(1.500)	Flutter Entertainment Plc 18-Oct-2022	(3.048)	(0,00)
(8.880)	Kerry Group Plc 27-Jun-2022	(11.054)	(0,01)
<b>Italien - (37.933)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (148.912))</b>		<b>(37.933)</b>	<b>(0,03)</b>
(100.000)	Intesa Sanpaolo SpA 27-Jun-2022	(4.296)	(0,00)
(13.000)	Nexi SpA '144A' 18-Oct-2022	(518)	(0,00)
(75.686)	Snam SpA 18-Oct-2022	(33.119)	(0,03)
<b>Niederlande - (72.129)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (3.365.128))</b>		<b>(72.129)</b>	<b>(0,06)</b>
80.000	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A' 27-Jun-2022	(7.087)	(0,01)
85.916	ING Groep NV 18-Oct-2022	(65.042)	(0,05)
<b>Portugal - (3.587)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(3.587)</b>	<b>(0,00)</b>
67.357	EDP - Energias de Portugal SA 18-Oct-2022	(3.587)	(0,00)
<b>Spanien - (168.039)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (195.193))</b>		<b>(168.039)</b>	<b>(0,14)</b>
(200.000)	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 27-Jun-2022	(23.187)	(0,02)
164.000	Bankinter SA 27-Jun-2022	(76.043)	(0,06)
(38.138)	Enagas SA 04-Nov-2022	(15.696)	(0,02)
21.729	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) 18-Oct-2022	(3.148)	(0,00)
20.902	Merlin Properties Socimi SA (REIT) 18-Oct-2022	(2.899)	(0,00)
(38.143)	Red Electrica Corp SA 04-Nov-2022	(25.229)	(0,02)
35.034	Repsol SA 13-Jan-2022	(21.837)	(0,02)
<b>Supranational - (152.882)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(152.882)</b>	<b>(0,12)</b>
40.000	Endeavour Mining Plc 04-Nov-2022	(152.882)	(0,12)



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien-Swaps Forts.</b>			
<b>Schweden - (200.701)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (201.107))</b>		<b>(200.701)</b>	<b>(0,16)</b>
(16.010)	Atlas Copco AB 18-Oct-2022	(95.714)	(0,08)
(6.800)	EQT AB 27-Jun-2022	(18.788)	(0,01)
(27.631)	Kinnevik AB 18-Oct-2022	(22.096)	(0,02)
(22.000)	Sweco AB 18-Oct-2022	(47.475)	(0,04)
(49.188)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B 27-Jun-2022	(16.628)	(0,01)
<b>Schweiz - (100.102)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (721.711))</b>		<b>(100.102)</b>	<b>(0,08)</b>
1.300	Cie Financiere Richemont SA 04-Nov-2022	(1.893)	(0,00)
(164)	Givaudan SA 27-Jun-2022	(52.585)	(0,04)
(400.000)	Meyer Burger Technology AG 27-Jun-2022	(7.261)	(0,01)
(2.500)	Sensirion Holding AG '144A' 13-Jan-2022	(17.386)	(0,01)
(2.000)	Zurich Insurance Group AG 18-Oct-2022	(20.977)	(0,02)
<b>Vereinigtes Königreich - (811.315)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (1.682.352))</b>		<b>(811.315)</b>	<b>(0,65)</b>
(80.000)	Ashmore Group Plc 13-Jan-2022	(2.004)	(0,00)
7.000	AstraZeneca Plc 13-Jan-2022	(30.975)	(0,03)
(8.000)	AVEVA Group Plc 04-Nov-2022	(13.890)	(0,01)
500.000	Benchmark Holdings Plc 13-Jan-2022	(26.250)	(0,02)
456.377	BP Plc 18-Oct-2022	(23.503)	(0,02)
1.350.000	Capita Plc 18-Oct-2022	(127.305)	(0,10)
69.106	Electrocomponents Plc 18-Oct-2022	(24.533)	(0,02)
30.619	Entain Plc 13-Jan-2022	(107.890)	(0,09)
50.000	Intermediate Capital Group Plc 04-Nov-2022	(26.602)	(0,02)
(37.410)	J D Wetherspoon Plc 18-Oct-2022	(7.576)	(0,01)
295.000	JD Sports Fashion Plc 13-Jan-2022	(14.943)	(0,01)
6.502	Just Eat Takeaway.com NV '144A' 27-Jun-2022	(91.117)	(0,07)
672.451	Kier Group Plc 18-Oct-2022	(48.417)	(0,04)
(185.000)	Kingfisher Plc 13-Jan-2022	(22.511)	(0,02)
2.600.725	Lloyds Banking Group Plc 04-Nov-2022	(24.841)	(0,02)
(10.000)	London Stock Exchange Group Plc 04-Nov-2022	(20.618)	(0,02)
180.000	Marks & Spencer Group Plc 18-Oct-2022	(9.000)	(0,01)
(450.000)	NatWest Group Plc 13-Jan-2022	(15.336)	(0,01)
(21.810)	Persimmon Plc 18-Oct-2022	(9.269)	(0,01)
(376.835)	Restaurant Group Plc/The 13-Jan-2022	(14.320)	(0,01)
(5.000)	Schroders Plc 18-Oct-2022	(3.836)	(0,00)
570.000	TP ICAP Group Plc 13-Jan-2022	(42.693)	(0,03)
(30.000)	Travis Perkins Plc 13-Jan-2022	(4.218)	(0,00)
36.244	Whitbread Plc 13-Jan-2022	(99.668)	(0,08)
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - (122.366)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>(122.366)</b>	<b>(0,10)</b>
(6.000)	DraftKings Inc - Class A 04-Nov-2022	(3.145)	(0,00)
(924)	Moderna Inc 04-Nov-2022	(15.606)	(0,01)
(75.000)	Navient Corp 04-Nov-2022	(58.182)	(0,05)
(15.000)	Swiss Re AG 27-Jun-2022	(45.433)	(0,04)
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps</b>		<b>(2.514.771)</b>	<b>(2,03)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (291.805)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (464.858))</b>				
(15)	CAC 40 10 Euro Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(898.903)	(22.447)	(0,02)
(2)	DAX Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(665.873)	(12.234)	(0,01)
(112)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(4.033.201)	(99.841)	(0,08)
(90)	FTSE 100 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(6.580.800)	(104.395)	(0,09)
(21)	FTSE MIB Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.402.988)	(38.183)	(0,03)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>				
(5)	IBEX 35 Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(364.702)	(14.705)	(0,01)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(291.805)</b>	<b>(0,24)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (2.261.617) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (749.434))			(2.261.617)	(1,83)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(6.230.259)</b>	<b>(5,04)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>2.001.426</b>	<b>1,62</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>123.705.871</b>	<b>100,00</b>

Die Kontrahenten für Aktienindex-Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.  
Die Kontrahenten für Aktien-Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	37,23
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	54,46
Derivative OTC-Finanzinstrumente	4,46
Sonstiges Umlaufvermögen	3,85
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund**

Pfund Sterling	Euro	102.184	120.000	19. Jan. 22	HSBC Bank plc	1.361
Pfund Sterling	Euro	767.307	900.000	19. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	11.138
Pfund Sterling	Euro	6.001.803	7.100.000	19. Jan. 22	Barclays Bank PLC	36.465

**GBP 48.964**

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse CHF R (Hedged)**

Pfund Sterling	Schweizer Franken	73	90	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
----------------	-------------------	----	----	-------------	-----------------------------	---

**GBP -**

**CHF -**

Schweizer Franken	Pfund Sterling	15.133	12.406	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(102)
-------------------	----------------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-------

**GBP (102)**

**CHF (125)**

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR D (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	980	1.152	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12
----------------	------	-----	-------	-------------	-----------------------------	----

**GBP 12**

**EUR 14**

Euro	Pfund Sterling	199.774	171.125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.296)
------	----------------	---------	---------	-------------	-----------------------------	---------

**GBP (3.296)**

**EUR (3.924)**

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR R (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	25.222	29.988	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36
----------------	------	--------	--------	------------	-----------------------------	----

Euro	Pfund Sterling	226	190	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
------	----------------	-----	-----	------------	-----------------------------	---

Euro	Pfund Sterling	3	3	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
------	----------------	---	---	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	206.397	241.517	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.501
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	8.878	10.441	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	107
----------------	------	-------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	218.418	257.663	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.957
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	215.665	253.037	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.091
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	173.417	203.927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.100
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	108.187	126.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.783
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	8.149	9.596	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	87
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

Pfund Sterling	Euro	17.358	20.406	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	215
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	774	918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
----------------	------	-----	-----	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	91.315	106.336	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.982
----------------	------	--------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	59.997	71.008	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	344
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	220.154	261.767	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	245
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	190	226	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
----------------	------	-----	-----	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	8.382	9.834	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	120
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	2.755.973	3.226.036	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	45.805
----------------	------	-----------	-----------	-------------	-----------------------------	--------

**GBP 61.376**

**EUR 73.075**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR R (Hedged) Forts.**

Euro	Pfund Sterling	261.767	220.170	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(312)
------	----------------	---------	---------	------------	-----------------------------	-------

Euro	Pfund Sterling	39.785	33.983	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(560)
------	----------------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-------

Euro	Pfund Sterling	61.046	52.151	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(867)
------	----------------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-------

Euro	Pfund Sterling	29.988	25.220	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(28)
------	----------------	--------	--------	-------------	-----------------------------	------

Euro	Pfund Sterling	38.726.808	33.173.128	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(639.028)
------	----------------	------------	------------	-------------	-----------------------------	-----------

**GBP (640.795)**

**EUR (762.941)**

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR R (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	7.547	8.973	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	12.040	14.158	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	146
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	1.953	2.296	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	24
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

**GBP 178**

**EUR 212**

Euro	Pfund Sterling	8.973	7.547	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)
------	----------------	-------	-------	------------	-----------------------------	------

Euro	Pfund Sterling	2.411.291	2.065.496	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(39.789)
------	----------------	-----------	-----------	-------------	-----------------------------	----------

**GBP (39.800)**

**EUR (47.387)**

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR T (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	10.788	12.826	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	15
----------------	------	--------	--------	------------	-----------------------------	----

Euro	Pfund Sterling	220	185	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
------	----------------	-----	-----	------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	191	227	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
----------------	------	-----	-----	------------	-----------------------------	---

Euro	Pfund Sterling	227	191	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
------	----------------	-----	-----	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	185	220	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
----------------	------	-----	-----	-------------	-----------------------------	---

Pfund Sterling	Euro	32.001	37.446	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	543
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	1.744	2.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	21
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

Pfund Sterling	Euro	55.261	64.837	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	792
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	117.959	138.712	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.428
----------------	------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-------

Pfund Sterling	Euro	10.157	11.891	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	167
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	5.193	6.115	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	56
----------------	------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

Pfund Sterling	Euro	20.890	24.558	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	259
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	38.234	45.345	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	140
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	16.027	18.664	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	348
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	44.160	52.507	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	49
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	----

Pfund Sterling	Euro	18.842	22.107	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	269
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

Pfund Sterling	Euro	52.837	61.849	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	878
----------------	------	--------	--------	-------------	-----------------------------	-----

**GBP 4.965**

**EUR 5.911**

Euro	Pfund Sterling	52.507	44.163	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(63)
------	----------------	--------	--------	------------	-----------------------------	------

Euro	Pfund Sterling	12.826	10.787	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12)
------	----------------	--------	--------	-------------	-----------------------------	------

Euro	Pfund Sterling	24.194.242	20.724.628	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(399.227)
------	----------------	------------	------------	-------------	-----------------------------	-----------

Euro	Pfund Sterling	1.024	863	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
------	----------------	-------	-----	-------------	-----------------------------	-----

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EURT (Hedged) Forts.</b>						
Euro	Pfund Sterling	402	341	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
Euro	Pfund Sterling	13.790	11.753	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(168)
Euro	Pfund Sterling	6.109	5.218	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(86)
Euro	Pfund Sterling	106	90	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	Pfund Sterling	454	388	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)
Euro	Pfund Sterling	1.236	1.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)
<b>GBP</b>						<b>(399.584)</b>
<b>EUR</b>						<b>(475.752)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	247	294	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	4.091	3.436	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	Euro	76	90	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	294	247	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	90	76	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	Euro	917	1.074	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16
Pfund Sterling	Euro	400	471	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5
Pfund Sterling	Euro	10.317	12.171	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	93
Pfund Sterling	Euro	3.294	3.865	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	47
Pfund Sterling	Euro	319.186	375.341	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.865
Pfund Sterling	Euro	220.514	258.161	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.635
Pfund Sterling	Euro	60.803	71.341	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	869
Pfund Sterling	Euro	3.329	3.920	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36
Pfund Sterling	Euro	8.365	9.921	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	31
Pfund Sterling	Euro	158.587	184.675	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.442
Pfund Sterling	Euro	122	144	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	Euro	2.479	2.947	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	Euro	453	532	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6
Pfund Sterling	Euro	9.882	11.568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	164
<b>GBP</b>						<b>12.214</b>
<b>EUR</b>						<b>14.542</b>

Euro	Pfund Sterling	2.947	2.479	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
Euro	Pfund Sterling	48.411	42.431	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(921)
Euro	Pfund Sterling	61.862.314	52.990.850	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.020.786)
Euro	Pfund Sterling	9.145	7.794	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(111)
Euro	Pfund Sterling	7.876	6.728	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(111)
Euro	Pfund Sterling	5.993	5.108	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(73)
Euro	Pfund Sterling	13.975	11.846	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(106)
Euro	Pfund Sterling	5.012	4.262	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(51)
Euro	Pfund Sterling	384	328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
Euro	Pfund Sterling	14.838	12.622	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(157)
Euro	Pfund Sterling	3.208.513	2.741.004	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(45.556)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	Euro	3.436	4.091	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>GBP</b>						<b>(1.067.883)</b>
<b>EUR</b>						<b>(1.271.440)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Inc) (Hedged)</b>						
Euro	Pfund Sterling	18	16	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
<b>GBP</b>						<b>-</b>
<b>EUR</b>						<b>-</b>

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD R (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	21.705	29.175	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	54
Pfund Sterling	US-Dollar	117.719	156.474	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.604
Pfund Sterling	US-Dollar	20.859	27.685	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	315
<b>GBP</b>						<b>1.973</b>
<b>USD</b>						<b>2.659</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	29.175	21.709	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(59)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.898.611	3.713.456	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(78.310)
<b>GBP</b>						<b>(78.369)</b>
<b>USD</b>						<b>(105.610)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD T (Hedged)**

US-Dollar	Pfund Sterling	659.311	499.799	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10.540)
<b>GBP</b>						<b>(10.540)</b>
<b>USD</b>						<b>(14.204)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD U (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	19.284	25.921	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	48
<b>GBP</b>						<b>48</b>
<b>USD</b>						<b>65</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	25.921	19.288	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(53)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.325.830	1.005.063	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21.195)
<b>GBP</b>						<b>(21.248)</b>
<b>USD</b>						<b>(28.634)</b>

# BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Irland - 6.876.198</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.887.304)</b>				
7.064.829	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	6.876.198	7,23	7,23
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 6.876.198 7,23</b>				
<b>Anleihen</b>				
<b>Österreich - 4.102.501</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
4.100.000	Austria Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	4.102.501	4,31	4,31
<b>Belgien - 12.522.612</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
6.700.000	Kingdom of Belgium Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Mar-2022	6.708.362	7,05	7,05
2.500.000	Oliver Capital Sarl (Zero Coupon) 0.000% 29-Dec-2023	3.139.375	3,30	3,30
2.500.000	Sagerpar SA (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2026	2.674.875	2,81	2,81
<b>Frankreich - 48.777.118</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 19.433.524)</b>				
8.403.135	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2022	8.404.732	8,83	8,83
12.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022	12.504.000	13,14	13,14
1.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2022	1.000.450	1,05	1,05
5.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2022	5.003.050	5,26	5,26
3.300.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Feb-2022	3.302.574	3,47	3,47
2.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2022	2.502.637	2,63	2,63
6.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Mar-2022	6.008.730	6,32	6,32
3.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 06-Apr-2022	3.005.505	3,16	3,16
2.000.000	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Feb-2022	2.001.800	2,10	2,10
3.000.000	French Republic Government Bond OAT 8.250% 25-Apr-2022	3.081.000	3,24	3,24
8.000	SOITEC (Zero Coupon) 0.000% 01-Oct-2025	1.962.640	2,06	2,06
<b>Deutschland - 10.649.587</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 3.647.503)</b>				
7.500.000	Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022	7.508.962	7,89	7,89
3.000.000	LEG Immobilien SE 0.400% 30-Jun-2028	3.140.625	3,30	3,30
<b>Italien - 1.631.625</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.046.250)</b>				
1.500.000	Prysmian SpA (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2026	1.631.625	1,72	1,72
<b>Niederlande - 2.433.215</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.184.123)</b>				
1.500.000	BE Semiconductor Industries NV 0.750% 05-Aug-2027	2.433.215	2,56	2,56
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 4.643.219</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.210.070)</b>				
2.000.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2024	2.113.490	2,22	2,22
5.000	Schneider Electric SE 0.000% 15-Jun-2026	1.124.375	1,18	1,18
600.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022	527.009	0,56	0,56
1.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jan-2022	878.345	0,92	0,92
<b>Gesamtanlagen in Anleihen 84.759.877 89,08</b>				
<b>Aktien-Swaps</b>				
<b>China - 108.716</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 179.967)</b>				
(220)	Alibaba Group Holding Ltd ADR 15-Jun-2022	6.214	0,00	0,00
(131.000)	Longfor Group Holdings Ltd '144A' 15-Jun-2022	102.502	0,11	0,11

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
<b>Aktien-Swaps Forts.</b>				
<b>Frankreich - 117.400</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(6.000)	SOITEC 15-Jun-2022	117.400	0,12	0,12
<b>Italien - 34.810</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(18.325)	Prysmian SpA 15-Jun-2022	34.810	0,04	0,04
<b>Japan - 166.414</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 50.123)</b>				
(4.100)	GMO Payment Gateway Inc 15-Jun-2022	34.304	0,03	0,03
(18.300)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd 15-Jun-2022	30.761	0,03	0,03
(7.000)	Mercari Inc 15-Jun-2022	16.039	0,02	0,02
(48.500)	Nippon Steel Corp 15-Jun-2022	78.060	0,08	0,08
(23.500)	Nipro Corp 15-Jun-2022	7.250	0,01	0,01
<b>Schweiz - 16.597</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(4.615)	Dufry AG 15-Jun-2022	16.597	0,02	0,02
<b>Taiwan - 199.646</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(2.500)	Sea Ltd ADR 15-Jun-2022	199.646	0,21	0,21
<b>Vereinigtes Königreich - 92.966</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 967)</b>				
(53.500)	JET2 Plc 15-Jun-2022	92.966	0,10	0,10
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 2.677.010</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 51.217)</b>				
(33.500)	3D Systems Corp 15-Jun-2022	116.048	0,12	0,12
(3.800)	Airbnb Inc 15-Jun-2022	112.688	0,12	0,12
(8.600)	Akamai Technologies Inc 15-Jun-2022	2.672	0,00	0,00
(565)	Cable One Inc 15-Jun-2022	108.368	0,11	0,11
(6.500)	Cloudflare Inc 15-Jun-2022	200.629	0,21	0,21
(2.250)	Coupa Software Inc 15-Jun-2022	28.014	0,03	0,03
(7.200)	CryoPort Inc 15-Jun-2022	111.449	0,12	0,12
(8.850)	CyberArk Software Ltd 15-Jun-2022	91.180	0,10	0,10
(6.350)	DigitalOcean Holdings Inc 15-Jun-2022	250.828	0,26	0,26
(26.250)	Dropbox Inc 15-Jun-2022	576	0,00	0,00
(28.500)	Jamf Holding Corp 15-Jun-2022	16.495	0,02	0,02
(44.300)	JetBlue Airways Corp 15-Jun-2022	58.996	0,06	0,06
(17.500)	PAR Technology Corp 15-Jun-2022	198.125	0,21	0,21
(4.000)	Perficient Inc 15-Jun-2022	60.856	0,07	0,07
(52.750)	Radius Global Infrastructure Inc 15-Jun-2022	51.865	0,06	0,06
(85.500)	SoFi Technologies Inc 15-Jun-2022	260.069	0,27	0,27
(24.500)	Spirit Airlines Inc 15-Jun-2022	118.659	0,13	0,13
(48.500)	Stem Inc 15-Jun-2022	56.427	0,06	0,06
(3.850)	Unity Software Inc 15-Jun-2022	192.195	0,20	0,20
(4.500)	Upstart Holdings Inc 15-Jun-2022	640.871	0,67	0,67
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps 3.413.559 3,59</b>				
<b>Total Return Swaps</b>				
<b>Japan - 59.350</b>				
(8.160.000)	TRS Dmg Mori Co Ltd 0.000% 16-Jul-2024	50.855	0,05	0,05
(6.800.000)	TRS Mercari Inc 0.000% 14-Jul-2026	8.495	0,01	0,01
<b>Schweiz - 1.743.039</b>				
(2.246.850)	TRS Sika AG 0.150% 05-Jun-2025	1.743.039	1,83	1,83
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 7.889.967</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 2.210.070)</b>				
(324.504)	TRS Macom Tech Solutions 0.250% 15-Mar-2026	23.493	0,02	0,02
(1.339.511)	TRS KBR Inc 2.500% 01-Nov-2023	17.883	0,02	0,02
(118.927)	TRS MP Materials Corp 0.250% 01-Apr-2026	482.936	0,51	0,51
(260.803)	TRS Ford Motor Company 0.000% 15-Mar-2026	1.275.369	1,34	1,34
(1.431.674)	TRS Nova Ltd 0.000% 15-Oct-2025	14.559	0,01	0,01
(2.157)	TRS Patrick Industries Inc 1.750% 01-Dec-2028	53.776	0,06	0,06
(465.978)	TRS Tyler Technologies Inc 0.250% 15-Mar-2026	142.400	0,15	0,15
(299.815)	TRS Expedia Group Inc 0.000% 15-Feb-2026	214.699	0,23	0,23
(298.077)	TRS Marriott Vacation Worldwide 0.000% 15-Jan-2026	122.990	0,13	0,13
(1.074.618)	TRS Barclays Bank Plc 0.000% 04-Feb-2025	622.579	0,65	0,65
(51.458)	TRS Camtek Ltd/Israel 0.000% 01-Dec-2026	371.48	0,04	0,04
(1.099.138)	TRS Booking Holdings Inc 0.750% 01-May-2025	282.268	0,30	0,30
(66.044)	TRS Shift4 Payments Inc 0.000% 15-Dec-2025	20.252	0,02	0,02
(1.300.545)	TRS ON Semiconductor Corp 1.625% 15-Oct-2023	1.873.147	1,97	1,97
(1.656.112)	TRS Chart Industries Inc 1.000% 15-Nov-2024	81.939	0,09	0,09
(183.277)	TRS ETSY Inc 0.250% 15-Jun-2028	314.908	0,33	0,33

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
(1.699.205)	TRS Pioneer Natural Resources Co 0.250% 15-May-2025	926.532	0,97	
(1.775.914)	TRS Palo Alto Networks Inc 0.375% 01-Jun-2025	810.088	0,85	
54.588	TRS Dropbox Inc 0.000% 01-Mar-2026	8.422	0,01	
(753.418)	TRS Atlas Air Worldwide Holdings Inc 1.875% 01-Jun-2024	168.276	0,18	
(1.478.197)	TRS Liberty Media Corp-Liberty Formula One 1.000% 30-Jan-2023	300.876	0,32	
(50.662)	TRS Beauty Health Co/The 1.250% 01-Oct-2026	68.112	0,07	
(73.589)	TRS Jamf Holding Corp 0.125% 01-Sep-2026	27.315	0,03	
<b>Total Return Swaps insgesamt</b>		<b>9.692.356</b>	<b>10,19</b>	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Offene Terminkontrakte - 3.315</b>					
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>					
(62)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(6.588.090)	3.315	0,00	
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>3.315</b>	<b>0,00</b>	

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 945.054 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 51.159)

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt** **105.690.359** **111,08**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Aktien-Swaps</b>				
<b>Belgien - (11.636)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(6.250)	Groupe Bruxelles Lambert SA 15-Jun-2022	(11.636)	(0,01)	
<b>Deutschland - (376.377)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (159.671))</b>				
(35.000)	G&A Group AG 15-Jun-2022	(337.263)	(0,36)	
(7.000)	LEG Immobilien SE 15-Jun-2022	(39.114)	(0,04)	
<b>Israel - (82.591)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(15.800)	Camtek Ltd/Israel 15-Jun-2022	(39.348)	(0,04)	
(18.500)	Nova Ltd 15-Jun-2022	(43.243)	(0,05)	
<b>Japan - (20.629)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (155.508))</b>				
(35.000)	DMG Mori Co Ltd 15-Jun-2022	(20.629)	(0,02)	
<b>Niederlande - (241.765)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (124.280))</b>				
(23.500)	BE Semiconductor Industries NV 15-Jun-2022	(225.604)	(0,24)	
(8.500)	JDE Peet's NV 15-Jun-2022	(16.161)	(0,01)	
<b>Schweiz - (1.604.102)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (46.956))</b>				
(20.500)	Sika AG 15-Jun-2022	(1.604.102)	(1,69)	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - (6.310.102)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (4.570.244))</b>				
(20.800)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc 15-Jun-2022	(174.739)	(0,18)	
(42.800)	Beauty Health Co/The 15-Jun-2022	(64.848)	(0,07)	
(1.120)	Booking Holdings Inc 15-Jun-2022	(252.621)	(0,27)	
(15.500)	Chart Industries Inc 15-Jun-2022	(58.554)	(0,06)	
(8.500)	Etsy Inc 15-Jun-2022	(156.209)	(0,16)	
(6.900)	Expedia Group Inc 15-Jun-2022	(71.067)	(0,08)	
(180.500)	Ford Motor Co 15-Jun-2022	(940.215)	(0,99)	
(56.200)	KBR Inc 15-Jun-2022	(25.422)	(0,03)	
(62.850)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 15-Jun-2022	(274.834)	(0,29)	
(16.050)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc 15-Jun-2022	(16.775)	(0,02)	
(9.250)	Marriott Vacations Worldwide Corp 15-Jun-2022	(89.603)	(0,09)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Aktien-Swaps Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
(10.500)	Microsoft Corp 15-Jun-2022	(504.109)	(0,53)	
(39.750)	MP Materials Corp 15-Jun-2022	(366.264)	(0,39)	
(69.750)	ON Semiconductor Corp 15-Jun-2022	(1.714.160)	(1,80)	
(9.100)	Palo Alto Networks Inc 15-Jun-2022	(774.649)	(0,81)	
(9.000)	Patrick Industries Inc 15-Jun-2022	(46.443)	(0,05)	
(28.050)	Pioneer Natural Resources Co 15-Jun-2022	(650.478)	(0,68)	
(3.000)	Schneider Electric SE 15-Jun-2022	(13.530)	(0,01)	
(11.200)	Shift4 Payments Inc - Class A 15-Jun-2022	(15.986)	(0,02)	
(3.800)	Tyler Technologies Inc 15-Jun-2022	(99.596)	(0,10)	
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps</b>		<b>(8.647.202)</b>	<b>(9,09)</b>	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Total Return Swaps</b>				
<b>Hongkong - (93.873)</b>				
(1.790.000)	TRS Citigroup Global Markets Limited 0.000% 25-Jul-2024	(93.873)	(0,10)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Japan - (103.801)</b>				
(19.455.000)	TRS Koei Tecmo Holdings Co Ltd 0.000% 20-Dec-2024	(37.835)	(0,04)	
(19.437.500)	TRS GMO Payment Gateway Inc 0.000% 22-Jun-2026	(32.739)	(0,03)	
(4.716.500)	TRS Nipro Corp 0.000% 25-Sep-2026	(12.534)	(0,01)	
(10.162.500)	TRS Nippon Steel Corp 0.000% 05-Oct-2026	(783)	0,00	
(9.730.000)	TRS Nippon Steel Corp 0.000% 04-Oct-2024	(19.910)	(0,02)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Schweiz - (26.652)</b>				
30.414	TRS Dufry One BV 0.750% 30-Mar-2026	(26.652)	(0,03)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Vereinigtes Königreich - (57.530)</b>				
(18.490)	TRS Jet2 Plc 1.625% 10-Jun-2026	(57.530)	(0,06)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - (3.186.378)</b>				
109.263	TRS Spirit Airlines Inc 1.000% 15-May-2026	(195.990)	(0,21)	
37.700	TRS Jetblue Airways Corp 0.500% 01-Apr-2026	(104.748)	(0,11)	
(138.091)	TRS DigitalOcean Holdings Inc 0.000% 01-Dec-2026	(364.155)	(0,38)	
(95.244)	TRS 3D Systems Corp 0.000% 15-Nov-2026	(162.709)	(0,17)	
(33.271)	TRS CryoPort Inc 0.750% 01-Dec-2026	(137.726)	(0,15)	
(50.745)	TRS Perficient Inc 0.125% 15-Nov-2026	(108.724)	(0,11)	
(263.773)	TRS PAR Technology Corp 1.500% 15-Oct-2027	(217.411)	(0,23)	
(264.673)	TRS Akamai Technologies Inc 0.375% 01-Sep-2027	(2.700)	0,00	
(103.599)	TRS Airbnb Inc 0.000% 15-Mar-2026	(132.717)	(0,14)	
(262.251)	TRS JP Morgan Chase NA 0.125% 01-Jan-2023	(255.710)	(0,27)	
7.299	TRS Stem Inc 0.500% 01-Dec-2028	(65.965)	(0,07)	
(43.283)	TRS Unity Software Inc 0.000% 15-Nov-2026	(219.177)	(0,23)	
37.367	TRS Coupa Software Inc 0.375% 15-Jun-2026	(33.055)	(0,04)	
(23.671)	TRS Sea Ltd 0.250% 15-Sep-2026	(220.000)	(0,23)	
(8.410)	TRS Radius Global Infrastructure Inc 2.500% 15-Sep-2026	(4.249)	0,00	
(69.305)	TRS Cable One Inc 0.000% 15-Mar-2026	(146.513)	(0,15)	
(374.602)	TRS Upstart Holdings Inc 0.250% 15-Aug-2026	(416.866)	(0,44)	
(633.094)	TRS CyberArk Software Ltd 0.000% 15-Nov-2024	(90.552)	(0,10)	
(253.061)	TRS Cloudflare Inc 0.000% 15-Aug-2026	(102.600)	(0,11)	
(345.827)	TRS SoFi Technologies Inc 0.000% 15-Oct-2026	(204.811)	(0,22)	
<b>Total Return Swaps insgesamt</b>		<b>(3.468.234)</b>	<b>(3,65)</b>	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Offene Terminkontrakte - (15.470)</b>					
<b>(31. Dezember 2020: (24.136))</b>					
(44)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(5.042.267)	(15.465)	(0,01)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrundeliegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
	<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>			
(5)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(958.154)	(5)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(15.470)</b>	<b>(0,01)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (37.677) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (26.326))			(37.677)	(0,04)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(12.168.583)</b>	<b>(12,79)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>1.626.388</b>	<b>1,71</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>95.148.164</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Aktien-Swaps ist BNP Paribas.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.  
Der Kontrahent für Total Return Swaps ist BNP Paribas.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	83,73
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,00
Derivative OTC-Finanzinstrumente	12,84
Sonstiges Umlaufvermögen	3,43
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Euro	US-Dollar	881.157	1.000.000	10. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	3.954	
						<b>EUR</b>	<b>3.954</b>

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse CHF F (Acc) (Hedged)							
Schweizer Franken	Euro	11.261	10.796	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	60	
Schweizer Franken	Euro	1.222.030	1.168.847	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9.191	
						<b>EUR</b>	<b>9.251</b>
						<b>CHF</b>	<b>9.597</b>

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse CHF U (Acc) (Hedged)							
Schweizer Franken	Euro	3.502	3.367	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9	
Schweizer Franken	Euro	352	338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Schweizer Franken	Euro	9.021	8.640	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	55	
Schweizer Franken	Euro	4.537.646	4.340.168	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	34.128	
Schweizer Franken	Euro	3.010	2.894	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8	
Schweizer Franken	Euro	412.999	396.429	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.702	
Schweizer Franken	Euro	61.000	58.547	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	257	
Schweizer Franken	Euro	6.900.000	6.641.260	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	10.347	
Schweizer Franken	Euro	7.563	7.261	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	29	
Schweizer Franken	Euro	6.988	6.696	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40	
Schweizer Franken	Euro	21.471	20.645	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	53	
Schweizer Franken	Euro	4.502	4.320	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	19	
						<b>EUR</b>	<b>46.649</b>
						<b>CHF</b>	<b>48.394</b>
Euro	Schweizer Franken	3.366	3.502	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)	
						<b>EUR</b>	<b>(10)</b>
						<b>CHF</b>	<b>(10)</b>

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse Sterling F (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	38.114	31.970	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	106
Pfund Sterling	Euro	32.565	38.581	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	126
Pfund Sterling	Euro	36.540	43.253	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	179
Pfund Sterling	Euro	25.170	29.796	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	121
Pfund Sterling	Euro	74.588	87.883	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	773
Pfund Sterling	Euro	159.893	187.968	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.084
Pfund Sterling	Euro	23.718	27.763	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	429
Pfund Sterling	Euro	49.283	58.017	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	562
Pfund Sterling	Euro	37.140	43.642	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	503
Pfund Sterling	Euro	24.264	28.491	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	349
Pfund Sterling	Euro	101.400	119.061	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.464
Pfund Sterling	Euro	1.485	1.737	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	28
Pfund Sterling	Euro	28.705	33.584	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	535
Pfund Sterling	Euro	9.970	11.615	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	236

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse Sterling F (Acc) (Hedged) Forts.**

Pfund Sterling	Euro	14.198.707	16.578.385	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	298.390
						<b>EUR 305.885</b>
						<b>GBP 257.287</b>
Euro	Pfund Sterling	38.587	32.565	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(130)
Euro	Pfund Sterling	8.953	7.652	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(143)
Euro	Pfund Sterling	32.871	27.961	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(364)
Euro	Pfund Sterling	15.021	12.783	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(173)
Euro	Pfund Sterling	22.101	18.863	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(320)
Pfund Sterling	Euro	31.970	38.108	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(108)
						<b>EUR (1.238)</b>
						<b>GBP (1.041)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse Sterling U (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	100.551	117.403	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.113
						<b>EUR 2.113</b>
						<b>GBP 1.777</b>

**BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	405.656	474.608	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.561
Pfund Sterling	Euro	27.081.763	31.620.618	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	569.130
						<b>EUR 576.691</b>
						<b>GBP 485.067</b>
Euro	Pfund Sterling	73.051	62.000	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(643)
						<b>EUR (643)</b>
						<b>GBP (541)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse USD F (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	41.320	46.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	511
						<b>EUR 511</b>
						<b>USD 582</b>
US-Dollar	Euro	25.829	22.768	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(86)
US-Dollar	Euro	5.600.911	4.949.758	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(31.226)
						<b>EUR (31.312)</b>
						<b>USD (35.649)</b>

**BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilsklasse USD U (Acc) (Hedged)**

US-Dollar	Euro	802.450	709.158	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.474)
						<b>EUR (4.474)</b>
						<b>USD (5.094)</b>

# BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 2.177.219</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.430.638)</b>			
116.452	Allkem Ltd	878.049	1,49
6.168	CSL Ltd	1.299.170	2,21
<b>China - 22.258.056</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 27.034.106)</b>			
92.908	Alibaba Group Holding Ltd	1.415.955	2,41
11.484	Autohome Inc ADR	339.410	0,58
11.045	Bilibili Inc ADR	527.509	0,90
10.000.000	Boshiwa International Holding Ltd*	-	0,00
352.743	By-health Co Ltd	1.491.867	2,53
417.500	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	556.249	0,94
199.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	1.009.884	1,72
88.800	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	1.464.430	2,49
155.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	476.527	0,81
123.460	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	1.669.708	2,84
44.524	Meituan '144A'	1.287.473	2,19
207.460	NARI Technology Co Ltd 'A'	1.303.186	2,21
48.700	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	751.887	1,28
174.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	1.257.001	2,14
165.400	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1.780.424	3,03
11.000	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	657.547	1,12
47.800	Sungrow Power Supply Co Ltd	1.093.535	1,86
49.700	Tencent Holdings Ltd	2.910.614	4,95
134.293	Tencent Music Entertainment Group ADR	920.579	1,56
27.281	Yum China Holdings Inc	1.344.271	2,28
<b>Hongkong - 2.740.097</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.641.320)</b>			
216.600	AIA Group Ltd	2.183.818	3,71
275.083	Vitasoy International Holdings Ltd	556.279	0,95
<b>Indien - 17.233.333</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.018.444)</b>			
37.931	Asian Paints Ltd	1.726.934	2,94
78.600	Godrej Consumer Products Ltd	1.022.975	1,74
14.853	HDFC Asset Management Co Ltd '144A'	489.235	0,83
77.877	HDFC Bank Ltd	1.551.319	2,64
41.521	Hindustan Unilever Ltd	1.318.539	2,24
78.401	Housing Development Finance Corp Ltd	2.727.242	4,64
26.212	Info Edge India Ltd	1.965.495	3,34
24.540	Jubilant Foodworks Ltd	1.184.791	2,01
13.410	Maruti Suzuki India Ltd	1.338.733	2,28
47.748	PB Fintech Ltd	613.345	1,04
47.376	Tata Consultancy Services Ltd	2.382.625	4,05
26.915	Titan Co Ltd	912.100	1,55
<b>Indonesien - 903.771</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.223.612)</b>			
753.400	Bank Central Asia Tbk PT	386.545	0,66
1.795.800	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	517.226	0,88
<b>Niederlande - 1.703.630</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.027.154)</b>			
2.124	ASML Holding NV	1.703.630	2,89
<b>Neuseeland - 1.032.146</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.262.405)</b>			
10.013	Xero Ltd	1.032.146	1,75
<b>Philippinen - 11</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1	GT Capital Holdings Inc	11	0,00
<b>Republik Korea - 4.117.515</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.491.493)</b>			
1.523	LG Chem Ltd	788.565	1,34
541	LG Household & Health Care Ltd	499.017	0,85
13.688	Samsung Electronics Co Ltd	902.170	1,53
3.496	Samsung SDI Co Ltd	1.927.763	3,28

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Taiwan - 5.971.780</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.798.322)</b>			
75.000	Delta Electronics Inc	746.151	1,27
60.000	Elite Material Co Ltd	603.969	1,02
180.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	4.004.409	6,81
11.000	Voltronic Power Technology Corp	617.251	1,05
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>58.137.558</b>	<b>98,83</b>
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>58.137.558</b>	<b>98,83</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (61) (siehe unten) (31. Dezember 2020: 840)		(61)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(61)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>687.068</b>	<b>1,17</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>58.824.565</b>	<b>100,00</b>
* Die Gesellschaft unterliegt an der Hong Kong Stock Exchange einer Handelsaussetzung.			
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,00	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,00	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	



# BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Republik Korea - 194.610</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.073.801)</b>			
16.495	Macquarie Korea Infrastructure Fund	194.610	1,30
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>194.610</b>	<b>1,30</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 1.273.553</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.159.415)</b>			
50.201	Dexus (REIT)	405.812	2,71
139.238	Insurance Australia Group Ltd	431.551	2,88
83.086	Star Entertainment Grp Ltd/The	221.071	1,47
21.470	Transurban Group	215.119	1,44
<b>China - 842.361</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.777.024)</b>			
49.417	By-health Co Ltd	209.001	1,40
138.341	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	141.652	0,95
58.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	417.800	2,79
36.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	73.908	0,49
<b>Hongkong - 1.936.649</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.314.897)</b>			
41.000	AIA Group Ltd	413.373	2,76
8.700	ASM Pacific Technology Ltd	93.907	0,63
43.500	CLP Holdings Ltd	439.555	2,93
6.041	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	352.931	2,36
72.400	Link REIT (Units) (REIT)	636.883	4,25
<b>Indien - 1.152.308</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 943.031)</b>			
27.860	Infosys Ltd ADR	708.062	4,73
151.104	ITC Ltd GDR	444.246	2,96
<b>Indonesien - 762.736</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.056.408)</b>			
360.800	Bank Central Asia Tbk PT	185.115	1,23
1.138.495	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	327.909	2,19
879.856	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	249.712	1,67
<b>Neuseeland - 705.032</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.345.052)</b>			
18.763	Mercury NZ Ltd	78.125	0,52
59.087	Meridian Energy Ltd	196.377	1,31
85.842	SKYCITY Entertainment Group Ltd	182.380	1,22
79.615	Spark New Zealand Ltd	248.150	1,66
<b>Republik Korea - 1.436.637</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.906.886)</b>			
20.244	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	1.213.363	8,10
1.702	SK Square Co Ltd	95.140	0,63
2.633	SK Telecom Co Ltd	128.134	0,86
<b>Singapur - 2.587.373</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.801.117)</b>			
95.400	ComfortDelGro Corp Ltd	99.298	0,66
32.100	DBS Group Holdings Ltd	776.906	5,19
91.100	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	348.243	2,33
142.400	Singapore Technologies Engineering Ltd	396.127	2,64
24.700	United Overseas Bank Ltd	493.140	3,29
34.900	Venture Corp Ltd	473.659	3,16
<b>Taiwan - 2.627.833</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.007.474)</b>			
42.000	Delta Electronics Inc	417.844	2,79
35.000	Elite Material Co Ltd	352.315	2,35
31.000	ITEQ Corp	158.826	1,06
9.000	MediaTek Inc	386.291	2,58
59.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.312.557	8,76

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Thailand - 519.216</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.335.381)</b>			
79.800	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	289.650	1,94
54.100	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	229.566	1,53
<b>Vereinigtes Königreich - 612.953</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.020.085)</b>			
20.722	BHP Group Plc	612.953	4,09
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>14.456.651</b>	<b>96,51</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 15 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 13)		15	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>14.651.276</b>	<b>97,81</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (84))		(1)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(1)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>328.471</b>	<b>2,19</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>14.979.746</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
			<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			97,63
Derivative OTC-Finanzinstrumente			0,00
Sonstiges Umlaufvermögen			2,37
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

# BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 3.174.621</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 261.592)</b>			
46.896	ASX Ltd	3.174.621	3,34
<b>Kanada - 7.883.884</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
624.327	Hive Blockchain Technologies Ltd (Units)	1.636.147	1,72
239.311	Hut 8 Mining Corp (Units)	1.879.564	1,98
1.300	Shopify Inc - Class A	1.791.049	1,88
206.064	Voyager Digital Ltd	2.577.124	2,71
<b>Dänemark - 2.702.981</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 418.282)</b>			
751	AP Moller - Maersk A/S - Class B	2.702.981	2,84
<b>Frankreich - 3.486.394</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 375.293)</b>			
1.834	Kering SA	1.474.971	1,55
2.431	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.011.423	2,11
<b>Deutschland - 3.896.448</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 682.209)</b>			
24.180	Daimler AG	1.863.297	1,96
12.681	Daimler Truck Holding AG	466.470	0,49
18.091	Siemens AG ADR	1.566.681	1,65
<b>Italien - 1.197.309</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 489.076)</b>			
149.266	Enel SpA	1.197.309	1,26
<b>Japan - 3.134.652</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 118.445)</b>			
4.200	BayCurrent Consulting Inc	1.624.794	1,71
55.400	SBI Holdings Inc/Japan	1.509.858	1,58
<b>Republik Korea - 4.510.067</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
6.803	HYBE Co Ltd	1.998.694	2,10
26.478	Kakao Corp	2.511.373	2,64
<b>Singapur - 989.518</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 440.950)</b>			
143.000	Singapore Exchange Ltd	989.518	1,04
<b>Schweiz - 1.053.716</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 656.546)</b>			
1.717	Swiss Life Holding AG	1.053.716	1,11
<b>Taiwan - 883.593</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 259.176)</b>			
7.344	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	883.593	0,93
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 59.838.781</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.715.430)</b>			
114.650	Bakkt Holdings Inc	976.818	1,03
12.789	Block Inc	2.065.743	2,17
14.598	Coinbase Global Inc	3.683.075	3,87
2.712	CyberArk Software Ltd	469.908	0,49
46.858	DraftKings Inc - Class A	1.287.424	1,35
13.436	Enphase Energy Inc	2.458.452	2,58
5.323	EPAM Systems Inc	3.561.486	3,74
99.500	Figure Acquisition Corp I	1.003.458	1,06
62.121	Funko Inc - Class A	1.168.807	1,23
64.613	Galaxy Digital Holdings Ltd	1.160.526	1,22
10.152	GXO Logistics Inc	922.055	0,97
30.665	Marathon Digital Holdings Inc	1.006.732	1,06
5.271	Meta Platforms Inc - Class A	1.772.822	1,86
15.726	Metropolitan Bank Holding Corp	1.674.505	1,76
5.695	MicroStrategy Inc - Class A	3.099.475	3,26
7.997	Nasdaq Inc	1.679.690	1,77
13.532	NVIDIA Corp	3.980.709	4,18
11.218	Okta Inc	2.516.029	2,65

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
40.821	Overstock.com Inc	2.409.460	2,53
12.836	Quest Diagnostics Inc	2.221.976	2,34
20.419	Ribbit LEAP Ltd	209.805	0,22
25.198	ROBLOX Corp	2.600.308	2,73
9.588	salesforce.com Inc	2.436.119	2,56
12.082	Signature Bank/New York NY	3.909.373	4,11
27.255	Silvergate Capital Corp - Class A	4.032.377	4,24
6.171	Starbucks Corp	721.945	0,76
2.894	SVB Financial Group	1.963.926	2,06
18.169	Unity Software Inc	2.597.440	2,73
239.095	WisdomTree Investments Inc	1.462.066	1,54
10.152	XPO Logistics Inc	786.272	0,83
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>92.751.964</b>	<b>97,50</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 275.976 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 71.116)		275.976	0,29
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>93.027.940</b>	<b>97,79</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (51.332) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (322))		(51.332)	(0,05)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(51.332)</b>	<b>(0,05)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>2.148.745</b>	<b>2,26</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>95.125.353</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,03	
Derivative OTC-Finanzinstrumente		0,29	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,68	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	162	184	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	68	77	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	328	371	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	167	189	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	9.621	10.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	68
<b>USD</b>						<b>72</b>
<b>EUR</b>						<b>63</b>
US-Dollar	Euro	394	349	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	164	145	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	272	241	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	282	249	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	88	78	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	281	248	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	105	93	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>USD</b>						<b>(13)</b>
<b>EUR</b>						<b>(11)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	85.633	96.929	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	564
Euro	US-Dollar	118.286	133.907	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	764
Euro	US-Dollar	147.011	166.727	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	680
Euro	US-Dollar	3.265.005	3.691.758	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	26.222
Euro	US-Dollar	127.267	144.316	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	607
Euro	US-Dollar	343.368	388.756	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.249
Euro	US-Dollar	122.676	138.907	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	789
Euro	US-Dollar	217.822	246.816	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.226
Euro	US-Dollar	129.012	145.748	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.162
Euro	US-Dollar	114.105	128.568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.367
Euro	US-Dollar	494.549	560.915	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.246
Euro	US-Dollar	113.449	128.205	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	984
Euro	US-Dollar	271.202	307.658	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.170
Euro	US-Dollar	291.157	327.433	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.118
Euro	US-Dollar	298.863	337.287	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.039
Euro	US-Dollar	982.960	1.112.346	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.986
Euro	US-Dollar	329.467	371.981	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.194
Euro	US-Dollar	204.710	231.656	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.455
Euro	US-Dollar	141.771	160.817	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	622
Euro	US-Dollar	490.370	555.648	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.754
Euro	US-Dollar	134.026	152.270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	350
Euro	US-Dollar	24.674.395	27.923.701	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	173.934
<b>USD</b>						<b>236.482</b>
<b>EUR</b>						<b>207.713</b>
US-Dollar	Euro	388.664	343.368	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.261)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	138.877	122.676	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(793)
US-Dollar	Euro	307.171	271.835	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.378)
US-Dollar	Euro	37.571	33.257	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(300)
US-Dollar	Euro	260.312	230.942	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.670)
US-Dollar	Euro	46.843	41.573	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(498)
US-Dollar	Euro	26.937	23.837	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(207)
US-Dollar	Euro	841.400	743.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.318)
US-Dollar	Euro	686.938	605.540	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.612)
US-Dollar	Euro	90.576	80.541	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.139)
US-Dollar	Euro	809.530	717.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7.660)
US-Dollar	Euro	41.255	36.555	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(372)
US-Dollar	Euro	65.550	57.787	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(254)
US-Dollar	Euro	831.456	734.984	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.497)
US-Dollar	Euro	383.176	337.864	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.562)
US-Dollar	Euro	133.936	118.286	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(761)
US-Dollar	Euro	8.918	7.850	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)
US-Dollar	Euro	1.016.939	899.991	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7.913)
US-Dollar	Euro	8.908	7.878	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Euro	19.558	17.247	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(82)
US-Dollar	Euro	499.916	440.958	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.220)
US-Dollar	Euro	96.952	85.633	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(561)
US-Dollar	Euro	19.1103	169.261	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.641)
US-Dollar	Euro	7.239	6.389	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(36)
<b>USD</b>						<b>(46.818)</b>
<b>EUR</b>						<b>(41.122)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	182	206	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	76	86	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	367	416	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	187	212	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	10.771	12.189	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	76
<b>USD</b>						<b>81</b>
<b>EUR</b>						<b>71</b>
US-Dollar	Euro	441	391	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	184	162	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	305	270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	316	279	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	98	87	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	314	278	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts.</b>								
US-Dollar	Euro	117	104	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1)	
							<b>USD</b>	<b>(13)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(11)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	15.162	17.181	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		85	
Euro	US-Dollar	1.000	1.134	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		4	
Euro	US-Dollar	6.358	7.195	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		45	
Euro	US-Dollar	63.152	71.301	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		612	
Euro	US-Dollar	28.265	31.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		201	
Euro	US-Dollar	15.000	16.929	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		152	
Euro	US-Dollar	14.065	15.952	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		64	
Euro	US-Dollar	390.563	441.612	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3.137	
Euro	US-Dollar	1.000	1.136	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3	
Euro	US-Dollar	405.127	458.477	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.856	
							<b>USD</b>	<b>7.159</b>
							<b>EUR</b>	<b>6.288</b>
US-Dollar	Euro	15.296	13.492	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(68)	
US-Dollar	Euro	16.639	14.725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(129)	
US-Dollar	Euro	22.943	20.338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(217)	
US-Dollar	Euro	23.783	21.018	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(150)	
US-Dollar	Euro	7.384	6.551	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(76)	
US-Dollar	Euro	23.672	20.925	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(156)	
US-Dollar	Euro	8.807	7.794	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(68)	
							<b>USD</b>	<b>(864)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(759)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)</b>								
Pfund Sterling	US-Dollar	16.017	21.482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		197	
Pfund Sterling	US-Dollar	6.733	9.029	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		85	
Pfund Sterling	US-Dollar	32.509	43.334	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		668	
Pfund Sterling	US-Dollar	16.529	22.044	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		329	
Pfund Sterling	US-Dollar	952.447	1.258.250	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		30.903	
							<b>USD</b>	<b>32.182</b>
							<b>GBP</b>	<b>23.776</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	19.151	14.172	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(31)	
US-Dollar	Pfund Sterling	45.395	34.346	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.094)	
US-Dollar	Pfund Sterling	31.805	24.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(698)	
US-Dollar	Pfund Sterling	32.787	24.678	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(615)	
US-Dollar	Pfund Sterling	10.075	7.618	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(235)	
US-Dollar	Pfund Sterling	32.547	24.569	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(708)	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.</b>								
US-Dollar	Pfund Sterling	12.155	9.160	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(243)	
							<b>USD</b>	<b>(3.624)</b>
							<b>GBP</b>	<b>(2.677)</b>

# BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Grundstoffe - 6.828.200</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.143.709)</b>			
103.373	Gerdau SA - Preference	505.822	1,19
276.700	Gerdau SA ADR	1.351.680	3,17
79.036	Suzano SA	853.007	2,00
286.397	Vale SA	4.012.129	9,41
7.500	Vale SA ADR - Class B	105.562	0,25
<b>Kommunikation - 3.722.746</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.799.086)</b>			
271.355	Americanas SA	1.534.593	3,60
21.585	Telefonica Brasil SA	186.999	0,44
107.040	Telefonica Brasil SA ADR	924.290	2,17
455.785	TIM SA/Brazil	1.076.864	2,53
<b>Zyklische Konsumgüter - 5.233.453</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.452.448)</b>			
319.477	Atacadao SA	873.543	2,05
402.523	C&A Modas Ltda	446.244	1,05
224.705	Cia Brasileira de Distribuicao	878.044	2,06
134.900	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	530.157	1,25
452.100	Lojas Americanas SA - Preference	478.479	1,12
692.589	Sendas Distribuidora SA	1.612.104	3,78
35.100	Sendas Distribuidora SA ADR	414.882	0,97
<b>Bildung - 768.111</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 961.387)</b>			
208.143	YDUQS Participacoes SA	768.111	1,80
<b>Energie - 5.447.384</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.950.631)</b>			
304.692	Petroleo Brasileiro SA - Preference	1.556.555	3,65
168.321	Petroleo Brasileiro SA ADR	1.850.690	4,34
71.650	Petroleo Brasileiro SA ADR	728.322	1,71
341.520	Vibra Energia SA	1.311.817	3,08
<b>Finanzwerte - 8.362.331</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.809.592)</b>			
781.334	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.562.668	3,67
51.843	Banco Bradesco SA - Preference	178.751	0,42
544.576	Banco Bradesco SA ADR	1.859.727	4,36
347.664	Banco do Brasil SA	1.801.049	4,22
204.065	Bradespar SA - Preference	915.362	2,15
304.754	Itau Unibanco Holding SA - Preference	1.145.974	2,69
240.000	Itau Unibanco Holding SA ADR	898.800	2,11
<b>Lebensmittelverarbeiter - 1.656.550</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.676.508)</b>			
417.605	Marfrig Global Foods SA	1.656.550	3,89
<b>Gesundheitswesen - 2.438.225</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.339.807)</b>			
601.511	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	1.120.409	2,63
49.973	Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	403.776	0,95
185.202	Sul America SA (Units)	914.040	2,14
<b>Industrie - 3.457.551</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.676.681)</b>			
7.217	Embraer SA	32.166	0,07
110.630	Embraer SA ADR	1.958.704	4,60
1.271.504	Santos Brasil Participacoes SA	1.466.681	3,44
<b>Einkaufszentren - 1.040.066</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.710.911)</b>			
697.552	BR Malls Participacoes SA	1.040.066	2,44
<b>Versorger - 3.117.035</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.803.247)</b>			
442.237	AES Brasil Energia SA	878.519	2,06
190.700	Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	736.267	1,73
80.664	Cia Paranaense de Energia ADR	455.348	1,07
63.956	CPFL Energia SA	308.126	0,72

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Versorger Forts.</b>			
49.834	Engie Brasil Energia SA	343.917	0,81
187.100	Light SA	394.858	0,93
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>42.071.652</b>	<b>98,72</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.996 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 103.507)		3.996	0,01
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>42.075.648</b>	<b>98,73</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.787) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (4.186))		(1.787)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(1.787)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>542.378</b>	<b>1,27</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>42.616.239</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
<b>% des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			91,45
Derivative OTC-Finanzinstrumente			0,01
Sonstiges Umlaufvermögen			8,54
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	46	52	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	1.009.997	1.143.001	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	631	
Euro	US-Dollar	12.246	13.858	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8	
Euro	US-Dollar	6.494	7.349	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	US-Dollar	4	5	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	12.012	13.594	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8	
Euro	US-Dollar	5	6	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	8.818	9.965	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	20	
US-Dollar	Euro	127.520	112.417	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	229	
US-Dollar	Euro	52	46	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Euro	10.238	9.031	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13	
<b>USD</b>						<b>913</b>	
<b>EUR</b>						<b>807</b>	
US-Dollar	Euro	30.102	26.640	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(63)	
US-Dollar	Euro	32.123	28.476	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(121)	
US-Dollar	Euro	5.663	5.008	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	7.820	6.938	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(36)	
US-Dollar	Euro	8.275	7.325	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(19)	
US-Dollar	Euro	19.437	17.181	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18)	
<b>USD</b>						<b>(266)</b>	
<b>EUR</b>						<b>(235)</b>	
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	4.536.021	5.133.358	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.833	
Euro	US-Dollar	55.552	62.865	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	38	
Euro	US-Dollar	29.514	33.399	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	20	
Euro	US-Dollar	54.604	61.792	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36	
Euro	US-Dollar	39.725	44.892	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	90	
US-Dollar	Euro	53.621	47.297	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	66	
<b>USD</b>						<b>3.083</b>	
<b>EUR</b>						<b>2.723</b>	
Euro	US-Dollar	229.068	259.789	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(412)	
US-Dollar	Euro	135.051	119.520	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(283)	
US-Dollar	Euro	144.992	128.532	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(546)	
US-Dollar	Euro	25.491	22.546	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38)	
US-Dollar	Euro	35.255	31.278	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(161)	
US-Dollar	Euro	86.881	76.800	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(81)	
<b>USD</b>						<b>(1.521)</b>	
<b>EUR</b>						<b>(1.344)</b>	

# BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND\*

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 21.154.917</b>				
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022		1.700.000	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jan-2022		1.699.994	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022		1.699.975	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Feb-2022		1.699.947	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022		1.699.945	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022		1.699.807	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022		1.699.804	6,87
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022		1.699.649	6,86
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022		1.699.613	6,86
2.459.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-May-2022		2.458.138	9,93
3.400.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022		3.398.045	13,73
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>			<b>21.154.917</b>	<b>85,47</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien-Swaps</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 18</b>				
(16.791)	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSCA Index 11-Dec-2024		18	0,00
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps</b>			<b>18</b>	<b>0,00</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps - 921.017</b>				
(2.600.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 37 5.000% 20-Dec-2026		239.286	0,97
(6.500.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 1.000% 20-Dec-2026		158.783	0,64
(5.800.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026		172.035	0,69
(2.600.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026		350.913	1,42
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>			<b>921.017</b>	<b>3,72</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 345.671</b>				
2	AEX Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022	363.268	10.167	0,04
(7)	BOVESPA Index Short Futures Contracts Exp Feb-2022	(132.981)	6.117	0,02
8	CAC 40 10 Euro Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022	650.585	21.269	0,09
25	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.818.689	18.638	0,08
(5)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Apr-2022	(123.457)	7.580	0,03
(10)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Feb-2022	(219.705)	20.269	0,08
(16)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(314.792)	55.066	0,22
(6)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(140.811)	13.073	0,05
3	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	713.775	19.712	0,08
2	E-mini S&P MidCap 400 Long Futures Contracts Exp Mar-2022	567.540	19.106	0,08
11	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	536.945	16.583	0,07
(50)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(6.377.313)	1.567	0,01
7	FTSE 100 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	693.938	20.402	0,08
4	FTSE MIB Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	620.437	16.677	0,07

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>				
7	FTSE/JSE Africa Top 40 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	294.286	8.051	0,03
(1)	FTSE-Xinhua China A50 Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(15.699)	35	0,00
7	IBEX 35 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022	692.104	4.308	0,02
2	NASDAQ 100 E-Mini Long Futures Contracts Exp Mar-2022	652.830	16.022	0,07
17	OMX Stockholm 30 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022	455.139	18.845	0,08
4	S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	810.087	20.660	0,08
5	SGX FTSE Taiwan Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022	320.700	1.588	0,01
53	South Korea Three Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	4.864.631	456	0,00
7	SPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	935.430	15.516	0,06
23	Three Month Canadian Bankers' Acceptance Rate Long Futures Contracts Exp Dec-2022	4.465.631	2.482	0,01
14	Three Month SONIA Index Long Futures Contracts Exp Dec-2022	4.686.027	2.826	0,01
4	TOPIX Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	692.689	1.554	0,01
9	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.443.938	3.547	0,01
4	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	788.500	3.555	0,01
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>345.671</b>	<b>1,40</b>

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 249.524 (siehe unten)

		249.524	1,01
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>22.671.147</b>	<b>91,60</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien-Swaps</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - (6.255)</b>				
26.846	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSCA Index 11-Dec-2024		(6.255)	(0,03)
<b>Gesamtanlagen in Aktien-Swaps</b>			<b>(6.255)</b>	<b>(0,03)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (120.124)</b>				
27	3-Month Sterling Long Futures Contracts Exp Dec-2022	4.513.676	(4.573)	(0,02)
4	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	448.560	(3.152)	(0,01)
5	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022	758.469	(553)	(0,00)
4	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2022	669.484	(7.314)	(0,03)
2	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	390.210	(1.300)	(0,01)
1	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	235.374	(12.912)	(0,05)
17	Eurodollar Long Futures Contracts Exp Dec-2022	4.205.587	(1.108)	(0,00)
1	Euro-OAT Long Futures Contracts Exp Mar-2022	185.746	(627)	(0,00)
(5)	Hang Seng China Enterprises Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(265.051)	(2.466)	(0,01)
6	Japanese 10 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	7.906.981	(24.808)	(0,10)
4	KOSPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	331.651	(2.118)	(0,01)
25	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.531.281	(16.571)	(0,07)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrundeliegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>				
83	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	6.893.145	(10.755)	(0,04)
(1)	SGX MSCI Singapore Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(25.241)	(138)	(0,00)
(3)	SGX Nifty50 Short Futures Contracts Exp Jan-2022	(104.637)	(659)	(0,00)
16	South Korea Ten Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.672.749	(13.661)	(0,06)
16	Three Month EURIBOR Long Futures Contracts Exp Dec-2022	4.568.349	(2.078)	(0,01)
13	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.696.094	(6.259)	(0,03)
51	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	11.126.765	(6.337)	(0,03)
36	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	4.355.156	(2.735)	(0,01)

**Offene Terminkontrakte insgesamt** (120.124) (0,49)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (182.082) (siehe unten) (182.082) (0,74)

**Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt** (308.461) (1,26)

**Nettoumlaufvermögen** 2.388.319 9,66

**Summe Nettovermögen** 24.751.005 100,00

– Wird von Goldman Sachs als Sicherheit in Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Terminkontrakten gehalten.

\*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der Kontrahent für Aktien-Swaps ist Goldman Sachs.

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Goldman Sachs.

**Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	81,42
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,33
Derivative OTC-Finanzinstrumente	4,51
Sonstiges Umlaufvermögen	12,74
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund</b>						
Australischer Dollar	US-Dollar	300.000	217.640	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	664
Brasilianischer Real	US-Dollar	600.000	105.254	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	611
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.500.000	263.250	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	1.412
Tschechische Krone	US-Dollar	15.000.000	673.970	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	7.903
Euro	US-Dollar	200.000	226.956	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	1.075
Indische Rupie	US-Dollar	40.100.000	530.353	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	3.375
Indische Rupie	US-Dollar	128.700.000	1.685.934	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	27.052
Indonesische Rupiah	US-Dollar	237.10.800.000	1.633.538	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	20.836
Israelischer Scheqel	US-Dollar	800.000	253.107	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	4.366
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	2.800.000	661.782	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	9.600
Mexikanischer Peso	US-Dollar	5.800.000	275.013	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	4.738
Mexikanischer Peso	US-Dollar	10.600.000	495.815	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	15.454
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	3.400.000	209.748	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	1.492
Schweizer Franken	US-Dollar	1.600.000	1.747.267	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	11.896
Türkische Lira	US-Dollar	9.800.000	672.098	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	24.949
US-Dollar	Ungarischer Forint	192.775	62.900.000	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	298
US-Dollar	Japanischer Yen	344.951	39.400.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	2.229
US-Dollar	Japanischer Yen	1.429.189	162.000.000	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	20.027
US-Dollar	Koreanischer Won	412.760	486.500.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	4.338
US-Dollar	Philippinischer Peso	260.103	13.400.000	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	863
US-Dollar	Philippinischer Peso	406.151	20.600.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	7.617
US-Dollar	Philippinischer Peso	389.913	20.100.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	1.052
US-Dollar	Russischer Rubel	259.459	19.500.000	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	2.765
US-Dollar	Türkische Lira	485.850	6.000.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	59.086
US-Dollar	Türkische Lira	284.938	3.800.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	14.654
						<b>USD 248.352</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	34.800.000	302.965	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(256)
Philippinischer Peso	US-Dollar	20.000.000	398.867	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	(11.941)
Philippinischer Peso	US-Dollar	43.600.000	860.215	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(16.716)
Philippinischer Peso	US-Dollar	35.200.000	692.777	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(11.787)
Russischer Rubel	US-Dollar	19.500.000	260.069	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(3.375)
Russischer Rubel	US-Dollar	38.200.000	507.601	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	(4.743)
Russischer Rubel	US-Dollar	16.500.000	218.341	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	(1.138)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.001.101	1.400.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(17.652)
US-Dollar	Australischer Dollar	216.103	300.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(2.201)
US-Dollar	Brasilianischer Real	279.574	1.600.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(2.732)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	865.493	1.100.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(3.982)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	551.005	700.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(2.297)
US-Dollar	Tschechische Krone	154.546	3.500.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(4.558)
US-Dollar	Euro	2.036.374	1.800.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(15.906)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	135.493	200.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(1.332)
US-Dollar	Norwegische Krone	608.421	5.500.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(15.294)
US-Dollar	Polnischer Zloty	219.744	900.000	16. Mrz. 22	Morgan Stanley	(2.446)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.188.518	900.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(29.297)
US-Dollar	Schwedische Krone	1.201.246	10.900.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(5.712)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.950.346	1.800.000	16. Mrz. 22	Bank of America Merrill Lynch	(28.711)
						<b>USD (182.076)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	9.815	11.107	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) Forts.**

Euro	US-Dollar	83	94	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	53	60	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Euro	69	61	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>USD</b>	<b>70</b>
						<b>EUR</b>	<b>61</b>

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	9.813	11.106	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69	
Euro	US-Dollar	83	94	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	52	59	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Euro	69	61	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>USD</b>	<b>70</b>
						<b>EUR</b>	<b>61</b>

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	54	61	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	9.816	11.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69	
Euro	US-Dollar	84	95	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
US-Dollar	Euro	68	61	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>USD</b>	<b>70</b>
						<b>EUR</b>	<b>61</b>

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	55	74	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	9.816	12.967	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	319	
Pfund Sterling	US-Dollar	84	111	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
						<b>USD</b>	<b>321</b>
						<b>GBP</b>	<b>237</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	80	60	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
						<b>USD</b>	<b>(2)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(1)</b>

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	54	73	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	9.814	12.965	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	318	
Pfund Sterling	US-Dollar	84	111	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
						<b>USD</b>	<b>320</b>
						<b>GBP</b>	<b>236</b>

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Pfund Sterling	80	60	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
						<b>USD</b>	<b>(2)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(1)</b>

**BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	56	75	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	9.817	12.970	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	319	
Pfund Sterling	US-Dollar	85	112	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
						<b>USD</b>	<b>321</b>
						<b>GBP</b>	<b>237</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	80	60	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
						<b>USD</b>	<b>(2)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(1)</b>

# BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>				<b>Aktien Forts.</b>			
	<b>Staatsanleihen - 34.994.461</b>			<b>Kommunikation Forts.</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 41.029.117)</b>	<b>34.994.461</b>	<b>5,42</b>	5.091	News Corp	113.606	0,02
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022	3.000.000	0,47	1.474	News Corp	33.172	0,01
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	2.999.955	0,47	8.356	NortonLifeLock Inc	217.047	0,03
9.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	8.999.708	1,39	3.059	Omnicom Group Inc	224.118	0,03
6.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022	5.999.320	0,93	7.999	T-Mobile US Inc	927.764	0,14
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022	2.999.654	0,47	10.883	Twitter Inc	470.309	0,07
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022	2.999.317	0,46	1.339	VeriSign Inc	339.985	0,05
5.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022	4.998.232	0,77	56.464	Verizon Communications Inc	2.934.152	0,45
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022	2.998.275	0,46	8.429	ViacomCBS Inc - Class B	254.345	0,04
	<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>	<b>34.994.461</b>	<b>5,42</b>	24.782	Walt Disney Co/The	3.838.856	0,59
<b>Aktien</b>				<b>Zyklische Konsumgüter - 56.715.378</b>			
	<b>Grundstoffe - 11.561.205</b>			<b>(31. Dezember 2020: 44.942.517)</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 9.840.793)</b>	<b>11.561.205</b>	<b>1,79</b>	930	Advance Auto Parts Inc	223.065	0,03
3.019	Air Products & Chemicals Inc	918.697	0,14	1.546	Alaska Air Group Inc	80.554	0,01
1.595	Albemarle Corp	372.752	0,06	8.315	American Airlines Group Inc	149.379	0,02
1.561	Celanese Corp - Class A	262.435	0,04	3.689	Aptiv Plc	608.464	0,09
2.789	CF Industries Holdings Inc	197.391	0,03	294	AutoZone Inc	616.517	0,10
10.171	Dow Inc	576.848	0,09	3.671	Bath & Body Works Inc	256.217	0,04
7.134	DuPont de Nemours Inc	576.249	0,09	3.104	Best Buy Co Inc	315.382	0,05
1.929	Eastman Chemical Co	233.216	0,04	3.115	BorgWarner Inc	140.393	0,02
3.395	Ecolab Inc	796.263	0,12	2.984	Caesars Entertainment Inc	279.049	0,04
1.671	FMC Corp	183.668	0,03	2.236	CarMax Inc	291.205	0,04
20.022	Freeport-McMoRan Inc	835.418	0,13	11.338	Carnival Corp	228.177	0,04
3.397	International Flavors & Fragrances Inc	511.690	0,08	383	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	669.574	0,10
5.476	International Paper Co	257.345	0,04	2.904	Copart Inc	440.116	0,07
7.043	Linde Plc	2.439.590	0,38	6.029	Costco Wholesale Corp	3.422.844	0,53
3.633	LyondellBasell Industries NV	335.053	0,05	1.959	Cummins Inc	427.248	0,07
5.347	Mosaic Co/The	210.110	0,03	1.816	Darden Restaurants Inc	273.553	0,04
10.899	Newmont Corp	675.902	0,10	8.857	Delta Air Lines Inc	346.176	0,05
4.005	Nucor Corp	457.131	0,07	3.221	Dollar General Corp	759.625	0,12
3.237	PPG Industries Inc	558.043	0,09	3.163	Dollar Tree Inc	444.544	0,07
3.304	Sherwin-Williams Co/The	1.163.404	0,18	514	Domino's Pizza Inc	290.063	0,04
	<b>Kommunikation - 83.693.222</b>			4.445	DR Horton Inc	482.171	0,07
	<b>(31. Dezember 2020: 75.281.178)</b>	<b>83.693.222</b>	<b>12,96</b>	7.838	Fastenal Co	502.220	0,08
3.843	Alphabet Inc	11.123.160	1,72	53.515	Ford Motor Co	1.111.239	0,17
4.106	Alphabet Inc - Class A	11.897.320	1,84	2.761	Gap Inc/The	48.718	0,01
5.976	Amazon.com Inc	19.929.273	3,09	19.799	General Motors Co	1.160.617	0,18
3.055	Arista Networks Inc	439.141	0,07	1.999	Genuine Parts Co	280.350	0,04
97.377	AT&T Inc	2.395.961	0,37	1.658	Hasbro Inc	168.701	0,03
560	Booking Holdings Inc	1.344.218	0,21	3.801	Hilton Worldwide Holdings Inc	592.861	0,09
1.876	CDW Corp/DE	384.242	0,06	14.501	Home Depot Inc/The	6.017.697	0,93
1.730	Charter Communications Inc	1.128.323	0,17	4.419	Las Vegas Sands Corp	166.309	0,03
57.893	Cisco Systems Inc/Delaware	3.668.969	0,57	3.746	Lennar Corp	435.154	0,07
62.467	Comcast Corp	3.145.213	0,49	1.886	Live Nation Entertainment Inc	225.972	0,03
10.483	Corning Inc	390.335	0,06	3.485	LKQ Corp	209.152	0,03
3.869	Discovery Inc	88.619	0,01	9.641	Lowe's Cos Inc	2.493.355	0,39
2.186	Discovery Inc	51.448	0,01	3.731	Marriott International Inc/MD	616.697	0,10
3.225	DISH Network Corp - Class A	104.635	0,02	10.185	McDonald's Corp	2.729.835	0,42
8.866	eBay Inc	589.678	0,09	5.659	MGM Resorts International	254.004	0,04
1.726	Etsy Inc	377.873	0,06	722	Mohawk Industries Inc	131.588	0,02
1.995	Expedia Group Inc	360.616	0,06	4.920	Newell Brands Inc	107.428	0,02
773	F5 Inc	189.223	0,03	17.431	NIKE Inc	2.905.573	0,45
516	FactSet Research Systems Inc	250.877	0,04	4.760	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	98.746	0,02
1.860	Fox Corp	63.751	0,01	43	NVR Inc	253.974	0,04
4.751	Fox Corp	175.336	0,03	940	O'Reilly Automotive Inc	663.969	0,10
5.054	Interpublic Group of Cos Inc/The	189.247	0,03	4.735	PACCAR Inc	418.053	0,06
4.690	Juniper Networks Inc	167.456	0,03	2.070	Penn National Gaming Inc	107.340	0,02
12.901	Lumen Technologies Inc	161.843	0,02	553	Pool Corp	313.114	0,05
3.775	Match Group Inc	499.508	0,08	3.722	PulteGroup Inc	212.731	0,03
32.511	Meta Platforms Inc - Class A	10.934.587	1,69	929	PVH Corp	99.083	0,02
2.309	Motorola Solutions Inc	627.228	0,10	632	Ralph Lauren Corp - Class A	75.120	0,01
6.077	Netflix Inc	3.661.788	0,57	4.871	Ross Stores Inc	556.755	0,09
				3.165	Royal Caribbean Cruises Ltd	243.373	0,04
				8.110	Southwest Airlines Co	347.392	0,05
				16.081	Starbucks Corp	1.881.316	0,29
				3.618	Tapestry Inc	146.909	0,02
				6.747	Target Corp	1.561.762	0,24
				11.146	Tesla Inc	11.782.046	1,82
				16.454	TJX Cos Inc/The	1.249.517	0,19
				1.561	Tractor Supply Co	372.494	0,06

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
713	Ulta Beauty Inc	294.055	0,05
2.673	Under Armour Inc	48.208	0,01
2.297	Under Armour Inc - Class A	48.685	0,01
4.647	United Airlines Holdings Inc	203.469	0,03
4.469	VF Corp	327.198	0,05
9.791	Walgreens Boots Alliance Inc	510.650	0,08
19.490	Walmart Inc	2.820.495	0,44
811	Whirlpool Corp	190.293	0,03
602	WW Grainger Inc	312.002	0,05
1.353	Wynn Resorts Ltd	115.039	0,02
4.032	Yum! Brands Inc	559.984	0,09
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter - 109.662.611</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 96.882.520)</b>			
		<b>109.662.611</b>	<b>16,98</b>
24.178	Abbott Laboratories	3.403.054	0,53
3.358	AbbVie Inc	454.690	0,07
20.934	AbbVie Inc	2.834.568	0,44
660	ABIOMED Inc	237.138	0,04
1.002	Align Technology Inc	658.865	0,10
25.150	Altria Group Inc	1.191.858	0,18
2.090	AmerisourceBergen Corp - Class A	277.834	0,04
7.745	Amgen Inc	1.742.896	0,27
3.325	Anthem Inc	1.541.503	0,24
7.629	Archer-Daniels-Midland Co	515.682	0,08
5.770	Automatic Data Processing Inc	1.423.142	0,22
1.166	Avery Dennison Corp	252.585	0,04
6.818	Baxter International Inc	585.223	0,09
3.917	Becton Dickinson and Co	985.126	0,15
2.033	Biogen Inc	487.890	0,08
306	Bio-Rad Laboratories Inc	231.308	0,04
546	Bio-Techne Corp	282.637	0,04
19.419	Boston Scientific Corp	824.822	0,13
30.306	Bristol-Myers Squibb Co	1.889.731	0,29
2.367	Brown-Forman Corp	172.471	0,03
2.642	Campbell Soup Co	114.808	0,02
4.173	Cardinal Health Inc	214.889	0,03
2.355	Catalent Inc	301.546	0,05
7.952	Centene Corp	655.285	0,10
703	Charles River Laboratories International Inc	264.957	0,04
3.361	Church & Dwight Co Inc	344.502	0,05
4.638	Cigna Corp	1.065.233	0,17
1.194	Cintas Corp	528.906	0,08
1.705	Clorox Co/The	297.335	0,05
53.403	Coca-Cola Co/The	3.162.259	0,49
11.504	Colgate-Palmolive Co	981.694	0,15
6.843	Conagra Brands Inc	233.654	0,04
2.295	Constellation Brands Inc - Class A	575.988	0,09
684	Cooper Cos Inc/The	286.668	0,04
10.013	Corteva Inc	473.465	0,07
17.997	CVS Health Corp	1.856.301	0,29
8.665	Danaher Corp	2.851.262	0,44
871	DaVita Inc	99.081	0,02
2.828	DENTSPLY SIRONA Inc	157.760	0,02
1.319	Dexcom Inc	708.560	0,11
8.501	Edwards Lifesciences Corp	1.100.879	0,17
10.828	Eli Lilly & Co	2.989.665	0,46
1.662	Equifax Inc	486.791	0,08
3.163	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	1.171.243	0,18
1.158	FleetCor Technologies Inc	259.311	0,04
1.141	Gartner Inc	381.607	0,06
8.269	General Mills Inc	557.124	0,09
17.100	Gilead Sciences Inc	1.241.802	0,19
4.006	Global Payments Inc	541.591	0,08
3.362	HCA Healthcare Inc	863.765	0,13
1.805	Henry Schein Inc	139.960	0,02
1.984	Hershey Co/The	383.934	0,06
3.544	Hologic Inc	271.364	0,04
3.656	Hormel Foods Corp	178.486	0,03
1.753	Humana Inc	813.076	0,13
1.160	IDEXX Laboratories Inc	764.017	0,12
5.436	IHS Markit Ltd	722.580	0,11

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
2.142	Illumina Inc	815.406	0,13
2.420	Incyte Corp	177.749	0,03
4.865	Intuitive Surgical Inc	1.747.386	0,27
2.613	IQVIA Holdings Inc	737.193	0,11
1.558	J M Smucker Co/The	211.600	0,03
36.071	Johnson & Johnson	6.169.403	0,96
3.609	Kellogg Co	232.510	0,04
4.593	Kimberly-Clark Corp	656.317	0,10
9.682	Kraft Heinz Co/The	347.729	0,05
9.274	Kroger Co/The	419.695	0,07
1.319	Laboratory Corp of America Holdings	414.450	0,06
1.902	Lamb Weston Holdings Inc	120.539	0,02
546	MarketAxess Holdings Inc	224.679	0,03
3.421	McCormick & Co Inc/MD	330.486	0,05
2.109	McKesson Corp	524.477	0,08
18.329	Medtronic Plc	1.896.227	0,29
34.524	Merck & Co Inc	2.646.092	0,41
4.789	Moderna Inc	1.216.789	0,19
2.452	Molson Coors Beverage Co - Class B	113.662	0,02
19.064	Mondelez International Inc	1.264.039	0,20
5.121	Monster Beverage Corp	491.718	0,08
2.209	Moody's Corp	862.592	0,13
4.676	Nielsen Holdings Plc	95.928	0,01
3.292	Organon & Co	100.241	0,02
16.025	PayPal Holdings Inc	3.022.635	0,47
18.850	PepsiCo Inc	3.274.622	0,51
1.729	PerkinElmer Inc	347.711	0,05
76.906	Pfizer Inc	4.540.915	0,70
21.256	Philip Morris International Inc	2.019.426	0,31
33.106	Procter & Gamble Co/The	5.415.148	0,84
1.976	Quanta Services Inc	226.598	0,04
1.704	Quest Diagnostics Inc	294.971	0,05
1.433	Regeneron Pharmaceuticals Inc	905.355	0,14
1.985	ResMed Inc	517.142	0,08
1.440	Robert Half International Inc	160.582	0,02
2.904	Rollins Inc	99.360	0,02
3.287	S&P Global Inc	1.550.987	0,24
1.375	STERIS Plc	334.538	0,05
4.577	Stryker Corp	1.224.142	0,19
6.977	Sysco Corp	548.078	0,08
666	Teleflex Inc	218.771	0,03
5.405	Thermo Fisher Scientific Inc	3.607.540	0,56
4.023	Tyson Foods Inc - Class A	350.625	0,05
992	United Rentals Inc	329.681	0,05
12.860	UnitedHealth Group Inc	6.458.163	1,00
1.113	Universal Health Services Inc	144.289	0,02
2.201	Verisk Analytics Inc - Class A	503.578	0,08
3.538	Vertex Pharmaceuticals Inc	777.051	0,12
9.720	Viatris Inc	131.560	0,02
7.512	Viatris Inc	101.675	0,02
787	Waters Corp	293.232	0,05
1.009	West Pharmaceutical Services Inc	473.211	0,07
2.855	Zimmer Biomet Holdings Inc	362.628	0,06
6.464	Zoetis Inc	1.577.119	0,24
<b>Energie - 15.289.769</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.521.426)</b>			
		<b>15.289.769</b>	<b>2,37</b>
4.930	APA Corp	132.592	0,02
11.437	Baker Hughes Co - Class A	275.117	0,04
26.375	Chevron Corp	3.094.974	0,48
18.263	ConocoPhillips	1.318.315	0,20
11.466	Coterra Energy Inc	217.797	0,03
8.587	Devon Energy Corp	378.214	0,06
2.380	Diamondback Energy Inc	256.635	0,04
1.836	Enphase Energy Inc	335.942	0,05
7.963	EOG Resources Inc	707.552	0,11
57.738	Exxon Mobil Corp	3.532.700	0,55
12.293	Halliburton Co	281.080	0,04
3.572	Hess Corp	264.435	0,04
26.584	Kinder Morgan Inc	421.755	0,07
11.492	Marathon Oil Corp	188.756	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
8.704	Marathon Petroleum Corp	556.925	0,09
12.098	Occidental Petroleum Corp	350.661	0,05
6.078	ONEOK Inc	357.174	0,06
5.973	Phillips 66	432.833	0,07
3.094	Pioneer Natural Resources Co	562.907	0,09
19.072	Schlumberger NV	571.302	0,09
720	SolarEdge Technologies Inc	201.917	0,03
5.576	Valero Energy Corp	418.786	0,06
16.570	Williams Cos Inc/The	431.400	0,07
<b>Finanzwerte - 80.253.840</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 66.953.330)</b>			
		<b>80.253.840</b>	<b>12,42</b>
8.416	Aflac Inc	491.452	0,08
1.891	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	421.646	0,07
4.033	Allstate Corp/The	474.422	0,07
8.776	American Express Co	1.435.622	0,22
11.663	American International Group Inc	662.983	0,10
6.207	American Tower Corp (REIT)	1.815.237	0,28
1.551	Ameriprise Financial Inc	467.867	0,07
2.242	Aon Plc	673.822	0,10
837	Aon Plc	251.556	0,04
2.820	Arthur J Gallagher & Co	478.568	0,07
870	Assurant Inc	135.603	0,02
1.904	AvalonBay Communities Inc (REIT)	480.969	0,07
98.680	Bank of America Corp	4.389.780	0,68
10.756	Bank of New York Mellon Corp/The	624.655	0,10
25.093	Berkshire Hathaway Inc - Class B	7.501.803	1,16
1.951	BlackRock Inc	1.785.711	0,28
2.015	Boston Properties Inc (REIT)	232.098	0,04
3.323	Brown & Brown Inc	233.557	0,04
6.084	Capital One Financial Corp	882.636	0,14
1.370	Cboe Global Markets Inc	178.511	0,03
4.579	CBRE Group Inc - Class A	497.005	0,08
20.474	Charles Schwab Corp/The	1.721.249	0,27
5.984	Chubb Ltd	1.156.677	0,18
2.111	Cincinnati Financial Corp	240.570	0,04
27.642	Citigroup Inc	1.668.886	0,26
5.906	Citizens Financial Group Inc	279.029	0,04
4.898	CME Group Inc	1.119.218	0,17
1.729	Comerica Inc	150.388	0,02
5.894	Crown Castle International Corp (REIT)	1.229.960	0,19
3.854	Digital Realty Trust Inc (REIT)	681.715	0,11
4.084	Discover Financial Services	471.906	0,07
5.208	Duke Realty Corp (REIT)	341.931	0,05
1.224	Equinix Inc (REIT)	1.035.461	0,16
4.647	Equity Residential (REIT)	420.623	0,07
894	Essex Property Trust Inc (REIT)	314.916	0,05
515	Everest Re Group Ltd	141.113	0,02
1.825	Extra Space Storage Inc (REIT)	413.919	0,06
921	Federal Realty Investment Trust (REIT)	125.574	0,02
9.420	Fifth Third Bancorp	410.194	0,06
2.405	First Republic Bank/CA	496.620	0,08
3.544	Franklin Resources Inc	118.635	0,02
1.164	Globe Life Inc	109.108	0,02
4.597	Goldman Sachs Group Inc/The	1.758.467	0,27
4.775	Hartford Financial Services Group Inc/The	329.762	0,05
7.560	Healthpeak Properties Inc (REIT)	272.803	0,04
10.378	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	180.525	0,03
19.155	Huntington Bancshares Inc/OH	295.274	0,05
7.680	Intercontinental Exchange Inc	1.050.509	0,16
4.439	Invesco Ltd	102.164	0,02
3.739	Iron Mountain Inc (REIT)	195.681	0,03
40.753	JPMorgan Chase & Co	6.452.626	1,00
13.217	KeyCorp	305.643	0,05
8.737	Kimco Realty Corp (REIT)	215.411	0,03
2.270	Lincoln National Corp	154.950	0,02
2.639	Loews Corp	152.389	0,02
1.789	M&T Bank Corp	274.719	0,04
6.910	Marsh & McLennan Cos Inc	1.200.889	0,19
11.881	Mastercard Inc	4.269.437	0,66
9.934	MetLife Inc	620.726	0,10

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
1.589	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	364.739	0,06
19.907	Morgan Stanley	1.953.673	0,30
1.608	Nasdaq Inc	337.744	0,05
2.883	Northern Trust Corp	344.720	0,05
5.531	People's United Financial Inc	98.535	0,02
5.796	PNC Financial Services Group Inc/The	1.162.214	0,18
3.506	Principal Financial Group Inc	253.642	0,04
7.981	Progressive Corp/The	819.529	0,13
10.082	Prologis Inc (REIT)	1.697.658	0,26
5.275	Prudential Financial Inc	570.992	0,09
2.079	Public Storage (REIT)	778.887	0,12
2.597	Raymond James Financial Inc	260.804	0,04
7.514	Realty Income Corp (REIT)	537.890	0,08
1.973	Regency Centers Corp (REIT)	148.685	0,02
13.227	Regions Financial Corp	288.282	0,04
1.494	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	581.427	0,09
831	Signature Bank/New York NY	268.887	0,04
4.482	Simon Property Group Inc (REIT)	716.112	0,11
4.987	State Street Corp	463.766	0,07
800	SVB Financial Group	542.896	0,08
7.770	Synchrony Financial	360.450	0,06
3.095	T Rowe Price Group Inc	608.709	0,09
3.403	Travelers Cos Inc/The	532.348	0,08
18.205	Truist Financial Corp	1.065.812	0,17
3.953	UDR Inc (REIT)	237.121	0,04
18.401	US Bancorp	1.033.492	0,16
5.499	Ventas Inc (REIT)	281.081	0,04
23.017	Visa Inc - Class A	4.987.439	0,77
1.949	Vornado Realty Trust (REIT)	81.595	0,01
1.820	W R Berkley Corp	149.923	0,02
54.632	Wells Fargo & Co	2.620.424	0,41
6.058	Welltower Inc (REIT)	519.564	0,08
10.226	Weyerhaeuser Co (REIT)	421.056	0,07
1.760	Willis Towers Watson Plc	418.088	0,07
2.383	Zions Bancorp NA	150.486	0,02
<b>Industrie - 41.624.992</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 38.232.010)</b>			
		<b>41.624.992</b>	<b>6,44</b>
7.892	3M Co	1.401.856	0,22
1.919	A O Smith Corp	164.804	0,03
4.138	Agilent Technologies Inc	660.859	0,10
1.166	Allegion plc	154.413	0,02
21.660	Amcor Plc	260.028	0,04
3.153	AMETEK Inc	463.712	0,07
8.158	Amphenol Corp - Class A	713.336	0,11
4.454	Ball Corp	428.675	0,07
7.514	Boeing Co/The	1.512.568	0,23
11.834	Carrier Global Corp	641.935	0,10
7.467	Caterpillar Inc	1.543.952	0,24
1.697	CH Robinson Worldwide Inc	182.623	0,03
30.747	CSX Corp	1.156.087	0,18
3.871	Deere & Co	1.327.579	0,21
1.964	Dover Corp	356.682	0,05
5.436	Eaton Corp Plc	939.694	0,15
8.153	Emerson Electric Co	758.025	0,12
2.364	Expeditors International of Washington Inc	317.544	0,05
3.354	FedEx Corp	867.462	0,13
4.888	Fortive Corp	372.881	0,06
1.769	Fortune Brands Home & Security Inc	189.088	0,03
2.110	Garmin Ltd	287.298	0,04
873	Generac Holdings Inc	307.231	0,05
3.164	General Dynamics Corp	659.678	0,10
14.970	General Electric Co	1.414.141	0,22
9.416	Honeywell International Inc	1.963.566	0,30
4.969	Howmet Aerospace Inc	158.138	0,02
501	Huntington Ingalls Industries Inc	93.539	0,01
1.068	IDEX Corp	252.278	0,04
3.909	Illinois Tool Works Inc	964.663	0,15
5.565	Ingersoll Rand Inc	344.334	0,05
1.825	Jacobs Engineering Group Inc	254.150	0,04
1.190	JB Hunt Transport Services Inc	243.266	0,04

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Industrie Forts.</b>			
9.714	Johnson Controls International plc	789.797	0,12
2.513	Keysight Technologies Inc	518.909	0,08
2.741	L3Harris Technologies Inc	584.505	0,09
3.361	Lockheed Martin Corp	1.194.483	0,18
851	Martin Marietta Materials Inc	374.814	0,06
3.489	Masco Corp	244.980	0,04
315	Mettler-Toledo International Inc	534.856	0,08
3.368	Norfolk Southern Corp	1.002.721	0,16
2.053	Northrop Grumman Corp	794.737	0,12
1.279	Old Dominion Freight Line Inc	458.400	0,07
5.821	Otis Worldwide Corp	506.864	0,08
1.223	Packaging Corp of America	166.481	0,03
1.760	Parker-Hannifin Corp	559.847	0,09
2.129	Pentair Plc	155.449	0,02
20.565	Raytheon Technologies Corp	1.769.515	0,27
2.866	Republic Services Inc - Class A	399.707	0,06
1.582	Rockwell Automation Inc	552.007	0,09
1.891	Sealed Air Corp	127.538	0,02
702	Snap-on Inc	151.249	0,02
2.223	Stanley Black & Decker Inc	419.269	0,06
4.473	TE Connectivity Ltd	721.741	0,11
605	Teledyne Technologies Inc	264.349	0,04
3.165	Textron Inc	244.401	0,04
3.241	Trane Technologies Plc	654.828	0,10
714	TransDigm Group Inc	454.372	0,07
3.458	Trimble Inc	301.589	0,05
8.894	Union Pacific Corp	2.240.354	0,35
9.933	United Parcel Service Inc - Class B	2.128.841	0,33
1.809	Vulcan Materials Co	375.431	0,06
5.284	Waste Management Inc	881.926	0,14
2.661	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	245.091	0,04
3.446	Westrock Co	152.847	0,02
2.476	Xylem Inc/NY	297.009	0,05
<b>Technologie - 140.405.254</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 107.396.896)</b>		<b>140.405.254</b>	<b>21,74</b>
8.649	Accenture Plc - Class A	3.585.659	0,56
10.607	Activision Blizzard Inc	705.631	0,11
6.537	Adobe Inc	3.708.048	0,57
16.543	Advanced Micro Devices Inc	2.380.951	0,37
2.278	Akamai Technologies Inc	266.537	0,04
7.336	Analog Devices Inc	1.289.816	0,20
1.190	ANSYS Inc	477.160	0,07
213.558	Apple Inc	37.928.969	5,87
12.465	Applied Materials Inc	1.961.305	0,30
3.001	Autodesk Inc	844.166	0,13
5.640	Broadcom Inc	3.753.307	0,58
1.606	Broadridge Financial Solutions Inc	293.641	0,05
3.775	Cadence Design Systems Inc	703.566	0,11
1.941	Ceridian HCM Holding Inc	202.786	0,03
4.086	Cerner Corp	379.569	0,06
1.609	Citrix Systems Inc	152.139	0,02
7.168	Cognizant Technology Solutions Corp	635.945	0,10
3.985	DXC Technology Co	128.297	0,02
3.881	Electronic Arts Inc	511.982	0,08
777	EPAM Systems Inc	519.871	0,08
8.424	Fidelity National Information Services Inc	919.859	0,14
8.128	Fiserv Inc	843.443	0,13
1.849	Fortinet Inc	664.752	0,10
18.123	Hewlett Packard Enterprise Co	285.709	0,04
16.383	HP Inc	616.902	0,10
55.817	Intel Corp	2.875.134	0,45
12.224	International Business Machines Corp	1.633.615	0,25
3.862	Intuit Inc	2.484.502	0,38
446	IPG Photonics Corp	76.766	0,01
962	Jack Henry & Associates Inc	160.587	0,02
2.083	KLA Corp	896.034	0,14
1.943	Lam Research Corp	1.397.697	0,22
1.822	Leidos Holdings Inc	161.948	0,02
7.475	Microchip Technology Inc	650.886	0,10
15.353	Micron Technology Inc	1.429.902	0,22

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Technologie Forts.</b>			
102.873	Microsoft Corp	34.592.589	5,36
598	Monolithic Power Systems Inc	295.206	0,05
1.124	MSCI Inc - Class A	688.658	0,11
2.874	NetApp Inc	264.437	0,04
34.255	NVIDIA Corp	10.076.793	1,56
3.616	NXP Semiconductors NV	823.942	0,13
22.466	Oracle Corp	1.959.148	0,30
4.368	Paychex Inc	596.341	0,09
669	Paycom Software Inc	277.806	0,04
1.362	PTC Inc	165.074	0,03
1.564	Qorvo Inc	244.586	0,04
15.384	QUALCOMM Inc	2.814.426	0,44
1.438	Roper Technologies Inc	707.302	0,11
13.414	salesforce.com Inc	3.408.229	0,53
2.886	Seagate Technology Holdings Plc	326.046	0,05
2.702	ServiceNow Inc	1.754.841	0,27
2.253	Skyworks Solutions Inc	349.598	0,05
2.081	Synopsys Inc	767.077	0,12
1.638	Take-Two Interactive Software Inc	291.187	0,05
2.253	Teradyne Inc	368.332	0,06
12.591	Texas Instruments Inc	2.373.844	0,37
564	Tyler Technologies Inc	303.460	0,05
4.295	Western Digital Corp	280.141	0,04
3.375	Xilinx Inc	715.601	0,11
728	Zebra Technologies Corp	433.509	0,07
<b>Versorger - 13.760.916</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.787.397)</b>		<b>13.760.916</b>	<b>2,13</b>
9.442	AES Corp/The	229.488	0,04
3.588	Alliant Energy Corp	220.572	0,03
3.601	Ameren Corp	320.507	0,05
6.823	American Electric Power Co Inc	607.145	0,09
2.475	American Water Works Co Inc	467.354	0,07
1.694	Atmos Energy Corp	177.506	0,03
8.404	CenterPoint Energy Inc	234.514	0,04
4.066	CMS Energy Corp	264.473	0,04
4.820	Consolidated Edison Inc	411.218	0,06
11.026	Dominion Energy Inc	866.147	0,13
2.661	DTE Energy Co	318.162	0,05
10.492	Duke Energy Corp	1.100.663	0,17
4.924	Edison International	336.137	0,05
2.766	Entergy Corp	311.521	0,05
3.270	Evergy Inc	224.322	0,04
4.687	Eversource Energy	426.540	0,07
13.336	Exelon Corp	770.821	0,12
7.497	FirstEnergy Corp	311.838	0,05
27.024	NextEra Energy Inc	2.523.096	0,39
5.038	NiSource Inc	139.124	0,02
3.177	NRG Energy Inc	136.881	0,02
1.467	Pinnacle West Capital Corp	103.563	0,02
10.582	PPL Corp	318.042	0,05
6.895	Public Service Enterprise Group Inc	460.138	0,07
4.355	Sempra Energy	576.188	0,09
14.441	Southern Co/The (Units)	990.291	0,15
4.302	WEC Energy Group Inc	417.617	0,06
7.343	Xcel Energy Inc	497.048	0,08
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>552.967.187</b>	<b>85,61</b>
<b>Indexoptionen - 19.386.988</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 855.113)</b>			
137	CME E-Mini S&P 500 Index Call 18-Mar-2022 3,900.000	6.016.013	0,93
137	CME E-Mini S&P W3 Index Call 14-Apr-2022 3,800.000	6.706.150	1,04
134	CME E-Mini S&P W3 Index Call 20-May-2022 3,800.000	6.664.825	1,03
<b>Indexoptionen insgesamt</b>		<b>19.386.988</b>	<b>3,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 2.927.226 (31. Dezember 2020: 881.377)</b>				
408	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	97.073.400	2.576.346	0,40
215	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	34.494.063	350.880	0,05
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>2.927.226</b>	<b>0,45</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 40.477 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 225.847)			40.477	0,01
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>610.316.339</b>	<b>94,49</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (37) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (8.127))			(37)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(37)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>35.607.812</b>	<b>5,51</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>645.924.114</b>	<b>100,00</b>
Der Kontrahent für Indexoptionen ist Citigroup Global Markets Limited. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.				
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>		
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		89,70		
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		3,40		
Derivative OTC-Finanzinstrumente		0,01		
Sonstiges Umlaufvermögen		6,89		
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>		

<b>Devisenterminkontrakte</b>							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>							
Euro	US-Dollar	5.150.000	5.823.311	5. Jan. 22	UBS AG	39.969	
						<b>USD</b>	<b>39.969</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	165	187	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	70	79	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	118	134	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	198	224	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	183	208	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	111	125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	10.388	11.756	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	73	
						<b>USD</b>	<b>78</b>
						<b>EUR</b>	<b>69</b>
US-Dollar	Euro	149	132	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	140	124	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	117	104	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	98	87	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	115	101	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	94	83	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
						<b>USD</b>	<b>(6)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(5)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	899	1.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	US-Dollar	382	433	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	US-Dollar	646	731	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	1.084	1.227	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8	
Euro	US-Dollar	1.002	1.136	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	607	686	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	56.842	64.328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	401	
						<b>USD</b>	<b>430</b>
						<b>EUR</b>	<b>378</b>
US-Dollar	Euro	816	723	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
US-Dollar	Euro	766	678	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Euro	643	568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	539	478	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	629	556	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	513	454	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	
						<b>USD</b>	<b>(31)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(27)</b>

# BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Euro - 38.737.815</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.075.050)</b>			
100.000		116.320	0,06
Abertis Infraestructuras Finance BV FRN (Perpetual) 3.248% 24-Nov-2025			
100.000		118.874	0,06
Accor SA 3.000% 04-Feb-2026			
100.000		120.759	0,06
Accor SA 3.625% 17-Sep-2023			
100.000		116.084	0,06
Accor SA FRN (Perpetual) 4.375% 30-Jan-2024			
100.000		115.262	0,06
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA 'EMTN' 1.375% 17-Jun-2025			
100.000		116.585	0,06
Adevinta ASA 'REGS' 2.625% 15-Nov-2025			
100.000		115.660	0,06
Adient Global Holdings Ltd 'REGS' 3.500% 15-Aug-2024			
100.000		94.979	0,05
ADLER Group SA 2.250% 14-Jan-2029			
100.000		96.437	0,05
ADLER Group SA 2.750% 13-Nov-2026			
100.000		99.420	0,05
ADLER Group SA 3.250% 05-Aug-2025			
100.000		107.667	0,06
ADLER Real Estate AG 1.875% 27-Apr-2023			
100.000		116.001	0,06
AIB Group Plc 'EMTN' FRN 1.875% 19-Nov-2029			
100.000		120.255	0,06
AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031			
100.000		119.098	0,06
Akelius Residential Property AB FRN 3.875% 05-Oct-2028			
100.000		111.695	0,06
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 'REGS' 3.625% 01-Jun-2028			
100.000		110.584	0,06
Alpha Services and Holdings SA 'EMTN' FRN 4.250% 13-Feb-2030			
100.000		111.561	0,06
Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025			
100.000		107.944	0,06
Altice Financing SA 'REGS' 3.000% 15-Jan-2028			
100.000		108.584	0,06
Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028			
100.000		120.821	0,06
Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027			
100.000		112.538	0,06
Altice France SA/France 'REGS' 2.500% 15-Jan-2025			
100.000		111.058	0,06
Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028			
100.000		113.444	0,06
Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029			
100.000		119.398	0,06
Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027			
200.000		241.421	0,13
ams AG 'REGS' 6.000% 31-Jul-2025			
100.000		117.417	0,06
ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027			
100.000		111.953	0,06
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029			
100.000		111.613	0,06
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026			
100.000		107.759	0,06
Arena Luxembourg Finance Sarl 'REGS' 1.875% 01-Feb-2028			
100.000		116.941	0,06
Atlantia SpA 1.875% 12-Feb-2028			
100.000		117.641	0,06
Atlantia SpA 'EMTN' 1.875% 13-Jul-2027			
100.000		118.096	0,06
Autostrade per l'Italia SpA 2.000% 04-Dec-2028			
100.000		117.801	0,06
Autostrade per l'Italia SpA 2.000% 15-Jan-2030			
100.000		117.456	0,06
Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.750% 26-Jun-2026			
100.000		128.093	0,07
Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.875% 09-Jun-2024			
100.000		116.726	0,06
Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025			
100.000		116.142	0,06
Azzurra Aeroporti SpA 2.125% 30-May-2024			
100.000		114.794	0,06
Ball Corp 0.875% 15-Mar-2024			
100.000		111.127	0,06
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.875% 09-Jan-2026			
100.000		114.284	0,06
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 'EMTN' 2.625% 28-Apr-2025			
100.000		116.141	0,06
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 'EMTN' 3.625% 24-Sep-2024			
100.000		123.091	0,06
Banca Popolare di Sondrio SCPA 'EMTN' FRN 6.250% 30-Jul-2029			
100.000		115.743	0,06
Banco BPM SpA 'EMTN' 1.750% 24-Apr-2023			
100.000		118.514	0,06
Banco BPM SpA FRN 4.250% 01-Oct-2029			
100.000		121.832	0,06
Banco BPM SpA FRN 5.000% 14-Sep-2030			
100.000		113.107	0,06
Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 3.871% 27-Mar-2030			
100.000		118.500	0,06
Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031			
100.000		130.687	0,07
Banco de Sabadell SA 'EMTN' 5.625% 06-May-2026			

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.375% 12-Dec-2028	123.168	0,06
100.000	Banco de Sabadell SA FRN 2.000% 17-Jan-2030	112.140	0,06
100.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	114.823	0,06
100.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	118.692	0,06
100.000	Bayer AG FRN 2.375% 12-Nov-2079	114.088	0,06
100.000	Bayer AG FRN 3.125% 12-Nov-2079	115.891	0,06
100.000	Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2074	118.279	0,06
100.000	BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	115.207	0,06
100.000	Belden Inc 'REGS' 4.125% 15-Oct-2026	116.156	0,06
100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 3.500% 23-Apr-2075	121.668	0,06
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl 'REGS' 5.250% 30-Apr-2029	118.048	0,06
100.000	Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025	119.609	0,06
100.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 3.625% 30-Nov-2030	118.267	0,06
100.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	111.717	0,06
100.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029	111.600	0,06
100.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	114.111	0,06
100.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027	114.758	0,06
100.000	Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026	119.799	0,06
100.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 3.580% 07-Feb-2025	110.043	0,06
100.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.498% 07-Mar-2024	115.108	0,06
100.000	Castellum AB FRN (Perpetual) 3.125% 02-Dec-2026	108.959	0,06
100.000	Catalent Pharma Solutions Inc 'REGS' 2.375% 01-Mar-2028	114.050	0,06
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.250% 15-Jan-2029	108.793	0,06
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.500% 08-Jun-2028	111.726	0,06
200.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033	216.797	0,11
100.000	Cellnex Telecom SA 1.000% 20-Apr-2027	111.357	0,06
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	109.648	0,06
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 2.375% 16-Jan-2024	118.264	0,06
100.000	Centurion Bidco SpA 'REGS' 5.875% 30-Sep-2026	117.594	0,06
100.000	CGG SA 'REGS' 7.750% 01-Apr-2027	113.200	0,06
100.000	Chemours Co/The 4.000% 15-May-2026	115.787	0,06
100.000	Chepharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028	119.112	0,06
100.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.750% 22-May-2025	113.433	0,06
100.000	Citycon Oyj FRN (Perpetual) 4.496% 24-Nov-2024	113.706	0,06
100.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	117.117	0,06
100.000	CMA CGM SA 'REGS' 7.500% 15-Jan-2026	125.643	0,07
20.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 23-Mar-2026	25.200	0,01
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 30-Mar-2027	19.165	0,01
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030	124.396	0,07
100.000	Constellium SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029	113.065	0,06
200.000	ContourGlobal Power Holdings SA 'REGS' 4.125% 01-Aug-2025	231.811	0,12
150.000	Coty Inc 'REGS' 3.875% 15-Apr-2026	174.662	0,09
100.000	Coty Inc 'REGS' 4.000% 15-Apr-2023	114.336	0,06
100.000	CPI Property Group SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Aug-2026	116.856	0,06
100.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.100% 21-Jan-2026	109.346	0,06
100.000	Credito Emiliano Holding SpA FRN 3.500% 16-Dec-2030	118.225	0,06
100.000	Crown European Holdings SA 'REGS' 3.375% 15-May-2025	121.350	0,06
100.000	CT Investment GmbH 'REGS' 5.500% 15-Apr-2026	115.410	0,06
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' 4.500% 19-May-2026	130.267	0,07
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 5.625% 19-May-2031	133.685	0,07

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.875% 11-Feb-2025	114.533	0,06
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.000% 29-May-2026	113.986	0,06
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.500% 14-Jul-2029	112.824	0,06
100.000	DKT Finance ApS 'REGS' 7.000% 17-Jun-2023	115.692	0,06
100.000	Douglas GmbH 'REGS' 6.000% 08-Apr-2026	113.723	0,06
100.000	doValue SpA 'REGS' 5.000% 04-Aug-2025	118.585	0,06
100.000	Dufry One BV 2.000% 15-Feb-2027	105.865	0,06
100.000	Dufry One BV 2.500% 15-Oct-2024	112.387	0,06
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.700% 20-Jul-2080	113.202	0,06
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.875% 02-Aug-2081	112.894	0,06
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 4.496% 30-Apr-2079	121.820	0,06
100.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 3.625% 07-Feb-2024	113.522	0,06
100.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 6.250% 30-Oct-2025	117.146	0,06
100.000	eircorn Finance DAC 3.500% 15-May-2026	115.959	0,06
100.000	Elis SA 'EMTN' 1.625% 03-Apr-2028	113.498	0,06
100.000	ELM BV for Firmenich International SA FRN (Perpetual) 3.750% 03-Sep-2025	120.626	0,06
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.875% 15-Oct-2025	119.178	0,06
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029	110.584	0,06
100.000	Esselunga SpA 1.875% 25-Oct-2027	119.599	0,06
100.000	Eurobank SA 'EMTN' FRN 2.000% 05-May-2027	108.614	0,06
100.000	Eurofins Scientific SE FRN (Perpetual) 3.250% 13-Nov-2025	119.442	0,06
100.000	Eurofins Scientific SE FRN (Perpetual) 4.875% 29-Apr-2023	119.566	0,06
100.000	Fastighets AB Balder FRN 2.873% 02-Jun-2081	108.878	0,06
100.000	Faurecia SE 2.375% 15-Jun-2027	114.458	0,06
100.000	Faurecia SE 3.125% 15-Jun-2026	116.902	0,06
100.000	Faurecia SE 3.750% 15-Jun-2028	119.371	0,06
100.000	Fnac Darty SA 2.625% 30-May-2026	116.374	0,06
100.000	Foodco Bondco SA 'REGS' 6.250% 15-May-2026	105.635	0,06
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.330% 25-Nov-2025	118.803	0,06
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.386% 17-Feb-2026	118.954	0,06
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 1.355% 07-Feb-2025	114.629	0,06
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 3.021% 06-Mar-2024	118.995	0,06
250.000	Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026	269.557	0,14
100.000	Gamma Bidco SpA 'REGS' 6.250% 15-Jul-2025	117.248	0,06
100.000	Garfunkel Lux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025	118.416	0,06
100.000	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	114.876	0,06
100.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	117.477	0,06
100.000	Grifols SA 'REGS' 1.625% 15-Feb-2025	113.528	0,06
200.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	228.068	0,12
100.000	Gruenthal GmbH 'REGS' 3.625% 15-Nov-2026	117.185	0,06
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA 'REGS' 3.375% 30-Apr-2026	111.135	0,06
100.000	Guala Closures SpA 'REGS' 3.250% 15-Jun-2028	112.119	0,06
100.000	Heimstaden AB 4.375% 06-Mar-2027	113.899	0,06
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	107.540	0,06
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.248% 19-Nov-2024	114.260	0,06
100.000	Herens Midco Sarl 'REGS' 5.250% 15-May-2029	107.665	0,06
100.000	Holcim Finance Luxembourg SA FRN (Perpetual) 3.000% 05-Jul-2024	117.794	0,06
100.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	113.715	0,06
100.000	Icrea Banca SpA 'EMTN' FRN 2.250% 20-Oct-2025	114.853	0,06
100.000	Ideal Standard International SA 'REGS' 6.375% 30-Jul-2026	102.270	0,05
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.625% 15-May-2025	115.446	0,06
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	116.407	0,06
100.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	119.118	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
100.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 'REGS' 3.750% 15-Jan-2028	113.329	0,06
100.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.125% 15-Nov-2025	114.233	0,06
100.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	114.911	0,06
100.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 2.500% 15-Jan-2026	113.548	0,06
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	118.311	0,06
100.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 'GMTN' 1.875% 08-Jul-2026	117.769	0,06
100.000	International Consolidated Airlines Group SA 3.750% 25-Mar-2029	111.611	0,06
100.000	International Game Technology Plc 'REGS' 3.500% 15-Jul-2024	119.684	0,06
100.000	International Personal Finance Plc 9.750% 12-Nov-2025	122.225	0,06
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 2.925% 14-Oct-2030	118.900	0,06
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 3.928% 15-Sep-2026	125.617	0,07
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 6.625% 13-Sep-2023	125.443	0,07
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' FRN 5.875% 04-Mar-2029	125.174	0,07
100.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA FRN (Perpetual) 4.750% 17-Dec-2024	123.393	0,07
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.000% 15-Sep-2027	112.347	0,06
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.125% 15-Jul-2024	114.385	0,06
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.500% 15-Jul-2026	115.402	0,06
100.000	Intrum AB 'REGS' 4.875% 15-Aug-2025	118.471	0,06
100.000	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	117.338	0,06
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.250% 15-Jan-2028	114.826	0,06
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.250% 15-Mar-2029	113.688	0,06
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	117.099	0,06
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 2.200% 15-Jan-2024	113.240	0,06
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 4.500% 15-Jan-2026	118.628	0,06
100.000	Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026	104.823	0,06
100.000	Kraft Heinz Foods Co 2.250% 25-May-2028	122.202	0,06
100.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 4.000% 15-May-2024	112.186	0,06
100.000	LANXESS AG FRN 4.500% 06-Dec-2076	119.898	0,06
100.000	Leonardo SpA 'EMTN' 4.875% 24-Mar-2025	128.186	0,07
100.000	LHMC Finco 2 Sarl 'REGS' 7.250% 02-Oct-2025	112.275	0,06
100.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024	114.833	0,06
100.000	LKQ European Holdings BV 'REGS' 4.125% 01-Apr-2028	120.376	0,06
100.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	116.012	0,06
100.000	Loxam SAS 5.750% 15-Jul-2027	117.998	0,06
100.000	Loxam SAS 'REGS' 4.250% 15-Apr-2024	115.086	0,06
100.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 2.625% 15-Sep-2024	115.319	0,06
100.000	Motion Finco Sarl 'REGS' 7.000% 15-May-2025	119.484	0,06
100.000	Nassa Topco AS 'REGS' 2.875% 06-Apr-2024	115.743	0,06
100.000	National Bank of Greece SA FRN 8.250% 18-Jul-2029	126.803	0,07
100.000	Netflix Inc 4.625% 15-May-2029	142.079	0,07
100.000	Netflix Inc 'REGS' 3.000% 15-Jun-2025	123.593	0,07
100.000	Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030	135.902	0,07
100.000	Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026	111.856	0,06
100.000	Nexi SpA 1.750% 31-Oct-2024	115.819	0,06
100.000	Nexi SpA 2.125% 30-Apr-2029	111.892	0,06
100.000	NGG Finance Plc FRN 1.625% 05-Dec-2079	114.890	0,06
100.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	113.371	0,06
200.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 3.500% 30-Sep-2024	228.003	0,12
100.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	113.209	0,06
100.000	Nokia Oyj 'EMTN' 2.000% 15-Mar-2024	117.749	0,06
100.000	Nokia Oyj 'EMTN' 2.000% 11-Mar-2026	119.179	0,06
100.000	Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028	114.275	0,06
100.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 'REGS' 3.375% 15-Apr-2029	117.266	0,06



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
30.000	Novo Banco SA/Luxembourg 3.500% 23-Jan-2043	33.684	0,02
130.000	Novomatic AG 'EMTN' 1.625% 20-Sep-2023	147.118	0,08
90.000	OCI NV 'REGS' 3.625% 15-Oct-2025	106.401	0,06
150.000	OI European Group BV 'REGS' 3.125% 15-Nov-2024	175.846	0,09
200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028	229.987	0,12
100.000	Paprec Holding SA 'REGS' 3.500% 01-Jul-2028	116.007	0,06
100.000	Peach Property Finance GmbH 'REGS' 3.500% 15-Feb-2023	114.739	0,06
100.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	115.682	0,06
100.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025	116.666	0,06
100.000	Piraeus Financial Holdings SA 'EMTN' FRN 9.750% 26-Jun-2029	123.345	0,06
100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 2.125% 31-Jan-2025	116.479	0,06
100.000	Pro-Gest SpA 'REGS' 3.250% 15-Dec-2024	108.896	0,06
100.000	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023	113.921	0,06
100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 1.500% 01-Mar-2025	110.183	0,06
100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	107.939	0,06
200.000	Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027	224.564	0,12
100.000	RCI Banque SA FRN 2.625% 18-Feb-2030	114.375	0,06
10.000	Renault SA 'EMTN' 1.000% 08-Mar-2023	11.469	0,01
130.000	Renault SA 'EMTN' 1.000% 28-Nov-2025	146.424	0,08
100.000	Renault SA 'EMTN' 1.250% 24-Jun-2025	112.029	0,06
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.000% 28-Sep-2026	112.900	0,06
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.375% 25-May-2026	114.960	0,06
100.000	Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025	118.479	0,06
100.000	Repsol International Finance BV FRN 4.500% 25-Mar-2075	122.385	0,06
100.000	Repsol International Finance BV FRN (Perpetual) 2.500% 22-Dec-2026	113.729	0,06
100.000	Repsol International Finance BV FRN (Perpetual) 3.750% 11-Mar-2026	120.428	0,06
100.000	Rexel SA 2.125% 15-Jun-2028	115.083	0,06
100.000	Rolls-Royce Plc 'EMTN' 0.875% 09-May-2024	112.618	0,06
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 4.625% 16-Feb-2026	126.338	0,07
100.000	Rubis Terminal Infra SAS 'REGS' 5.625% 15-May-2025	118.831	0,06
100.000	Saipem Finance International BV 'EMTN' 2.625% 07-Jan-2025	114.816	0,06
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.624% 30-Jan-2025	111.875	0,06
50.000	Schaeffler AG 'EMTN' 1.875% 26-Mar-2024	58.516	0,03
65.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2.875% 26-Mar-2027	80.294	0,04
103.025	Selecta Group BV 'REGS' 8.000% 01-Apr-2026	119.408	0,06
100.000	SES SA FRN (Perpetual) 2.875% 27-May-2026	114.305	0,06
100.000	Sigma Holdco BV 'REGS' 5.750% 15-May-2026	105.243	0,06
100.000	Silgan Holdings Inc 2.250% 01-Jun-2028	113.448	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 2.125% 06-Jul-2024	112.680	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 3.375% 06-Jul-2029	106.523	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 4.000% 19-Sep-2029	110.531	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 4.750% 30-Jul-2025	120.007	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 5.000% 15-Apr-2028	117.405	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 5.250% 30-Jul-2027	119.422	0,06
100.000	Solvay Finance SACA FRN (Perpetual) 5.869% 03-Jun-2024	125.583	0,07
100.000	SPCM SA 'REGS' 2.000% 01-Feb-2026	114.562	0,06
100.000	SPIE SA 3.125% 22-Mar-2024	118.878	0,06
100.000	Standard Industries Inc/NJ 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	111.913	0,06
90.105	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	110.887	0,06
100.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	118.873	0,06
102.681	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	119.658	0,06
100.000	Synthomer Plc 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025	117.776	0,06
100.000	Synthos SA 'REGS' 2.500% 07-Jun-2028	111.465	0,06
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	112.960	0,06
100.000	Tele Columbus AG 'REGS' 3.875% 02-May-2025	112.675	0,06

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
80.000	Telecom Italia Finance SA 'EMTN' 7.750% 24-Jan-2033	121.628	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 1.625% 18-Jan-2029	104.813	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.375% 12-Oct-2027	112.588	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.500% 19-Jul-2023	116.761	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.750% 15-Apr-2025	116.626	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.000% 30-Sep-2025	117.437	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.625% 25-May-2026	120.155	0,06
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 4.000% 11-Apr-2024	119.607	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	108.748	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.875% 24-Jun-2027	114.906	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.000% 04-Sep-2023	117.562	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.875% 22-Jun-2026	120.894	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	122.589	0,06
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 5.875% 31-Mar-2024	125.057	0,07
100.000	Teollisuuden Voima Oyj 'EMTN' 1.125% 09-Mar-2026	113.698	0,06
100.000	Tereos Finance Groupe I SA 4.125% 16-Jun-2023	115.706	0,06
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.625% 15-Oct-2028	99.830	0,05
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.875% 31-Mar-2027	105.318	0,06
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	112.529	0,06
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.500% 01-Mar-2025	118.484	0,06
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.000% 31-Jan-2025	122.671	0,06
70.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 1.875% 06-Mar-2023	80.927	0,04
50.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 2.500% 25-Feb-2025	59.232	0,03
150.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 2.875% 22-Feb-2024	175.815	0,09
100.000	TI Automotive Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Apr-2029	115.292	0,06
100.000	Titan Global Finance Plc 2.375% 16-Nov-2024	116.526	0,06
90.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	108.416	0,06
100.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	117.976	0,06
100.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	115.657	0,06
100.000	UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029	112.702	0,06
200.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2.000% 23-Sep-2029	229.761	0,12
200.000	UniCredit SpA FRN 2.731% 15-Jan-2032	232.835	0,12
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.250% 23-Sep-2030	129.518	0,07
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.500% 29-Nov-2027	128.153	0,07
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' 3.875% 01-Mar-2028	123.257	0,06
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024	124.086	0,07
100.000	United Group BV 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	112.965	0,06
100.000	UPC Holding BV 'REGS' 3.875% 15-Jun-2029	116.413	0,06
100.000	UPCB Finance VII Ltd 'REGS' 3.625% 15-Jun-2029	116.557	0,06
100.000	Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028	111.389	0,06
100.000	Valeo 'EMTN' 1.500% 18-Jun-2025	117.790	0,06
100.000	Vallourec SA 'REGS' 8.500% 30-Jun-2026	117.977	0,06
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	115.959	0,06
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.500% 20-Jan-2029	114.312	0,06
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027	113.980	0,06
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	116.263	0,06
100.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029	115.768	0,06

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Euro Forts.</b>				
100.000	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA 'REGS' 5.250% 01-Apr-2026	117.400	0,06	
100.000	Victoria Plc 3.625% 24-Aug-2026	115.749	0,06	
100.000	Virgin Media Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2030	114.089	0,06	
100.000	Vivion Investments Sarl 3.000% 08-Aug-2024	111.596	0,06	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 3.250% 31-Jan-2031	113.364	0,06	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 2.625% 27-Aug-2080	116.099	0,06	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080	115.033	0,06	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 4.200% 03-Oct-2078	125.653	0,07	
100.000	Volvo Car AB 'EMTN' 2.125% 02-Apr-2024	118.073	0,06	
100.000	Webuild SpA 5.875% 15-Dec-2025	124.342	0,07	
10.000	Wienerberger AG 2.000% 02-May-2024	11.867	0,01	
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	110.908	0,06	
100.000	WMG Acquisition Corp 'REGS' 2.750% 15-Jul-2028	117.116	0,06	
100.000	ZF Europe Finance BV 2.000% 23-Feb-2026	114.641	0,06	
100.000	ZF Europe Finance BV 2.500% 23-Oct-2027	115.715	0,06	
100.000	ZF Europe Finance BV 3.000% 23-Oct-2029	117.842	0,06	
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.000% 21-Sep-2025	119.285	0,06	
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.750% 21-Sep-2028	122.926	0,06	
100.000	ZF North America Capital Inc 2.750% 27-Apr-2023	117.383	0,06	
100.000	Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3.375% 28-Feb-2030	111.360	0,06	
160.000	Ziggo BV 'REGS' 4.250% 15-Jan-2027	186.295	0,10	
<b>Pfund Sterling - 4.418.011</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 308.999)</b>		<b>4.418.011</b>	<b>2,31</b>	
200.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	261.311	0,14	
100.000	Boparan Finance Plc 'REGS' 7.625% 30-Nov-2025	112.289	0,06	
25.000	Burford Capital Plc 6.125% 26-Oct-2024	35.324	0,02	
100.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028	134.494	0,07	
100.000	Constellation Automotive Financing Plc 'REGS' 4.875% 15-Jul-2027	133.571	0,07	
100.000	Co-Operative Group Ltd 5.125% 17-May-2024	141.026	0,07	
100.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	140.870	0,07	
100.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	134.954	0,07	
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 5.375% 15-Feb-2026	140.388	0,07	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 2.748% 14-Jun-2024	136.419	0,07	
100.000	Galaxy Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jul-2026	139.732	0,07	
100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	140.801	0,07	
100.000	Heathrow Finance Plc 6.250% 03-Mar-2025	143.719	0,08	
50.000	HJ Heinz Finance UK Plc 6.250% 18-Feb-2030	86.379	0,05	
100.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	126.857	0,07	
100.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	137.258	0,07	
100.000	Marks & Spencer Plc 4.500% 10-Jul-2027	140.528	0,07	
100.000	Metro Bank Plc 'EMTN' FRN 9.500% 08-Oct-2025	122.671	0,07	
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.550% 05-Dec-2023	137.218	0,07	
100.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	138.351	0,07	
100.000	NGG Finance Plc FRN 5.625% 18-Jun-2073	147.199	0,08	
100.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.250% 30-Sep-2025	135.899	0,07	
100.000	Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026	135.798	0,07	
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 5.750% 15-Oct-2027	150.914	0,08	
100.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' 8.250% 31-Jul-2025	137.605	0,07	
100.000	TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025	129.074	0,07	
50.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 5.875% 19-May-2023	70.711	0,04	
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 2.875% 03-May-2027	137.794	0,07	
100.000	Travis Perkins Plc 4.500% 07-Sep-2023	140.059	0,07	
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	134.436	0,07	
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	135.597	0,07	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	135.308	0,07	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Pfund Sterling Forts.</b>				
100.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078 VAR	143.457	0,08	
<b>US-Dollar - 140.801.284</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 19.882.713)</b>		<b>140.801.284</b>	<b>73,60</b>	
50.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	49.557	0,03	
230.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	233.333	0,12	
255.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	251.068	0,13	
25.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	25.543	0,01	
50.000	AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2024	49.687	0,03	
35.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	37.721	0,02	
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd 5.950% 31-Jul-2024	217.865	0,11	
79.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	84.387	0,04	
20.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	20.580	0,01	
20.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	21.051	0,01	
120.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	116.882	0,06	
90.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	89.001	0,05	
162.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	162.181	0,08	
10.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	11.023	0,01	
112.000	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL '144A' 5.000% 01-May-2028	111.610	0,06	
130.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	137.992	0,07	
25.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	25.532	0,01	
50.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	49.340	0,03	
65.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	63.629	0,03	
10.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	10.368	0,01	
30.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	31.475	0,02	
114.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	124.325	0,06	
75.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045	81.107	0,04	
105.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	112.913	0,06	
40.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	41.657	0,02	
10.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	10.389	0,01	
200.000	Agile Group Holdings Ltd FRN (Perpetual) 8.375% 04-Dec-2023	98.010	0,05	
125.000	Ahern Rentals Inc '144A' 7.375% 15-May-2023	119.531	0,06	
100.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	102.131	0,05	
100.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	122.868	0,06	
90.000	Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025	77.156	0,04	
200.000	Akbank TAS 'REGS' 6.800% 06-Feb-2026	193.958	0,10	
30.000	Akumin Escrow Inc '144A' 7.500% 01-Aug-2028	28.176	0,01	
50.000	Akumin Inc '144A' 7.000% 01-Nov-2025	47.637	0,02	
30.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	30.594	0,02	
190.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	190.701	0,10	
82.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	86.147	0,04	
117.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	126.507	0,07	
30.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	31.841	0,02	
130.000	Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.125% 15-May-2028	140.092	0,07	
40.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	43.992	0,02	
50.000	Allegheny Technologies Inc 5.875% 01-Dec-2027	52.199	0,03	
11.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	11.176	0,01	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
30.000	Alliant Holdings Intermedate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	30.031	0,02
145.000	Alliant Holdings Intermedate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	150.588	0,08
100.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	104.958	0,05
140.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	149.743	0,08
40.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	39.320	0,02
50.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	48.839	0,03
15.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	15.638	0,01
40.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	43.555	0,02
52.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	58.727	0,03
50.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	48.873	0,03
200.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	198.303	0,10
30.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	28.704	0,01
200.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	215.282	0,11
200.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	195.438	0,10
200.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	198.557	0,10
54.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	53.282	0,03
85.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.500% 15-Apr-2025	90.613	0,05
20.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	19.911	0,01
25.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	25.562	0,01
142.413	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	137.793	0,07
101.152	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023	103.423	0,05
56.283	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	57.227	0,03
114.983	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	114.205	0,06
133.326	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	131.463	0,07
57.338	American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028	55.573	0,03
30.867	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	29.451	0,02
30.000	American Airlines 2021-1 Class B Pass Through Trust 3.950% 11-Jul-2030	29.700	0,02
8.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	7.489	0,00
154.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	190.205	0,10
225.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	234.322	0,12
145.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	155.096	0,08
85.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	83.515	0,04
15.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.500% 01-Apr-2027	15.596	0,01
13.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	13.321	0,01
75.000	American Finance Trust Inc / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	75.666	0,04
10.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	10.286	0,01
60.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.500% 20-May-2025	64.335	0,03
60.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.625% 20-May-2024	64.930	0,03
50.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.750% 20-May-2027	55.362	0,03
111.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.875% 20-Aug-2026	124.266	0,06
55.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	58.186	0,03
30.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	30.456	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
14.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	14.525	0,01
100.000	ams AG '144A' 7.000% 31-Jul-2025	106.156	0,06
11.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	11.323	0,01
35.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	36.435	0,02
35.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	34.266	0,02
15.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	15.559	0,01
145.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	152.263	0,08
40.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	44.122	0,02
63.000	Antero Resources Corp '144A' 8.375% 15-Jul-2026	71.810	0,04
20.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	21.733	0,01
120.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	130.903	0,07
52.000	Apache Corp 4.625% 15-Nov-2025	55.899	0,03
35.000	Apache Corp 4.875% 15-Nov-2027	38.200	0,02
83.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	93.921	0,05
20.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	23.130	0,01
20.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	22.880	0,01
10.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	12.254	0,01
25.000	Apache Corp 7.375% 15-Aug-2047	31.411	0,02
70.000	Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029	88.978	0,05
10.000	Apex Tool Group LLC / BC Mountain Finance Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2023	9.462	0,00
40.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	38.758	0,02
10.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	8.925	0,00
50.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	49.320	0,03
20.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	21.022	0,01
200.000	Arabian Centres Sukuk Ltd 'REGS' 5.375% 26-Nov-2024	200.250	0,10
105.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025	107.232	0,06
147.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	152.219	0,08
86.000	Aramark Services Inc '144A' 6.375% 01-May-2025	89.980	0,05
30.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	30.027	0,02
60.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	60.459	0,03
170.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	177.504	0,09
15.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	15.765	0,01
90.000	Arconic Corp '144A' 6.000% 15-May-2025	94.275	0,05
30.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	31.976	0,02
155.000	Arcor SAIC 'REGS' 6.000% 06-Jul-2023	152.838	0,08
69.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	70.051	0,04
100.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	103.104	0,05
78.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	77.236	0,04
207.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	205.039	0,11
24.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	24.570	0,01
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	100.738	0,05
24.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	24.177	0,01
80.000	Aretec Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2029	82.181	0,04
65.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	62.900	0,03
55.000	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	58.248	0,03
110.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	112.358	0,06
5.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	5.089	0,00
160.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	163.267	0,09
30.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	28.908	0,01
64.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	64.958	0,03
41.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	42.514	0,02
100.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	129.486	0,07
25.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	24.600	0,01
15.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	15.878	0,01

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
100.000	Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048	114.375	0,06
10.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	9.742	0,00
40.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	40.342	0,02
130.000	Asteroid Private Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2029	136.439	0,07
100.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	110.112	0,06
20.000	At Home Group Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2028	19.733	0,01
120.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.500% 01-Mar-2027	118.824	0,06
50.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	48.918	0,03
116.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	121.123	0,06
150.000	Avaya Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2028	159.259	0,08
55.000	Avient Corp 5.250% 15-Mar-2023	57.669	0,03
45.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	46.963	0,02
40.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 4.750% 01-Apr-2028	40.960	0,02
10.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	10.405	0,01
45.000	Avon Products Inc 6.500% 15-Mar-2023	47.239	0,02
5.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	6.157	0,00
150.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	145.346	0,08
10.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	10.349	0,01
45.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	46.847	0,02
85.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	82.597	0,04
169.000	Ball Corp 4.000% 15-Nov-2023	176.605	0,09
15.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	16.538	0,01
70.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	77.253	0,04
170.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS' 3.200% 27-Jan-2025	172.421	0,09
45.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 2.750% 11-Jan-2026	42.743	0,02
40.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 4.500% 10-Jan-2025	40.398	0,02
180.000	Banco de Bogota SA 'REGS' 4.375% 03-Aug-2027	184.907	0,10
180.000	Banco de Bogota SA 'REGS' 6.250% 12-May-2026	194.642	0,10
190.000	Bancolumbia SA 3.000% 29-Jan-2025	190.961	0,10
40.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	44.256	0,02
55.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	68.005	0,04
90.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	111.966	0,06
40.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	45.607	0,02
145.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	164.455	0,09
233.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	244.987	0,13
160.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	169.198	0,09
150.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	153.646	0,08
82.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 30-Jan-2028	75.569	0,04
50.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2029	44.203	0,02
102.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	89.918	0,05
70.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	61.621	0,03
10.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	10.390	0,01
122.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 15-Apr-2025	124.593	0,06
181.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	172.290	0,09
160.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.000% 15-Jan-2028	159.426	0,08
125.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029	123.926	0,06
14.000	Baytex Energy Corp '144A' 5.625% 01-Jun-2024	14.018	0,01
70.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	73.395	0,04
35.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	35.772	0,02
30.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	29.655	0,02
20.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	22.323	0,01
150.000	Bed Bath & Beyond Inc 3.749% 01-Aug-2024	151.473	0,08
10.000	Bed Bath & Beyond Inc 5.165% 01-Aug-2044	8.321	0,00
25.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	28.884	0,01
15.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	17.618	0,01
18.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	18.293	0,01
30.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	31.418	0,02
10.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026	9.910	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
52.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	56.297	0,03
70.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	70.016	0,04
10.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	10.015	0,00
100.000	Block Inc '144A' 2.750% 01-Jun-2026	100.250	0,05
100.000	Block Inc '144A' 3.500% 01-Jun-2031	102.673	0,05
90.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	92.970	0,05
12.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	12.732	0,01
100.000	BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	99.641	0,05
10.000	Boise Cascade Co '144A' 4.875% 01-Jul-2030	10.565	0,01
150.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	155.806	0,08
150.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Dec-2024	156.476	0,08
175.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 15-Mar-2025	178.497	0,09
190.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	197.121	0,10
20.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	20.379	0,01
75.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 4.000% 01-Jul-2029	77.545	0,04
55.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	57.741	0,03
55.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 9.125% 01-Mar-2026	57.508	0,03
184.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	188.008	0,10
20.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	20.435	0,01
26.000	Boyd Gaming Corp '144A' 8.625% 01-Jun-2025	27.891	0,01
64.000	Boyer USA Inc '144A' 4.750% 15-May-2029	66.030	0,03
76.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 8.500% 15-Jul-2025	76.014	0,04
100.000	Braskem America Finance Co 'REGS' 7.125% 22-Jul-2041	129.474	0,07
220.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 10-Jan-2028	233.540	0,12
200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030	213.046	0,11
40.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	46.156	0,02
180.000	BRF SA 'REGS' 5.750% 21-Sep-2050	179.354	0,09
25.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	26.144	0,01
25.000	Brightstar Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	26.839	0,01
110.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	114.510	0,06
40.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	41.666	0,02
130.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	127.696	0,07
83.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 5.750% 15-May-2026	85.998	0,04
50.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	51.216	0,03
50.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	52.240	0,03
20.000	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2026	20.822	0,01
60.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	61.216	0,03
35.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	36.175	0,02
12.000	Buckeye Partners LP 4.150% 01-Jul-2023	12.313	0,01
25.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	24.413	0,01
30.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	29.480	0,02
51.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	52.722	0,03
56.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	56.505	0,03
10.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	10.739	0,01
27.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.750% 01-Jun-2027	28.514	0,01
10.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	10.164	0,01
145.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	147.021	0,08
55.000	C&S Group Enterprises LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2028	52.123	0,03
200.000	C&W Senior Financing DAC '144A' 6.875% 15-Sep-2027	208.208	0,11
95.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	95.199	0,05

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
236.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	248.012	0,13	
79.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	87.518	0,05	
44.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025	46.006	0,02	
25.000	California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026	26.003	0,01	
60.000	Callon Petroleum Co 6.125% 01-Oct-2024	59.162	0,03	
120.000	Callon Petroleum Co 8.250% 15-Jul-2025	118.205	0,06	
100.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	101.142	0,05	
15.000	Calpine Corp '144A' 3.750% 01-Mar-2031	14.574	0,01	
57.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	59.094	0,03	
110.000	Calpine Corp '144A' 4.625% 01-Feb-2029	108.654	0,06	
106.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	106.164	0,06	
143.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	145.400	0,08	
37.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 15-Apr-2025	39.952	0,02	
30.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	31.082	0,02	
65.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	65.093	0,03	
10.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	10.194	0,01	
30.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	30.958	0,02	
195.000	Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028	193.934	0,10	
175.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	175.263	0,09	
100.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	99.697	0,05	
155.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	162.681	0,08	
125.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	142.969	0,07	
60.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Feb-2026	68.563	0,04	
25.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	29.141	0,01	
50.000	Carpenter Technology Corp 6.375% 15-Jul-2028	53.177	0,03	
25.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	24.035	0,01	
20.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	21.329	0,01	
140.000	Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	133.553	0,07	
65.000	Carvana Co '144A' 5.500% 15-Apr-2027	64.418	0,03	
60.000	Carvana Co '144A' 5.625% 01-Oct-2025	60.075	0,03	
20.000	Carvana Co '144A' 5.875% 01-Oct-2028	19.953	0,01	
20.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	20.859	0,01	
35.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	35.927	0,02	
10.000	Castle US Holding Corp '144A' 9.500% 15-Feb-2028	10.439	0,01	
75.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029	74.088	0,04	
53.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	52.593	0,03	
11.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	11.440	0,01	
20.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	20.884	0,01	
234.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	241.117	0,13	
280.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	283.150	0,15	
200.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	197.127	0,10	
260.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	266.561	0,14	
205.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	209.472	0,11	
285.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	296.906	0,15	
226.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	235.492	0,12	
305.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	314.524	0,16	
142.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	153.481	0,08	
105.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	110.365	0,06	
55.000	CDK Global Inc 4.875% 01-Jun-2027	56.987	0,03	
62.000	CDK Global Inc '144A' 5.250% 15-May-2029	65.810	0,03	
50.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	49.052	0,03	
90.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	92.385	0,05	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
100.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	102.601	0,05	
140.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	145.077	0,08	
100.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	99.791	0,05	
180.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 5.450% 19-Nov-2029	193.127	0,10	
110.000	Cengage Learning Inc '144A' 9.500% 15-Jun-2024	110.802	0,06	
250.000	Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028	246.635	0,13	
140.000	Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031	136.525	0,07	
150.000	Centene Corp 2.625% 01-Aug-2031	147.250	0,08	
160.000	Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030	162.918	0,08	
102.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	104.231	0,05	
169.000	Centene Corp 4.250% 15-Dec-2027	176.475	0,09	
291.000	Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	314.335	0,16	
30.000	Centennial Resource Production LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	30.630	0,02	
15.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	15.153	0,01	
115.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	115.745	0,06	
10.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	10.560	0,01	
100.000	Change Healthcare Holdings LLC / Change Healthcare Finance Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2025	100.979	0,05	
40.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	40.457	0,02	
40.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	41.657	0,02	
55.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	58.905	0,03	
50.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	49.688	0,03	
150.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	157.012	0,08	
105.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	111.208	0,06	
80.000	Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029	84.938	0,04	
25.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	26.342	0,01	
110.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	117.824	0,06	
200.000	China Evergrande Group 8.750% 28-Jun-2025	31.500	0,02	
200.000	China Evergrande Group 11.500% 22-Jan-2023	31.500	0,02	
200.000	China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09-Apr-2024	170.413	0,09	
50.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2028	51.445	0,03	
15.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	15.446	0,01	
170.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	180.123	0,09	
100.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	99.083	0,05	
44.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.625% 15-Feb-2025	45.590	0,02	
170.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	173.448	0,09	
184.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	193.631	0,10	
65.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	67.386	0,03	
55.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	56.705	0,03	
200.000	CIBANCO SA Institucion de Banca Multiple Trust CIB/3332 'REGS' 4.375% 22-Jul-2031	191.937	0,10	
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd 6.550% 28-Mar-2024	198.500	0,10	
150.000	Cinemark Plc '144A' 7.000% 15-Jun-2026	155.968	0,08	
45.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	43.952	0,02	
30.000	CIT Group Inc 4.750% 16-Feb-2024	31.762	0,02	
170.000	CIT Group Inc 5.000% 01-Aug-2023	179.772	0,09	
20.000	CIT Group Inc 5.250% 07-Mar-2025	22.056	0,01	
85.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	85.948	0,04	
95.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026	99.514	0,05	
150.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	159.193	0,08	
10.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	10.310	0,01	
130.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	138.128	0,07	
10.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	10.410	0,01	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
70.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	74.845	0,04
90.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	96.438	0,05
92.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	95.312	0,05
10.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	10.210	0,01
55.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Feb-2031	54.947	0,03
45.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4.750% 15-Mar-2028	47.372	0,02
11.000	Cleaver-Brooks Inc '144A' 7.875% 01-Mar-2023	10.786	0,01
25.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	26.056	0,01
115.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2031	119.644	0,06
105.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	111.292	0,06
13.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 9.875% 17-Oct-2025	14.729	0,01
45.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	46.863	0,02
59.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	62.642	0,03
100.000	Coeur Mining Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2029	91.789	0,05
80.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026	81.284	0,04
150.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	140.374	0,07
100.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.625% 01-Oct-2031	92.181	0,05
100.000	Commerzbank AG '144A' 8.125% 19-Sep-2023	110.244	0,06
87.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	89.727	0,05
100.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	98.392	0,05
100.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	102.807	0,05
48.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	48.054	0,02
150.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	157.396	0,08
30.000	Compass Minerals International Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2024	30.805	0,02
120.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	127.229	0,07
124.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	134.538	0,07
6.000	Comstock Resources Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	6.214	0,00
200.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	210.520	0,11
30.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	31.236	0,02
65.000	Consolidated Communications Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2028	65.749	0,03
20.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	21.050	0,01
35.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	33.465	0,02
130.000	Constellation SE '144A' 5.625% 15-Jun-2028	136.885	0,07
10.000	Cooke Omega Investments Inc / Alpha VesselCo Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Dec-2022	10.186	0,01
25.000	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 5.625% 15-Nov-2026	20.651	0,01
12.000	CoreCivic Inc 4.625% 01-May-2023	12.229	0,01
170.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	169.612	0,09
12.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 6.750% 15-Aug-2024	10.803	0,01
160.000	Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029	166.835	0,09
135.000	Coty Inc '144A' 6.500% 15-Apr-2026	139.392	0,07
35.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	35.622	0,02
136.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	139.016	0,07
10.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	9.964	0,00
50.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	52.092	0,03
36.000	Credit Acceptance Corp '144A' 5.125% 31-Dec-2024	36.937	0,02
40.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5.750% 01-Apr-2025	40.940	0,02
15.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5.625% 01-May-2027	15.296	0,01
45.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029	46.807	0,02
64.000	Crocs Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2031	62.654	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
80.000	Crocs Inc '144A' 4.250% 15-Mar-2029	79.119	0,04
35.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	34.617	0,02
25.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	26.717	0,01
45.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	54.327	0,03
74.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	75.752	0,04
50.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	46.893	0,02
116.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	113.433	0,06
100.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	98.912	0,05
190.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	180.109	0,09
19.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	19.703	0,01
74.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	76.586	0,04
161.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	160.713	0,08
69.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	73.970	0,04
174.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	186.891	0,10
200.000	CSN Inova Ventures 'REGS' 6.750% 28-Jan-2028	210.393	0,11
12.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	12.465	0,01
420.000	CURO Finance LLC '144A' 7.500% 01-Aug-2028	422.625	0,22
50.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	50.356	0,03
25.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	26.786	0,01
35.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	34.163	0,02
170.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	169.833	0,09
20.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	21.006	0,01
20.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	21.278	0,01
100.000	Danaos Corp '144A' 8.500% 01-Mar-2028	109.642	0,06
200.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 6.750% 15-Feb-2025	208.425	0,11
35.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	36.173	0,02
40.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	42.691	0,02
230.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	224.091	0,12
316.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	324.077	0,17
5.000	DCP Midstream Operating LP 3.875% 15-Mar-2023	5.133	0,00
50.000	DCP Midstream Operating LP 5.125% 15-May-2029	56.571	0,03
25.000	DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-Jul-2025	27.341	0,01
45.000	DCP Midstream Operating LP 5.625% 15-Jul-2027	50.895	0,03
15.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037	20.085	0,01
55.000	DCP Midstream Operating LP '144A' FRN 5.850% 21-May-2043	53.579	0,03
25.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	26.058	0,01
15.000	Del Monte Foods Inc '144A' 11.875% 15-May-2025	16.732	0,01
160.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	164.336	0,09
85.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	88.521	0,05
25.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	25.511	0,01
100.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	102.683	0,05
94.000	Delta Air Lines Inc 3.800% 19-Apr-2023	96.142	0,05
60.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	64.024	0,03
40.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	47.129	0,02
60.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 3.729% 14-Jan-2032	61.476	0,03
45.000	Diebold Nixdorf Inc '144A' 9.375% 15-Jul-2025	48.503	0,03
150.000	Digicel International Finance Ltd/Digicel International Holdings Ltd 'REGS' 8.750% 25-May-2024	154.095	0,08
210.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	215.212	0,11
105.000	DISH DBS Corp 5.000% 15-Mar-2023	107.745	0,06
55.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	50.139	0,03
160.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	164.422	0,09
40.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	40.564	0,02
202.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	213.373	0,11
250.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	254.319	0,13
220.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	222.612	0,12
100.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	98.875	0,05
13.000	DPL Inc 4.350% 15-Apr-2029	13.831	0,01

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
116.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	164.371	0,09	
150.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	153.812	0,08	
150.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	156.231	0,08	
25.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 6.875% 15-Aug-2026	26.027	0,01	
150.000	Eagle Intermediate Global Holding BV/Ruyi US Finance LLC 'REGS' 7.500% 01-May-2025	135.996	0,07	
200.000	Easy Tactic Ltd 8.125% 27-Feb-2023	74.500	0,04	
130.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	138.118	0,07	
80.000	eG Global Finance Plc '144A' 6.750% 07-Feb-2025	81.083	0,04	
30.000	Elanco Animal Health Inc 5.272% 28-Aug-2023	31.952	0,02	
25.000	Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028	29.035	0,01	
125.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	123.877	0,06	
125.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	125.804	0,07	
200.000	Emaar Sukuk Ltd 'EMTN' 3.635% 15-Sep-2026	208.056	0,11	
120.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	134.597	0,07	
20.000	Embraer Netherlands Finance BV 5.050% 15-Jun-2025	20.719	0,01	
170.000	Embraer Netherlands Finance BV 5.400% 01-Feb-2027	177.544	0,09	
50.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	51.808	0,03	
20.000	Enact Holdings Inc '144A' 6.500% 15-Aug-2025	21.870	0,01	
75.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	78.013	0,04	
11.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	11.332	0,01	
50.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	50.951	0,03	
48.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	49.511	0,03	
65.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	68.958	0,04	
55.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2025	58.257	0,03	
170.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 6.000% 30-Jun-2028	126.910	0,07	
35.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 9.500% 31-Jul-2027	35.664	0,02	
150.000	Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	147.296	0,08	
20.000	Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	18.628	0,01	
155.000	Energear Israel Finance Ltd '144A' 4.875% 30-Mar-2026	154.225	0,08	
200.000	Energear Israel Finance Ltd '144A' 5.375% 30-Mar-2028	197.750	0,10	
30.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	29.324	0,02	
30.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	30.683	0,02	
20.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	20.601	0,01	
10.000	EnerSys '144A' 4.375% 15-Dec-2027	10.389	0,01	
40.000	EnerSys '144A' 5.000% 30-Apr-2023	41.349	0,02	
10.000	EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029	10.242	0,01	
40.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	41.658	0,02	
20.000	EnLink Midstream Partners LP 4.400% 01-Apr-2024	20.921	0,01	
25.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	26.340	0,01	
20.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	19.329	0,01	
25.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	25.257	0,01	
10.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	10.100	0,01	
40.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 01-Sep-2024	40.957	0,02	
33.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	34.066	0,02	
10.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	10.468	0,01	
25.000	Ensign Drilling Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2024	24.154	0,01	
61.000	Enstar Finance LLC FRN 5.750% 01-Sep-2040	62.682	0,03	
60.000	Entegris Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2028	61.884	0,03	
25.000	Envision Healthcare Corp '144A' 8.750% 15-Oct-2026	14.403	0,01	
20.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2026	20.674	0,01	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
87.000	EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024	90.463	0,05	
79.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	81.058	0,04	
27.000	EQM Midstream Partners LP 4.750% 15-Jul-2023	28.108	0,01	
65.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	71.104	0,04	
25.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	30.410	0,02	
140.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	145.807	0,08	
70.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	74.136	0,04	
30.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	32.659	0,02	
140.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	156.976	0,08	
80.000	EQT Corp 3.900% 01-Oct-2027	86.000	0,04	
30.000	EQT Corp 5.000% 15-Jan-2029	33.268	0,02	
65.000	EQT Corp 6.625% 01-Feb-2025	73.370	0,04	
30.000	EQT Corp 7.500% 01-Feb-2030	38.597	0,02	
200.000	Evraz Plc 'REGS' 5.375% 20-Mar-2023	207.382	0,11	
120.000	Exela Intermediate LLC / Exela Finance Inc '144A' 10.000% 15-Jul-2023	95.308	0,05	
25.000	Fair Isaac Corp '144A' 5.250% 15-May-2026	27.495	0,01	
15.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	14.529	0,01	
40.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	38.786	0,02	
20.000	Finance of America Funding LLC '144A' 7.875% 15-Nov-2025	19.755	0,01	
200.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 15-Oct-2027	215.469	0,11	
135.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	131.425	0,07	
142.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	142.076	0,07	
60.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	58.199	0,03	
50.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	49.762	0,03	
35.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	33.781	0,02	
45.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	44.550	0,02	
120.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	117.900	0,06	
109.000	FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027	117.542	0,06	
135.000	FirstEnergy Corp 4.750% 15-Mar-2023	140.569	0,07	
65.000	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	77.558	0,04	
110.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	148.709	0,08	
35.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 2.866% 15-Sep-2028	35.121	0,02	
8.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.350% 15-Jan-2025	8.514	0,00	
50.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049	57.414	0,03	
55.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044	69.756	0,04	
120.000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15-Nov-2025	125.297	0,07	
130.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 6.875% 15-Jan-2025	130.291	0,07	
30.000	Fluor Corp 3.500% 15-Dec-2024	31.447	0,02	
50.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	52.519	0,03	
200.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	210.346	0,11	
20.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	21.320	0,01	
35.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15-May-2024	37.136	0,02	
20.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	27.861	0,01	
460.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	471.960	0,25	
150.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	163.810	0,09	
135.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	149.246	0,08	
80.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	94.145	0,05	
10.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	11.771	0,01	
30.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	36.116	0,02	
30.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	41.371	0,02	
50.000	Ford Motor Co 7.500% 01-Aug-2026	58.943	0,03	
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.700% 10-Aug-2026	202.000	0,11	
30.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028	30.118	0,02	
65.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.087% 09-Jan-2023	66.184	0,03	
25.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 04-May-2023	25.502	0,01	
30.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.370% 17-Nov-2023	30.975	0,02	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-Nov-2025	208.047	0,11
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.625% 17-Jun-2031	105.125	0,05
95.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	98.781	0,05
20.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	20.770	0,01
20.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	21.175	0,01
25.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	26.938	0,01
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024	158.023	0,08
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	54.031	0,03
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	159.357	0,08
25.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.140% 15-Feb-2023	25.626	0,01
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	53.807	0,03
75.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-Aug-2023	78.130	0,04
20.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	21.746	0,01
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	53.803	0,03
155.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	176.385	0,09
175.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16-Jun-2025	190.540	0,10
75.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024	80.907	0,04
155.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	167.188	0,09
30.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	30.895	0,02
10.000	Forterra Finance LLC / FRTA Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jul-2025	10.623	0,01
121.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	125.205	0,07
90.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	100.890	0,05
200.000	Fortune Star BVI Ltd 5.000% 18-May-2026	193.475	0,10
200.000	Fortune Star BVI Ltd 6.750% 02-Jul-2023	204.420	0,11
55.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027	53.820	0,03
30.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026	30.669	0,02
10.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.125% 15-Nov-2024	10.135	0,01
24.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.250% 15-Apr-2025	24.595	0,01
160.000	Freeport-McMoRan Inc 4.125% 01-Mar-2028	166.230	0,09
60.000	Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-Aug-2028	63.011	0,03
35.000	Freeport-McMoRan Inc 4.550% 14-Nov-2024	37.544	0,02
60.000	Freeport-McMoRan Inc 4.625% 01-Aug-2030	64.450	0,03
90.000	Freeport-McMoRan Inc 5.000% 01-Sep-2027	93.726	0,05
30.000	Freeport-McMoRan Inc 5.250% 01-Sep-2029	32.901	0,02
110.000	Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043	138.494	0,07
50.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	50.070	0,03
177.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	182.630	0,10
90.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	95.314	0,05
50.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	50.336	0,03
70.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	72.907	0,04
60.000	FS Energy and Power Fund '144A' 7.500% 15-Aug-2023	62.632	0,03
108.000	FXI Holdings Inc '144A' 7.875% 01-Nov-2024	110.154	0,06
30.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250% 15-Nov-2026	33.789	0,02
155.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	158.453	0,08
90.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	89.159	0,05
50.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	49.807	0,03
100.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	107.960	0,06
25.000	Gartner Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2029	25.317	0,01
80.000	Gartner Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2030	81.907	0,04
30.000	Gartner Inc '144A' 4.500% 01-Jul-2028	31.380	0,02
10.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026	10.336	0,01
70.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	71.939	0,04
16.000	GCP Applied Technologies Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2026	16.416	0,01
200.000	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 'REGS' 7.125% 31-Jul-2026	205.923	0,11

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
30.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	29.281	0,02
20.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.500% 01-Oct-2025	19.771	0,01
66.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	66.588	0,03
165.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	170.227	0,09
100.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	99.134	0,05
60.000	Genworth Holdings Inc 4.800% 15-Feb-2024	62.464	0,03
105.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	109.188	0,06
35.000	GEO Group Inc/The 5.875% 15-Oct-2024	30.985	0,02
100.000	GEO Group Inc/The 6.000% 15-Apr-2026	80.784	0,04
10.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	10.602	0,01
200.000	GFH Sukuk Ltd 7.500% 28-Jan-2025	207.242	0,11
10.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	9.866	0,00
66.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	66.742	0,03
155.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	152.163	0,08
20.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	20.600	0,01
56.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2029	55.560	0,03
20.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	20.825	0,01
20.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	21.300	0,01
80.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	82.618	0,04
225.906	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024	218.251	0,11
115.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029	118.045	0,06
96.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	97.211	0,05
115.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	120.586	0,06
95.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	98.658	0,05
35.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	34.769	0,02
20.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	20.703	0,01
150.000	goeasys Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	152.783	0,08
20.000	goeasys Ltd '144A' 5.375% 01-Dec-2024	20.571	0,01
150.000	Gol Finance SA 'REGS' 7.000% 31-Jan-2025	132.157	0,07
50.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	52.469	0,03
150.000	Golden Nugget Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2024	150.195	0,08
10.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	10.599	0,01
20.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000% 15-Mar-2028	22.925	0,01
34.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	36.794	0,02
60.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.000% 15-Jul-2029	64.566	0,03
150.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.250% 15-Jul-2031	163.080	0,08
85.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	88.379	0,05
50.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	51.825	0,03
10.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	9.989	0,00
50.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	49.697	0,03
10.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 4.750% 15-Jul-2027	10.834	0,01
110.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	113.360	0,06
115.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	114.477	0,06
111.000	Gray Television Inc '144A' 7.000% 15-May-2027	118.752	0,06
35.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029	36.103	0,02
65.000	Greif Inc '144A' 6.500% 01-Mar-2027	67.508	0,04
50.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5.750% 01-Dec-2025	50.941	0,03
81.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	84.233	0,04
159.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	158.668	0,08
87.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	86.478	0,04



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
150.000	Grupo Aval Ltd 'REGS' 4.375% 04-Feb-2030	143.926	0,07
145.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual) 5.950% 17-Apr-2023	150.275	0,08
150.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA 'REGS' 5.500% 29-Apr-2026	159.301	0,08
60.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	62.310	0,03
10.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	10.335	0,01
175.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.625% 15-May-2024	183.447	0,10
75.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	80.250	0,04
14.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	14.277	0,01
75.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	80.357	0,04
65.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	65.737	0,03
60.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025	62.460	0,03
8.972	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	8.893	0,00
40.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	41.904	0,02
256.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	271.072	0,14
292.000	HCA Inc 5.375% 01-Feb-2025	321.288	0,17
100.000	HCA Inc 5.375% 01-Sep-2026	112.505	0,06
69.000	HCA Inc 5.625% 01-Sep-2028	80.742	0,04
40.000	HCA Inc 5.875% 01-May-2023	42.401	0,02
110.000	HCA Inc 5.875% 15-Feb-2026	124.303	0,06
54.000	HCA Inc 5.875% 01-Feb-2029	64.431	0,03
20.000	HCA Inc 7.050% 01-Dec-2027	24.651	0,01
10.000	HCA Inc 7.500% 15-Nov-2095	14.625	0,01
12.000	HCA Inc 7.690% 15-Jun-2025	14.191	0,01
60.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	64.367	0,03
100.000	Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl '144A' 4.625% 01-May-2028	98.433	0,05
101.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	107.419	0,06
90.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	93.708	0,05
59.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	57.914	0,03
90.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	90.683	0,05
100.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000% 01-Dec-2029	100.266	0,05
15.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	15.641	0,01
63.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	64.961	0,03
115.000	Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027	123.637	0,06
135.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	147.406	0,08
145.000	Hexion Inc '144A' 7.875% 15-Jul-2027	153.120	0,08
10.000	H-Food Holdings LLC / Hearthsides Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	10.010	0,00
25.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	25.715	0,01
25.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	25.803	0,01
80.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	82.700	0,04
20.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	21.053	0,01
55.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	61.383	0,03
35.000	Hillenbrand Inc 5.750% 15-Jun-2025	36.610	0,02
10.000	Hill-Rom Holdings Inc '144A' 4.375% 15-Sep-2027	10.456	0,01
69.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	73.850	0,04
90.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	89.676	0,05
25.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	25.223	0,01
80.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	82.019	0,04
120.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025	124.996	0,07
40.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	42.792	0,02
35.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 4.875% 01-Jul-2031	35.053	0,02

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
68.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	69.806	0,04
45.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	46.395	0,02
55.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	54.046	0,03
12.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	11.981	0,01
25.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	25.039	0,01
50.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	52.655	0,03
25.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	23.215	0,01
120.000	Horizon Therapeutics USA Inc '144A' 5.500% 01-Aug-2027	126.210	0,07
70.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	71.035	0,04
65.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	65.746	0,03
65.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	69.320	0,04
125.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	128.241	0,07
100.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	100.240	0,05
40.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	45.740	0,02
131.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	155.099	0,08
200.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	209.100	0,11
100.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	102.877	0,05
70.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	74.303	0,04
60.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	65.687	0,03
145.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	162.436	0,08
85.000	Hunt Cos Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2029	83.847	0,04
30.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	31.535	0,02
115.000	IAA Inc '144A' 5.500% 15-Jun-2027	119.284	0,06
30.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	29.295	0,02
60.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	62.329	0,03
140.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	144.033	0,08
194.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	202.304	0,11
20.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	20.372	0,01
110.000	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	114.246	0,06
219.000	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	231.182	0,12
70.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	72.877	0,04
130.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	139.988	0,07
5.000	IHS Markit Ltd 3.625% 01-May-2024	5.257	0,00
10.000	IHS Markit Ltd 4.125% 01-Aug-2023	10.474	0,01
25.000	IHS Markit Ltd 4.250% 01-May-2029	28.521	0,01
20.000	IHS Markit Ltd 4.750% 01-Aug-2028	23.253	0,01
10.000	IHS Markit Ltd '144A' 4.000% 01-Mar-2026	10.833	0,01
30.000	IHS Markit Ltd '144A' 4.750% 15-Feb-2025	32.741	0,02
200.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	212.302	0,11
165.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	173.595	0,09
10.000	Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028	10.678	0,01
170.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	174.493	0,09
45.000	Indika Energy Capital IV Pte Ltd 'REGS' 8.250% 22-Oct-2025	46.856	0,02
10.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2024	10.319	0,01
25.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	24.382	0,01
90.000	Ingevity Corp '144A' 4.500% 01-Feb-2026	90.324	0,05
150.000	Inkia Energy Ltd 'REGS' 5.875% 09-Nov-2027	156.211	0,08
10.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	10.882	0,01
55.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	57.281	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	Summe mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
100.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028	103.000	0,05
20.000	Interface Inc '144A' 5.500% 01-Dec-2028	20.979	0,01
70.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	72.192	0,04
30.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	31.834	0,02
50.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	56.050	0,03
30.000	Intertape Polymer Group Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2029	30.045	0,02
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	214.478	0,11
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	221.504	0,12
150.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	154.748	0,08
17.000	Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025	16.763	0,01
200.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029	215.044	0,11
19.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	19.522	0,01
206.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	213.488	0,11
20.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	21.180	0,01
74.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	74.925	0,04
69.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	71.656	0,04
119.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	123.355	0,06
10.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	10.290	0,01
165.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	171.884	0,09
182.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	192.122	0,10
11.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	11.788	0,01
20.000	iStar Inc 4.250% 01-Aug-2025	20.479	0,01
25.000	iStar Inc 4.750% 01-Oct-2024	25.968	0,01
11.000	iStar Inc 5.500% 15-Feb-2026	11.397	0,01
200.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' 5.125% 13-May-2023	209.876	0,11
195.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	193.370	0,10
215.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	215.533	0,11
150.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	162.375	0,08
110.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	111.280	0,06
200.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	207.434	0,11
105.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	107.795	0,06
10.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.875% 15-Dec-2027	10.265	0,01
200.000	JGSH Philippines Ltd 4.375% 23-Jan-2023	206.632	0,11
6.000	Joseph T Ryerson & Son Inc '144A' 8.500% 01-Aug-2028	6.534	0,00
10.000	JPW Industries Holding Corp '144A' 9.000% 01-Oct-2024	10.477	0,01
10.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2026	10.660	0,01
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30-Jun-2024	53.500	0,03
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd 10.500% 15-Jan-2025	53.000	0,03
200.000	Kaisa Group Holdings Ltd 11.250% 16-Apr-2025	53.000	0,03
184.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	186.983	0,10
95.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	103.829	0,05
30.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	35.205	0,02
15.000	KB Home 7.625% 15-May-2023	15.786	0,01
8.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	8.598	0,00
20.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	20.055	0,01
25.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	25.600	0,01
100.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	101.522	0,05
20.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	20.630	0,01
25.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 4.750% 01-Jun-2027	25.869	0,01
160.000	Klabn Austria GmbH 'REGS' 5.750% 03-Apr-2029	174.434	0,09
200.000	KOC Holding AS 'REGS' 5.250% 15-Mar-2023	201.312	0,10
30.000	Koninklijke KPN NV '144A' FRN 7.000% 28-Mar-2073	31.641	0,02
145.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	145.242	0,08
15.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	15.472	0,01

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	Summe mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
170.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.125% 04-Apr-2026	165.318	0,09
162.000	Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026	169.688	0,09
100.000	Kraft Heinz Foods Co 3.750% 01-Apr-2030	108.145	0,06
135.000	Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-May-2027	146.069	0,08
150.000	Kraft Heinz Foods Co 4.250% 01-Mar-2031	170.915	0,09
269.000	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	316.130	0,16
50.000	Kraft Heinz Foods Co 4.625% 01-Oct-2039	58.801	0,03
107.000	Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049	134.869	0,07
50.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 15-Jul-2035	61.298	0,03
150.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042	186.932	0,10
167.000	Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045	213.111	0,11
60.000	Kraft Heinz Foods Co 5.500% 01-Jun-2050	81.678	0,04
20.000	Kraft Heinz Foods Co 6.375% 15-Jul-2028	24.861	0,01
50.000	Kraft Heinz Foods Co 6.500% 09-Feb-2040	71.228	0,04
70.000	Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-Jan-2039	103.041	0,05
65.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039	99.071	0,05
10.000	Kratos Defense & Security Solutions Inc '144A' 6.500% 30-Nov-2025	10.297	0,01
50.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027	47.210	0,02
200.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd 4.229% 29-Oct-2026	188.976	0,10
200.000	KWG Group Holdings Ltd 5.875% 10-Nov-2024	146.500	0,08
35.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	36.137	0,02
30.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	30.949	0,02
85.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	89.229	0,05
10.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	10.124	0,01
100.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	97.528	0,05
55.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	55.876	0,03
35.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	36.581	0,02
40.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	43.357	0,02
45.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	45.947	0,02
55.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	54.459	0,03
105.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	108.074	0,06
95.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	95.617	0,05
113.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	118.763	0,06
127.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	119.878	0,06
11.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027	11.094	0,01
30.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2025	31.305	0,02
35.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	35.221	0,02
200.000	Lenovo Group Ltd 'EMTN' 5.875% 24-Apr-2025	220.653	0,12
65.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	61.851	0,03
190.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	180.808	0,09
115.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	114.036	0,06
90.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	91.936	0,05
30.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	30.632	0,02
150.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.125% 30-Jun-2025	158.912	0,08
20.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.500% 30-Jun-2027	21.511	0,01
50.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	53.883	0,03
85.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	84.807	0,04
10.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	10.964	0,01
25.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	27.285	0,01
35.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	32.953	0,02
10.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	13.882	0,01
55.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	56.990	0,03
30.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	29.893	0,02
128.117	Ligado Networks LLC '144A' 15.500% 01-Nov-2023	103.989	0,05
5.933	Ligado Networks LLC '144A' 17.500% 01-May-2024	2.729	0,00
100.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	101.927	0,05
100.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	103.000	0,05
55.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2031	58.791	0,03
10.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2027	10.532	0,01

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
10.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	9.950	0,00	
144.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	148.176	0,08	
40.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	40.442	0,02	
15.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	15.524	0,01	
50.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	54.748	0,03	
70.000	LogMeln Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	70.913	0,04	
45.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029	46.144	0,02	
80.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.375% 15-May-2031	81.918	0,04	
10.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2027	10.364	0,01	
35.000	LSB Industries Inc '144A' 6.250% 15-Oct-2028	36.450	0,02	
130.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	131.604	0,07	
13.000	Lumen Technologies Inc 5.625% 01-Apr-2025	13.766	0,01	
80.000	Lumen Technologies Inc 6.750% 01-Dec-2023	86.490	0,04	
25.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	27.849	0,01	
69.000	Lumen Technologies Inc 7.500% 01-Apr-2024	75.638	0,04	
10.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	10.739	0,01	
10.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	10.775	0,01	
100.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	101.580	0,05	
80.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	77.525	0,04	
130.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	135.478	0,07	
11.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	11.483	0,01	
10.000	Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-Feb-2023	10.113	0,01	
31.000	Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-Jun-2024	31.730	0,02	
60.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	52.738	0,03	
40.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	39.561	0,02	
95.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	100.788	0,05	
100.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	106.790	0,06	
100.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	100.153	0,05	
55.000	Magellan Health Inc 4.900% 22-Sep-2024	59.595	0,03	
10.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	10.263	0,01	
130.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	136.978	0,07	
200.000	MARB BondCo Pte 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	191.326	0,10	
100.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	117.364	0,06	
35.000	Marriott Ownership Resorts Inc 4.750% 15-Jan-2028	35.577	0,02	
65.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	68.261	0,04	
10.000	MasTec Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	10.402	0,01	
90.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	92.822	0,05	
130.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	126.454	0,07	
15.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	16.071	0,01	
45.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	45.897	0,02	
25.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	26.329	0,01	
50.000	Mattel Inc '144A' 3.375% 01-Apr-2026	51.329	0,03	
130.000	Mattel Inc '144A' 5.875% 15-Dec-2027	139.924	0,07	
88.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	88.921	0,05	
124.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	124.453	0,06	
18.000	Maxar Space Robotics LLC '144A' 9.750% 31-Dec-2023	19.413	0,01	
41.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A' 10.125% 01-Aug-2024	42.015	0,02	
200.000	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS' 7.250% 30-Jun-2031	199.441	0,10	
50.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	49.688	0,03	
100.000	Medco Bell Pte Ltd 'REGS' 6.375% 30-Jan-2027	99.850	0,05	
100.000	Medco Oak Tree Pte Ltd 'REGS' 7.375% 14-May-2026	103.625	0,05	
68.000	MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	71.227	0,04	
80.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	83.982	0,04	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
100.000	MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027	106.643	0,06	
40.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 04-Dec-2029	38.862	0,02	
200.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	197.250	0,10	
63.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	62.288	0,03	
50.000	MercadoLibre Inc 3.125% 14-Jan-2031	47.322	0,02	
25.000	Meritage Homes Corp 6.000% 01-Jun-2025	27.939	0,01	
10.000	Meritor Inc '144A' 4.500% 15-Dec-2028	10.040	0,00	
30.000	Meritor Inc '144A' 6.250% 01-Jun-2025	31.305	0,02	
140.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	145.753	0,08	
10.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	10.486	0,01	
10.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	10.510	0,01	
10.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	10.575	0,01	
80.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	80.445	0,04	
200.000	Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026	208.976	0,11	
100.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	98.359	0,05	
49.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	51.519	0,03	
10.000	MGIC Investment Corp 5.750% 15-Aug-2023	10.575	0,01	
150.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15-May-2024	149.664	0,08	
80.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	80.282	0,04	
19.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 01-Sep-2026	20.464	0,01	
35.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 15-Jan-2028	37.895	0,02	
50.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01-May-2024	53.499	0,03	
20.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.750% 01-Feb-2027	22.624	0,01	
160.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2029	168.230	0,09	
160.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2025	170.910	0,09	
135.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	140.542	0,07	
50.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	51.574	0,03	
70.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	74.626	0,04	
70.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	75.407	0,04	
55.000	MGM Resorts International 6.000% 15-Mar-2023	57.545	0,03	
20.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	20.920	0,01	
200.000	MHP SE 'REGS' 7.750% 10-May-2024	204.273	0,11	
40.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	40.016	0,02	
65.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	64.136	0,03	
80.000	Midas OpCo Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	82.027	0,04	
140.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	146.189	0,08	
10.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5.375% 15-Aug-2027	10.310	0,01	
3.947	Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6.000% 15-Mar-2025	4.069	0,00	
75.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	75.489	0,04	
162.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	176.388	0,09	
25.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	27.000	0,01	
35.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	36.329	0,02	
200.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	190.563	0,10	
105.000	Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026	110.375	0,06	
50.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	51.947	0,03	
45.000	Mong Duong Finance Holdings BV 'REGS' 5.125% 07-May-2029	43.659	0,02	
42.000	Moog Inc '144A' 4.250% 15-Dec-2027	42.382	0,02	
55.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	51.482	0,03	
5.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	5.011	0,00	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	Mountain Province Diamonds Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2022	9.274	0,00
340.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029	339.480	0,18
150.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 5.250% 01-Oct-2029	152.358	0,08
150.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	152.290	0,08
80.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	76.201	0,04
77.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	81.368	0,04
75.000	MSCI Inc '144A' 3.250% 15-Aug-2033	75.960	0,04
110.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Sep-2030	112.644	0,06
70.000	MSCI Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2031	72.996	0,04
116.000	MSCI Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2029	121.413	0,06
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS' 6.500% 13-Oct-2026	224.054	0,12
15.000	Murphy Oil Corp 5.750% 15-Aug-2025	15.427	0,01
50.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027	51.642	0,03
80.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	85.149	0,04
15.000	Murphy Oil Corp 6.375% 01-Dec-2042	15.021	0,01
5.000	Murphy Oil Corp 6.875% 15-Aug-2024	5.111	0,00
40.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	42.157	0,02
11.000	Murphy Oil USA Inc 5.625% 01-May-2027	11.452	0,01
120.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	119.422	0,06
180.614	MV24 Capital BV 'REGS' 6.748% 01-Jun-2034	186.534	0,10
105.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	96.678	0,05
25.000	Nathan's Famous Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	25.605	0,01
5.000	National CineMedia LLC '144A' 5.875% 15-Apr-2028	4.495	0,00
55.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	56.183	0,03
110.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	114.707	0,06
10.000	Natural Resource Partners LP / NRP Finance Corp '144A' 9.125% 30-Jun-2025	10.192	0,01
40.000	Navient Corp 5.500% 25-Jan-2023	41.708	0,02
12.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	12.807	0,01
85.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	94.047	0,05
12.000	Navient Corp 7.250% 25-Sep-2023	12.942	0,01
115.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	109.699	0,06
145.000	Navient Corp 'MTN' 6.125% 25-Mar-2024	154.752	0,08
50.000	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc 'REGS' 10.750% 01-Jul-2025	52.368	0,03
70.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	66.139	0,03
50.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	49.844	0,03
32.000	NCL Corp Ltd '144A' 10.250% 01-Feb-2026	37.232	0,02
26.000	NCL Corp Ltd '144A' 12.250% 15-May-2024	30.836	0,02
90.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	88.801	0,05
61.000	NCR Corp '144A' 5.000% 01-Oct-2028	62.923	0,03
50.000	NCR Corp '144A' 5.125% 15-Apr-2029	51.850	0,03
50.000	NCR Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2030	51.450	0,03
110.000	NCR Corp '144A' 5.750% 01-Sep-2027	115.060	0,06
12.000	NCR Corp '144A' 6.125% 01-Sep-2029	12.874	0,01
80.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 3.625% 28-Jun-2031	78.115	0,04
180.000	Neptune Energy Bondco Pte '144A' 6.625% 15-May-2025	184.165	0,10
100.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	103.428	0,05
50.000	Netflix Inc 4.375% 15-Nov-2026	55.406	0,03
105.000	Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028	119.881	0,06
15.000	Netflix Inc 5.750% 01-Mar-2024	16.329	0,01
167.000	Netflix Inc 5.875% 15-Feb-2025	187.873	0,10
235.000	Netflix Inc 5.875% 15-Nov-2028	282.982	0,15
17.000	Netflix Inc 6.375% 15-May-2029	21.149	0,01
120.000	Netflix Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2025	126.583	0,07
44.000	Netflix Inc '144A' 4.875% 15-Jun-2030	51.391	0,03
15.000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029	17.838	0,01
80.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.975% 03-Mar-2026	80.335	0,04
20.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	21.428	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
200.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	198.724	0,10
145.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	146.643	0,08
110.000	New Gold Inc '144A' 7.500% 15-Jul-2027	116.985	0,06
30.000	New Residential Investment Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	30.164	0,02
62.000	Newell Brands Inc 4.350% 01-Apr-2023	63.937	0,03
218.000	Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026	238.007	0,12
40.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	43.649	0,02
42.000	Newell Brands Inc 6.000% 01-Apr-2046	53.949	0,03
14.000	Newmark Group Inc 6.125% 15-Nov-2023	14.994	0,01
55.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	55.645	0,03
160.000	Nexa Resources SA 'REGS' 5.375% 04-May-2027	169.962	0,09
50.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	51.029	0,03
101.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	105.675	0,05
76.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	80.687	0,04
11.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.500% 15-Sep-2027	11.891	0,01
130.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	130.559	0,07
240.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	247.825	0,13
65.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 01-Nov-2023	64.093	0,03
195.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 4.500% 15-Jul-2029	192.125	0,10
90.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.625% 01-Oct-2028	93.078	0,05
150.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.875% 01-Oct-2030	158.595	0,08
110.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	116.923	0,06
105.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	119.332	0,06
20.000	Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027	21.624	0,01
120.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	120.720	0,06
85.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	83.641	0,04
155.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	156.596	0,08
200.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	186.812	0,10
60.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	67.663	0,04
135.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	142.617	0,07
45.000	Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	46.885	0,02
25.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	24.540	0,01
25.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	27.285	0,01
100.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	100.992	0,05
129.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	128.394	0,07
140.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	147.417	0,08
116.000	NRG Energy Inc 5.750% 15-Jan-2028	122.800	0,06
23.000	NRG Energy Inc 6.625% 15-Jan-2027	23.938	0,01
25.000	NRG Energy Inc '144A' 3.375% 15-Feb-2029	24.533	0,01
35.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2031	34.185	0,02
100.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2032	98.158	0,05
52.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	55.786	0,03
50.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	52.925	0,03
55.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	59.242	0,03
12.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	13.033	0,01
40.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	44.461	0,02
30.000	Oasis Petroleum Inc '144A' 6.375% 01-Jun-2026	31.544	0,02
150.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	153.282	0,08
17.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Jun-2025	17.430	0,01
75.000	Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047	73.614	0,04
45.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	45.073	0,02
20.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	19.976	0,01
46.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	47.237	0,02
66.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049	66.925	0,03
20.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	20.630	0,01
40.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	41.561	0,02
100.000	Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025	110.975	0,06
85.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	94.722	0,05

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
75.000	Occidental Petroleum Corp 5.875% 01-Sep-2025	82.782	0,04
90.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	109.825	0,06
25.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	30.787	0,02
60.000	Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-Sep-2028	71.323	0,04
130.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	166.009	0,09
95.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	123.412	0,06
120.000	Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-Sep-2030	148.702	0,08
60.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	66.609	0,03
95.000	Occidental Petroleum Corp 7.150% 15-May-2028	111.563	0,06
99.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	130.387	0,07
57.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	76.174	0,04
15.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	19.821	0,01
15.000	Occidental Petroleum Corp 8.000% 15-Jul-2025	17.527	0,01
103.000	Occidental Petroleum Corp 8.500% 15-Jul-2027	128.596	0,07
80.000	Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030	108.138	0,06
95.000	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	95.584	0,05
50.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	49.196	0,03
130.000	OCI NV '144A' 4.625% 15-Oct-2025	135.012	0,07
140.000	OI European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	142.101	0,07
20.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	21.029	0,01
19.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	20.611	0,01
30.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3.875% 01-Sep-2028	30.793	0,02
50.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	49.499	0,03
50.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	49.076	0,03
80.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	78.804	0,04
30.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	32.662	0,02
82.000	OneMain Finance Corp 5.625% 15-Mar-2023	85.742	0,04
75.000	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	79.607	0,04
97.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	108.035	0,06
85.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	97.025	0,05
25.000	OneMain Finance Corp 8.875% 01-Jun-2025	26.780	0,01
20.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 15-Feb-2028	20.416	0,01
75.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 15-Feb-2030	77.366	0,04
200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	203.596	0,11
200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	209.295	0,11
59.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.250% 01-Feb-2028	63.512	0,03
15.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.375% 01-Jun-2025	15.840	0,01
12.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	12.294	0,01
140.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.250% 15-Jun-2025	145.742	0,08
60.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2023	62.911	0,03
10.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.375% 15-Aug-2025	10.786	0,01
70.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.625% 13-May-2027	73.920	0,04
50.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	50.115	0,03
120.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Reynolds Gro '144A' 4.000% 15-Oct-2027	116.858	0,06
80.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	79.521	0,04
10.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	11.089	0,01
129.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	128.545	0,07
10.000	Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7.750% 15-Dec-2025	10.146	0,01
120.000	Par Pharmaceutical Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2027	122.812	0,06
100.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	102.402	0,05
10.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	10.415	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
30.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	31.680	0,02
50.000	Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029	49.055	0,03
40.000	Parkland Corp '144A' 4.500% 01-Oct-2029	40.097	0,02
50.000	Parkland Corp '144A' 5.875% 15-Jul-2027	52.808	0,03
15.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	14.572	0,01
30.000	Party City Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	31.006	0,02
100.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	99.151	0,05
10.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	10.391	0,01
50.000	Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028	50.299	0,03
40.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	25.758	0,01
90.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 7.250% 15-Jun-2025	63.877	0,03
170.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9.250% 15-May-2025	161.900	0,08
40.000	PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp 6.875% 15-May-2023	38.942	0,02
25.000	PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026	25.844	0,01
73.000	PDC Energy Inc 6.125% 15-Sep-2024	73.991	0,04
85.000	Peninsula Pacific Entertainment LLC / Peninsula Pacific Entertainment Finance In '144A' 8.500% 15-Nov-2027	91.924	0,05
60.000	Penn National Gaming Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2027	61.266	0,03
135.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	129.994	0,07
45.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	46.288	0,02
100.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	101.140	0,05
140.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	145.145	0,08
80.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	79.494	0,04
44.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	45.970	0,02
85.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	89.029	0,05
200.000	Periana Holdings LLC/DE 5.950% 19-Apr-2026	213.426	0,11
120.000	Perrigo Co Plc 4.000% 15-Nov-2023	123.629	0,06
31.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	33.197	0,02
135.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	134.765	0,07
200.000	Petron Corp FRN (Perpetual) 5.950% 19-Apr-2026	207.000	0,11
55.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	56.544	0,03
65.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	70.721	0,04
35.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	36.875	0,02
50.000	PG&E Corp 5.250% 01-Jul-2030	52.525	0,03
171.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	172.148	0,09
15.000	Photo Holdings Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-Oct-2026	15.619	0,01
22.000	Picasso Finance Sub Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025	23.012	0,01
25.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	25.092	0,01
150.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 3.500% 01-Mar-2032	151.749	0,08
45.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 4.250% 15-Apr-2031	47.320	0,02
140.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 5.875% 30-Sep-2027	147.979	0,08
30.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6.875% 15-Mar-2027	30.780	0,02
100.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7.250% 15-Mar-2029	102.890	0,05
35.000	Plantronics Inc '144A' 4.750% 01-Mar-2029	33.432	0,02
73.000	Playtika Holding Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	71.651	0,04
70.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	71.021	0,04
235.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	233.618	0,12
150.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	153.047	0,08
165.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	173.565	0,09
99.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	105.044	0,05
13.000	Powdr Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2025	13.558	0,01
30.000	Precision Drilling Corp '144A' 6.875% 15-Jan-2029	30.619	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
50.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	50.999	0,03
100.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	99.359	0,05
10.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4.875% 01-Feb-2027	10.311	0,01
11.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8.250% 01-Feb-2028	11.731	0,01
50.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	52.134	0,03
110.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	116.729	0,06
105.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	101.405	0,05
10.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2024	10.652	0,01
190.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	204.218	0,11
149.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	155.597	0,08
150.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	148.746	0,08
85.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	104.125	0,05
136.000	PTC Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2025	138.013	0,07
10.000	PTC Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2028	10.191	0,01
200.000	Puma International Financing SA '144A' 5.125% 06-Oct-2024	200.870	0,10
35.000	Quebecor Media Inc 5.750% 15-Jan-2023	36.435	0,02
14.000	QVC Inc 4.375% 15-Mar-2023	14.436	0,01
55.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	54.681	0,03
30.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	31.682	0,02
90.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	92.578	0,05
20.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	19.828	0,01
15.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	14.965	0,01
70.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2028	66.744	0,03
45.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5.375% 01-Dec-2028	43.940	0,02
40.000	Radian Group Inc 4.500% 01-Oct-2024	41.942	0,02
112.000	Radian Group Inc 6.625% 15-Mar-2025	123.893	0,06
15.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	15.168	0,01
135.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	135.817	0,07
25.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	26.288	0,01
11.000	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A' 7.250% 01-Apr-2025	11.257	0,01
100.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125% 22-Apr-2026	100.670	0,05
100.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	105.750	0,06
90.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	93.041	0,05
20.000	Range Resources Corp 5.000% 15-Mar-2023	20.471	0,01
65.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	72.588	0,04
30.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	30.337	0,02
15.000	Rattler Midstream LP '144A' 5.625% 15-Jul-2025	15.615	0,01
120.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 5.500% 01-Jun-2024	120.450	0,06
56.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 7.625% 15-Jan-2026	59.430	0,03
45.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	44.993	0,02
120.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 4.875% 01-Jun-2023	123.277	0,06
134.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	137.554	0,07
55.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 7.625% 15-Jun-2025	58.355	0,03
17.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 9.375% 01-Apr-2027	18.379	0,01
180.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030	175.482	0,09
44.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A' 9.750% 01-Dec-2026	46.551	0,02
200.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 'REGS' 4.500% 14-Jul-2028	200.848	0,10
69.000	Renewable Energy Group Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2028	70.994	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
25.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	24.562	0,01
200.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	198.952	0,10
100.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	100.886	0,05
50.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	51.050	0,03
60.000	Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027	54.887	0,03
40.000	Rite Aid Corp '144A' 7.500% 01-Jul-2025	41.162	0,02
50.000	Rite Aid Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2026	51.058	0,03
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd 5.200% 12-Jan-2026	187.328	0,10
45.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	44.586	0,02
95.000	ROBLOX Corp '144A' 3.875% 01-May-2030	96.521	0,05
60.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	61.900	0,03
75.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	75.389	0,04
95.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	96.571	0,05
20.000	Rocket Software Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2029	19.540	0,01
10.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	10.311	0,01
99.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	103.357	0,05
60.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	64.063	0,03
10.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	11.317	0,01
10.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	11.316	0,01
75.000	Rockpoint Gas Storage Canada Ltd '144A' 7.000% 31-Mar-2023	75.258	0,04
200.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	203.226	0,11
180.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750% 15-Oct-2027	199.242	0,10
20.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	18.806	0,01
60.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	69.510	0,04
45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	43.636	0,02
100.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	101.792	0,05
165.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	167.191	0,09
44.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jun-2023	46.585	0,02
40.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023	43.751	0,02
179.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	200.706	0,10
60.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	60.604	0,03
105.000	RR Donnelley & Sons Co '144A' 6.125% 01-Nov-2026	115.500	0,06
140.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 5.250% 10-Jan-2028	144.410	0,08
30.000	Sabre GLBL Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	31.391	0,02
15.000	Sabre GLBL Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2025	16.967	0,01
200.000	Sasol Financing USA LLC 5.875% 27-Mar-2024	208.962	0,11
200.000	Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028	216.992	0,11
105.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	108.289	0,06
165.000	SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029	158.654	0,08
200.000	Scenery Journey Ltd 12.000% 24-Oct-2023	27.500	0,01
110.000	Schweitzer-Mauduit International Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	115.228	0,06
140.000	Science Applications International Corp '144A' 4.875% 01-Apr-2028	143.713	0,07
54.000	Scientific Games International Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2025	55.665	0,03
120.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	127.999	0,07
50.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	55.833	0,03
60.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.250% 15-Mar-2026	63.226	0,03
40.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.625% 01-Jul-2025	42.748	0,02
95.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	91.349	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
75.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	70.230	0,04
35.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	36.538	0,02
60.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	63.094	0,03
111.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	115.044	0,06
160.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	166.694	0,09
105.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jun-2023	109.858	0,06
80.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	85.684	0,04
115.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	122.067	0,06
20.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	21.820	0,01
110.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	126.931	0,07
50.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	52.178	0,03
10.000	Sealed Air Corp '144A' 5.125% 01-Dec-2024	10.722	0,01
10.000	Sealed Air Corp '144A' 5.250% 01-Apr-2023	10.373	0,01
50.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	55.362	0,03
40.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	50.907	0,03
100.000	Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029	101.140	0,05
140.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	142.766	0,07
95.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	100.795	0,05
161.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	170.682	0,09
40.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.875% 15-Oct-2023	42.049	0,02
50.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	54.302	0,03
125.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.625% 01-Nov-2024	137.740	0,07
60.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	59.936	0,03
20.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	21.029	0,01
100.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	101.393	0,05
50.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	52.259	0,03
20.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	21.478	0,01
15.000	Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027	18.057	0,01
42.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	38.701	0,02
50.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	48.804	0,03
60.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	59.315	0,03
11.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	10.682	0,01
42.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	39.961	0,02
15.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	15.360	0,01
50.000	Shelf Drilling Holdings Ltd 'REGS' 8.250% 15-Feb-2025	36.556	0,02
25.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	25.931	0,01
150.000	Shriram Transport Finance Co Ltd 'REGS' 5.100% 16-Jul-2023	153.180	0,08
50.000	Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026	48.240	0,02
55.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	56.255	0,03
35.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	34.533	0,02
200.000	Simpar Europe SA 'REGS' 5.200% 26-Jan-2031	186.790	0,10
70.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	71.123	0,04
65.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	65.104	0,03
200.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	196.445	0,10
190.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	191.391	0,10
165.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	165.293	0,09
90.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	93.652	0,05
88.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	94.968	0,05
64.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31-Jul-2024	64.713	0,03
60.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	64.144	0,03
100.000	SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025	104.605	0,05
5.000	SM Energy Co 6.500% 15-Jul-2028	5.182	0,00
30.000	SM Energy Co 6.625% 15-Jan-2027	30.931	0,02
30.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	30.856	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	SM Energy Co '144A' 10.000% 15-Jan-2025	11.010	0,01
200.000	SMC Global Power Holdings Corp FRN (Perpetual) 7.000% 21-Oct-2025	208.000	0,11
67.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	70.420	0,04
25.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	26.651	0,01
140.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	144.228	0,08
200.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	210.931	0,11
155.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	164.132	0,09
20.000	Southwestern Energy Co 7.750% 01-Oct-2027	21.595	0,01
70.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	73.436	0,04
20.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	21.004	0,01
15.000	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2027	15.323	0,01
20.000	Spirit AeroSystems Inc 3.950% 15-Jun-2023	20.179	0,01
135.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	135.542	0,07
65.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 5.500% 15-Jan-2025	67.422	0,03
76.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	79.799	0,04
18.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	19.855	0,01
170.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	215.336	0,11
212.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	318.356	0,17
288.000	Sprint Corp 7.125% 15-Jun-2024	323.689	0,17
100.000	Sprint Corp 7.625% 15-Feb-2025	115.127	0,06
95.000	Sprint Corp 7.625% 01-Mar-2026	114.177	0,06
280.000	Sprint Corp 7.875% 15-Sep-2023	308.763	0,16
130.000	SRM Escrow Issuer LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	139.124	0,07
100.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	100.657	0,05
105.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	106.199	0,06
103.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	107.759	0,06
76.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	73.340	0,04
120.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	122.627	0,06
40.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	41.373	0,02
30.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	30.919	0,02
220.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	226.336	0,12
100.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	94.354	0,05
12.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	12.493	0,01
110.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	110.838	0,06
60.000	Stena AB '144A' 7.000% 01-Feb-2024	62.140	0,03
155.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	152.904	0,08
14.000	Stericycle Inc '144A' 5.375% 15-Jul-2024	14.294	0,01
10.000	Stevens Holding Co Inc '144A' 6.125% 01-Oct-2026	10.673	0,01
30.000	Strathcona Resources Ltd '144A' 6.875% 01-Aug-2026	29.519	0,02
50.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	51.795	0,03
81.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	82.049	0,04
10.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	10.489	0,01
25.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	25.977	0,01
50.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2026	52.149	0,03
300.000	Sunac China Holdings Ltd 6.650% 03-Aug-2024	193.500	0,10
200.000	Sunac China Holdings Ltd 8.350% 19-Apr-2023	133.000	0,07
120.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	119.581	0,06
25.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	25.430	0,01
20.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	21.178	0,01
150.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027	156.585	0,08
50.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	51.466	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
10.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	10.085	0,00	
94.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	99.969	0,05	
90.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	86.635	0,05	
60.000	Switch Ltd '144A' 3.750% 15-Sep-2028	60.536	0,03	
50.000	Talen Energy Supply LLC 6.500% 01-Jun-2025	19.948	0,01	
25.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 6.625% 15-Jan-2028	21.973	0,01	
70.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7.250% 15-May-2027	62.020	0,03	
90.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7.625% 01-Jun-2028	80.236	0,04	
30.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10.500% 15-Jan-2026	12.931	0,01	
20.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	20.820	0,01	
115.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	114.425	0,06	
55.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	59.593	0,03	
70.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	73.398	0,04	
45.000	Tap Rock Resources LLC '144A' 7.000% 01-Oct-2026	46.847	0,02	
45.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.875% 01-Feb-2031	48.946	0,03	
60.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.000% 15-Jan-2028	63.319	0,03	
13.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 01-Feb-2027	13.413	0,01	
176.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.500% 01-Mar-2030	192.576	0,10	
35.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15-Apr-2026	36.566	0,02	
55.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.500% 15-Jul-2027	59.019	0,03	
160.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	179.226	0,09	
40.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 4.000% 15-Jan-2032	41.869	0,02	
12.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.625% 01-Mar-2024	12.792	0,01	
15.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2023	15.728	0,01	
10.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	11.014	0,01	
10.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	11.189	0,01	
10.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	11.210	0,01	
10.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2027	10.556	0,01	
30.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	28.269	0,01	
47.000	TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026	50.338	0,03	
94.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	95.209	0,05	
100.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	102.431	0,05	
30.000	Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029	30.510	0,02	
70.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	74.142	0,04	
20.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	21.566	0,01	
85.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	97.597	0,05	
105.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	123.562	0,06	
85.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	89.569	0,05	
10.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	10.414	0,01	
40.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	41.265	0,02	
200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	207.000	0,11	
30.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	26.580	0,01	
40.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	37.606	0,02	
15.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	11.655	0,01	
95.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	96.799	0,05	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
200.000	Tenet Healthcare Corp 6.750% 15-Jun-2023	213.992	0,11	
50.000	Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	57.198	0,03	
100.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.250% 01-Jun-2029	101.727	0,05	
100.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15-Jan-2030	101.446	0,05	
50.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 01-Sep-2024	51.178	0,03	
25.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	25.724	0,01	
155.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 01-Jan-2026	159.443	0,08	
145.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 01-Nov-2027	151.205	0,08	
223.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028	235.991	0,12	
115.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027	119.181	0,06	
85.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	87.467	0,05	
41.625	Termocandelaria Power Ltd 'REGS' 7.875% 30-Jan-2029	41.710	0,02	
25.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.250% 31-Jan-2023	25.589	0,01	
30.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	31.496	0,02	
25.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	26.516	0,01	
69.000	Terrier Media Buyer Inc '144A' 8.875% 15-Dec-2027	74.679	0,04	
15.000	Teraviva Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	17.306	0,01	
99.000	Teva Pharmaceutical Finance Co BV 2.950% 18-Dec-2022	99.217	0,05	
40.000	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC 6.150% 01-Feb-2036	41.988	0,02	
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.150% 01-Oct-2026	282.471	0,15	
40.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.100% 01-Oct-2046	33.863	0,02	
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6.000% 15-Apr-2024	209.740	0,11	
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6.750% 01-Mar-2028	213.303	0,11	
20.000	Texas Capital Bank NA 'BKNT' 5.250% 31-Jan-2026	21.668	0,01	
200.000	Times China Holdings Ltd 6.750% 16-Jul-2023	151.000	0,08	
25.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	25.401	0,01	
120.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	126.304	0,07	
30.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	30.707	0,02	
100.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	108.142	0,06	
200.000	TMK OAO Via TMK Capital SA 4.300% 12-Feb-2027	200.906	0,10	
85.000	T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026	85.342	0,04	
115.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Apr-2026	115.725	0,06	
35.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Feb-2029	34.536	0,02	
115.000	T-Mobile USA Inc 2.875% 15-Feb-2031	113.773	0,06	
115.000	T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	117.377	0,06	
55.000	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2031	57.295	0,03	
174.000	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	183.436	0,10	
11.000	T-Mobile USA Inc 5.375% 15-Apr-2027	11.458	0,01	
80.000	T-Mobile USA Inc '144A' 2.250% 15-Feb-2026	80.322	0,04	
80.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3.375% 15-Apr-2029	81.654	0,04	
150.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3.500% 15-Apr-2031	156.259	0,08	
80.000	Toll Brothers Finance Corp 4.350% 15-Feb-2028	87.715	0,05	
20.000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15-Mar-2027	22.395	0,01	
23.596	Topaz Solar Farms LLC '144A' 4.875% 30-Sep-2039	26.749	0,01	
18.991	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	22.674	0,01	
65.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	65.581	0,03	
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV 'REGS' 6.375% 20-Sep-2028	189.502	0,10	
30.000	TPro Acquisition Corp '144A' 11.000% 15-Oct-2024	32.757	0,02	
45.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	52.246	0,03	
80.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	79.879	0,04	
65.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	65.377	0,03	
236.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	243.499	0,13	
90.000	TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026	92.574	0,05	
13.000	TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027	13.598	0,01	
354.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	368.387	0,19	
185.000	TransDigm Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2025	195.409	0,10	



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
73.700	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15-Jan-2024	69.907	0,04
25.000	Transocean Inc '144A' 11.500% 30-Jan-2027	24.526	0,01
2.500	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.750% 15-Oct-2024	2.531	0,00
77.050	Transocean Pontus Ltd '144A' 6.125% 01-Aug-2025	75.397	0,04
65.000	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	62.874	0,03
57.500	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.250% 01-Dec-2024	56.809	0,03
12.497	Transocean Sentry Ltd '144A' 5.375% 15-May-2023	12.059	0,01
40.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	42.540	0,02
20.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	21.810	0,01
98.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	108.784	0,06
12.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	11.538	0,01
20.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	21.495	0,01
35.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	38.548	0,02
10.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 9.250% 01-Aug-2024	10.462	0,01
145.000	TriMas Corp '144A' 4.125% 15-Apr-2029	145.577	0,08
45.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	44.896	0,02
50.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	52.456	0,03
10.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	10.194	0,01
15.000	TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025	15.840	0,01
35.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	33.618	0,02
105.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	104.322	0,05
135.000	Triumph Group Inc '144A' 6.250% 15-Sep-2024	135.992	0,07
90.000	Triumph Group Inc '144A' 8.875% 01-Jun-2024	98.195	0,05
160.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	169.360	0,09
127.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	127.071	0,07
20.000	Tronox Inc '144A' 6.500% 01-May-2025	21.158	0,01
100.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025	81.890	0,04
200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	203.378	0,11
200.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS 'REGS' 5.750% 15-Oct-2025	199.000	0,10
200.000	Türkiye Is Bankasi AS 'REGS' 6.125% 25-Apr-2024	194.986	0,10
65.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	65.573	0,03
10.000	Twitter Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2027	10.458	0,01
23.653	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02-Jul-2022	24.186	0,01
115.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	117.325	0,06
60.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	63.129	0,03
150.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 02-Sep-2027	163.425	0,09
150.000	Uber Technologies Inc '144A' 8.000% 01-Nov-2026	159.973	0,08
200.000	Ulker Bisküvi Sanayi AS 'REGS' 6.950% 30-Oct-2025	189.444	0,10
170.000	Ultrapar International SA 'REGS' 5.250% 06-Jun-2029	175.957	0,09
10.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	10.325	0,01
145.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459% 30-Jun-2035	158.294	0,08
45.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	49.195	0,03
150.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	180.098	0,09
10.000	Unisys Corp '144A' 6.875% 01-Nov-2027	10.840	0,01
14.005	United Airlines 2016-1 Class B Pass Through Trust 3.650% 07-Jan-2026	13.876	0,01
14.562	United Airlines 2018-1 Class B Pass Through Trust 4.600% 01-Mar-2026	14.800	0,01
10.000	United Airlines Holdings Inc 5.000% 01-Feb-2024	10.367	0,01
140.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	146.167	0,08
140.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	144.666	0,08
15.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	16.084	0,01
130.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	132.174	0,07
20.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	20.579	0,01
153.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	161.048	0,08
35.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	37.937	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
84.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	87.460	0,05
20.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	24.229	0,01
30.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	30.595	0,02
35.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	34.393	0,02
35.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	35.123	0,02
175.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	168.656	0,09
100.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	99.808	0,05
80.000	Univar Solutions USA Inc/Washington '144A' 5.125% 01-Dec-2027	83.591	0,04
125.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	126.473	0,07
150.000	Univision Communications Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2025	151.687	0,08
95.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	102.459	0,05
75.000	Univision Communications Inc '144A' 9.500% 01-May-2025	80.232	0,04
150.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	153.242	0,08
50.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	51.573	0,03
70.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	73.398	0,04
47.379	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	47.244	0,02
45.865	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	46.375	0,02
180.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	183.218	0,10
85.000	US Foods Inc '144A' 6.250% 15-Apr-2025	88.598	0,05
21.000	US Renal Care Inc '144A' 10.625% 15-Jul-2027	21.336	0,01
16.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	16.658	0,01
117.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	123.704	0,06
80.000	USI Inc/NY '144A' 6.875% 01-May-2025	80.688	0,04
30.000	Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	31.230	0,02
40.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	38.791	0,02
45.000	Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030	45.976	0,02
145.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	141.313	0,07
150.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	155.593	0,08
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc 'REGS' 8.950% 11-Mar-2025	195.250	0,10
200.000	Vedanta Resources Ltd 'REGS' 6.125% 09-Aug-2024	174.250	0,09
50.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025	48.052	0,02
80.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	83.133	0,04
100.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	105.174	0,05
150.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	159.259	0,08
200.000	VEON Holdings BV '144A' 3.375% 25-Nov-2027	195.562	0,10
100.000	VEON Holdings BV '144A' 4.000% 09-Apr-2025	101.979	0,05
100.000	Vericast Corp '144A' 11.000% 15-Sep-2026	106.125	0,06
225.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7.500% 01-Sep-2025	233.169	0,12
100.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	101.171	0,05
60.000	ViacomCBS Inc FRN 6.250% 28-Feb-2057	67.658	0,04
50.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	50.311	0,03
10.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	10.311	0,01
35.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	35.137	0,02
70.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2027	72.381	0,04
122.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2030	129.226	0,07
65.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.250% 01-Dec-2026	67.781	0,04
95.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029	101.265	0,05
48.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	49.153	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
110.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	110.708	0,06
85.000	Videotron Ltd '144A' 5.125% 15-Apr-2027	87.635	0,05
35.000	Videotron Ltd '144A' 5.375% 15-Jun-2024	37.486	0,02
50.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	47.660	0,02
150.000	Viking Cruises Ltd '144A' 13.000% 15-May-2025	169.875	0,09
45.000	Vine Energy Holdings LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	48.904	0,03
20.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	20.682	0,01
170.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	169.415	0,09
200.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	210.845	0,11
125.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 10.500% 01-Jun-2024	133.880	0,07
90.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	90.328	0,05
55.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.000% 31-Jul-2027	57.148	0,03
55.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2027	56.720	0,03
50.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	49.081	0,03
200.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	202.862	0,11
15.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	14.872	0,01
55.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	54.012	0,03
100.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	99.158	0,05
85.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	87.049	0,05
155.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	187.689	0,10
140.000	VTR Finance NV 'REGS' 6.375% 15-Jul-2028	145.804	0,08
130.000	W&T Offshore Inc '144A' 9.750% 01-Nov-2023	124.285	0,06
200.000	Wanda Properties International Co Ltd 7.250% 29-Jan-2024	190.192	0,10
60.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	63.132	0,03
40.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	39.842	0,02
30.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	31.230	0,02
120.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	124.777	0,06
32.000	Weatherford International Ltd '144A' 11.000% 01-Dec-2024	32.993	0,02
20.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 4.875% 15-Sep-2028	20.630	0,01
10.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	10.486	0,01
140.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	148.579	0,08
108.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	118.578	0,06
200.000	West China Cement Ltd 4.950% 08-Jul-2026	191.175	0,10
25.000	Western Global Airlines LLC '144A' 10.375% 15-Aug-2025	27.840	0,01
100.000	Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025	104.626	0,05
20.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	21.811	0,01
23.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	25.057	0,01
135.000	Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028	149.369	0,08
129.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030	142.288	0,07
27.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	32.574	0,02
8.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	9.571	0,00
10.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048	11.974	0,01
65.000	Western Midstream Operating LP 6.500% 01-Feb-2050	76.961	0,04
15.000	WeWork Cos Inc '144A' 7.875% 01-May-2025	14.348	0,01
155.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	161.808	0,08
40.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	41.390	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
25.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15-Aug-2028	25.849	0,01
99.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	105.136	0,05
60.000	Winnebago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	64.335	0,03
100.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	99.913	0,05
75.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.875% 15-Jul-2030	76.326	0,04
45.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 8.500% 15-Nov-2024	41.784	0,02
50.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 9.000% 15-Nov-2026	47.556	0,02
25.000	World Acceptance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	25.089	0,01
35.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	35.993	0,02
30.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 01-Oct-2024	31.615	0,02
165.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	169.331	0,09
20.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	20.633	0,01
150.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 4.250% 30-May-2023	151.286	0,08
105.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	107.462	0,06
175.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	180.486	0,09
50.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	45.500	0,02
200.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	188.223	0,10
200.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.625% 26-Aug-2028	185.500	0,10
60.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	60.990	0,03
50.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.750% 15-Apr-2025	52.488	0,03
20.000	Xerox Corp 3.800% 15-May-2024	20.734	0,01
105.000	Xerox Corp 4.375% 15-Mar-2023	108.596	0,06
91.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	101.614	0,05
150.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2025	159.158	0,08
159.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.500% 15-Aug-2028	167.821	0,09
75.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	76.441	0,04
65.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	68.826	0,04
40.000	XPO Logistics Inc '144A' 6.250% 01-May-2025	41.901	0,02
200.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' 5.500% 06-Dec-2022	197.915	0,10
40.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	39.912	0,02
120.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	127.732	0,07
11.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	13.972	0,01
115.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	124.653	0,06
20.000	Yum! Brands Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2025	21.099	0,01
200.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 7.375% 13-Jan-2026	58.000	0,03
103.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	101.573	0,05
100.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	98.653	0,05
150.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	161.044	0,08
27.000	Ziff Davis Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2030	27.738	0,01
150.000	Ziggo BV '144A' 5.500% 15-Jan-2027	154.299	0,08
78.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3.875% 01-Feb-2029	77.444	0,04
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>183.957.110</b>	<b>96,16</b>

**Credit Default Swaps - 462.608  
(31. Dezember 2020: 120.241)**

(4.000.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 37 5.000% 20-Dec-2026	368.132	0,19
-------------	---	---------	------

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps Forts.</b>			
(700.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026	94.476	0,05
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>462.608</b>	<b>0,24</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.415.514 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 24.869)			
		3.415.514	1,79
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>187.835.232</b>	<b>98,19</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (363.707) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (43.183))			
		(363.707)	(0,19)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(363.707)</b>	<b>(0,19)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>3.827.135</b>	<b>2,00</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>191.298.660</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,86
Derivative OTC-Finanzinstrumente	2,02
Sonstiges Umlaufvermögen	2,12
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		

**BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund**

Euro	US-Dollar	660.000	746.669	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	4.898	
						<b>USD</b>	<b>4.898</b>
US-Dollar	Euro	39.511.126	34.914.000	14. Jan. 22	Goldman Sachs	(246.721)	
US-Dollar	Euro	136.488	120.000	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(160)	
US-Dollar	Pfund Sterling	4.387.605	3.315.000	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(99.306)	
						<b>USD</b>	<b>(346.187)</b>

**BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged)**

Dänische Krone	US-Dollar	106.561	16.212	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	105	
						<b>USD</b>	<b>105</b>
						<b>DKK</b>	<b>686</b>

**BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	15.075	17.064	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	99	
Euro	US-Dollar	997	1.129	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6	
Euro	US-Dollar	3.605	4.096	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	56.063.608	63.446.476	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	395.202	
Euro	US-Dollar	1.581	1.793	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7	
Euro	US-Dollar	1.836.659	2.072.796	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18.675	
Euro	US-Dollar	480	540	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7	
Euro	US-Dollar	1.127	1.279	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	3.224	3.633	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39	
Euro	US-Dollar	47.772	53.970	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	430	
Euro	US-Dollar	522	592	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	5.101	5.775	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33	
						<b>USD</b>	<b>414.515</b>
						<b>EUR</b>	<b>364.088</b>
US-Dollar	Euro	5.774	5.101	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(34)	
US-Dollar	Euro	2.426	2.145	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17)	
US-Dollar	Euro	3.155	2.777	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
US-Dollar	Euro	383	338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	7.531	6.673	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(68)	
US-Dollar	Euro	3.479	3.079	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(27)	
US-Dollar	Euro	7.031	6.240	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(75)	
US-Dollar	Euro	1.381	1.218	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
US-Dollar	Euro	1.129	997	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	17.068	15.075	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)	
						<b>USD</b>	<b>(341)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(300)</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	11.732	13.277	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		83
						<b>USD</b>	<b>83</b>
						<b>EUR</b>	<b>73</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	10.636	12.036	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		75
						<b>USD</b>	<b>75</b>
						<b>EUR</b>	<b>66</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	11.691	13.231	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		82
						<b>USD</b>	<b>82</b>
						<b>EUR</b>	<b>72</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	10.662	12.066	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		75
						<b>USD</b>	<b>75</b>
						<b>EUR</b>	<b>66</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	11.718	13.261	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		83
						<b>USD</b>	<b>83</b>
						<b>EUR</b>	<b>73</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)</b>							
Norwegische Krone	US-Dollar	107.434	11.935	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		262
						<b>USD</b>	<b>262</b>
						<b>NOK</b>	<b>2.307</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)</b>							
Schwedische Krone	US-Dollar	107.028	11.826	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		19
						<b>USD</b>	<b>19</b>
						<b>SEK</b>	<b>172</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	15.165	20.340	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		187
Pfund Sterling	US-Dollar	1.007	1.360	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		4
Pfund Sterling	US-Dollar	26.978	35.684	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		831
Pfund Sterling	US-Dollar	18.401	24.835	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		72
Pfund Sterling	US-Dollar	64.313	85.386	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.662
Pfund Sterling	US-Dollar	39.573	52.306	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.257
Pfund Sterling	US-Dollar	108.749	143.856	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3.338

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	36.138	47.947	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		966
Pfund Sterling	US-Dollar	79.982	106.611	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.646
Pfund Sterling	US-Dollar	39.216	51.914	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.165
Pfund Sterling	US-Dollar	35.004	46.233	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.146
Pfund Sterling	US-Dollar	27.225	36.132	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		717
Pfund Sterling	US-Dollar	38.339	51.239	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		653
Pfund Sterling	US-Dollar	22.742	30.522	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		260
Pfund Sterling	US-Dollar	33.545.887	44.316.502	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.088.446
Pfund Sterling	US-Dollar	57.610	76.242	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.734
Pfund Sterling	US-Dollar	26.579	35.649	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		326
Pfund Sterling	US-Dollar	41.571	55.800	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		467
						<b>USD</b>	<b>1.104.877</b>
						<b>GBP</b>	<b>816.281</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	35.648	26.579	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(328)
US-Dollar	Pfund Sterling	24.834	18.401	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(73)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.683	13.369	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(412)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.341	15.165	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(186)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.360	1.007	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	68.759	51.789	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.338)
US-Dollar	Pfund Sterling	31.701	23.984	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(762)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.210	45.516	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.397)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.903	7.464	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(200)
US-Dollar	Pfund Sterling	59.490	44.938	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1.335)
US-Dollar	Pfund Sterling	104.305	78.972	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(2.585)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.983	21.838	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(575)
US-Dollar	Pfund Sterling	25.048	18.742	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(319)
US-Dollar	Pfund Sterling	33.780	25.169	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(288)
US-Dollar	Pfund Sterling	16.985	12.834	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(386)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.711	10.287	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(212)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.671	1.245	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(14)
						<b>USD</b>	<b>(10.414)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(7.694)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	79	106	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1
Pfund Sterling	US-Dollar	42	57	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		-
Pfund Sterling	US-Dollar	5.497	7.270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		169
Pfund Sterling	US-Dollar	24.188.408	31.954.607	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		784.829
Pfund Sterling	US-Dollar	140	186	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		4
Pfund Sterling	US-Dollar	6	8	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		-
Pfund Sterling	US-Dollar	402	531	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		12
Pfund Sterling	US-Dollar	4.086	5.401	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		130
Pfund Sterling	US-Dollar	4.241	5.631	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		110
Pfund Sterling	US-Dollar	4	5	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		-

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	167	225	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	6.532	8.761	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	80
US-Dollar	Pfund Sterling	57	42	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	4	3	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	5	4	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	26	20	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
<b>USD</b>						<b>785.336</b>
<b>GBP</b>						<b>580.205</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	8.760	6.532	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(81)
US-Dollar	Pfund Sterling	225	167	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	47	35	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	647	482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.143	3.848	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(65)
US-Dollar	Pfund Sterling	95	72	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	232	176	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Pfund Sterling	134	101	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	77	58	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.092	15.189	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(466)
US-Dollar	Pfund Sterling	441	333	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.564	1.178	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Pfund Sterling	106	79	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>USD</b>						<b>(673)</b>
<b>GBP</b>						<b>(497)</b>

**BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	1.963	2.633	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	24
Pfund Sterling	US-Dollar	2.377	3.207	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Pfund Sterling	US-Dollar	49.356	65.284	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.520
Pfund Sterling	US-Dollar	8.874	11.903	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	109
Pfund Sterling	US-Dollar	8.060	10.877	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	31
Pfund Sterling	US-Dollar	20.562	27.300	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	531
Pfund Sterling	US-Dollar	40.764	53.880	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.295
Pfund Sterling	US-Dollar	24.953	33.009	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	766
Pfund Sterling	US-Dollar	46.985	62.339	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.256
Pfund Sterling	US-Dollar	23.406	31.198	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	482
Pfund Sterling	US-Dollar	33.605	44.385	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.100
Pfund Sterling	US-Dollar	20.115	26.696	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	530
Pfund Sterling	US-Dollar	35.496	47.439	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	605
Pfund Sterling	US-Dollar	18.922	25.395	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	216
Pfund Sterling	US-Dollar	32.520.678	42.962.129	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.055.182
Pfund Sterling	US-Dollar	11.565	15.305	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	348
Pfund Sterling	US-Dollar	17.405	23.040	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	517

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	30.132	40.445	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	339
<b>USD</b>						<b>1.064.860</b>
<b>GBP</b>						<b>786.716</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	11.902	8.874	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(110)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.877	8.060	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.476	17.748	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(546)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.633	1.963	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.208	2.377	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	11.208	8.442	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(218)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.488	7.935	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(252)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.317	17.627	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(541)
US-Dollar	Pfund Sterling	40.388	30.441	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(814)
US-Dollar	Pfund Sterling	11.720	8.853	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(263)
US-Dollar	Pfund Sterling	43.248	32.744	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.072)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.462	21.445	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(565)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.110	13.550	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(231)
US-Dollar	Pfund Sterling	42.355	31.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(361)
US-Dollar	Pfund Sterling	15.497	11.710	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(352)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.186	13.643	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(281)
US-Dollar	Pfund Sterling	46.081	34.331	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(386)
<b>USD</b>						<b>(6.057)</b>
<b>GBP</b>						<b>(4.475)</b>

**BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	30	41	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	1.212.481	1.601.774	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39.341
Pfund Sterling	US-Dollar	38.678	51.692	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	659
Pfund Sterling	US-Dollar	2.321	3.080	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	61
Pfund Sterling	US-Dollar	400	528	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13
Pfund Sterling	US-Dollar	380	513	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	15.011	20.149	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	169
US-Dollar	Pfund Sterling	11	8	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	16	12	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	41	30	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
<b>USD</b>						<b>40.244</b>
<b>GBP</b>						<b>29.732</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	513	380	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	393	297	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	168	127	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	65	49	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	806	609	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(19)

**Aufstellung der Wertpapierbestände** zum 31. Dezember 2021

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	82	61	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
						<b>USD (35)</b>
						<b>GBP (26)</b>

# BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Kanadischer Dollar - 825.419</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.695.026)</b>		<b>825.419</b>	<b>3,99</b>
5.000	407 International Inc 3.830% 11-May-2046	4.475	0,02
5.000	407 International Inc 5.750% 14-Feb-2036	5.059	0,02
5.000	407 International Inc 'MTN' 2.840% 07-Mar-2050	3.801	0,02
5.000	407 International Inc 'MTN' 4.680% 07-Oct-2053	5.193	0,02
15.000	407 International Inc 'MTN' 5.960% 03-Dec-2035	16.135	0,08
5.000	55 Ontario School Board Trust/The 5.900% 02-Jun-2033	5.281	0,03
10.000	Algonquin Power Co 4.090% 17-Feb-2027	8.578	0,04
10.000	AltaLink LP 'MTN' 2.747% 29-May-2026	8.220	0,04
5.000	AltaLink LP 'MTN' 4.090% 30-Jun-2045	4.699	0,02
5.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 4.320% 15-May-2047	4.338	0,02
10.000	Bank of Montreal 2.280% 29-Jul-2024	8.028	0,04
10.000	Bank of Montreal 3.190% 01-Mar-2028	8.464	0,04
10.000	Bank of Montreal FRN 2.880% 17-Sep-2029	8.095	0,04
5.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.370% 03-Feb-2025	4.021	0,02
5.000	Bank of Nova Scotia/The 2.160% 03-Feb-2025	3.998	0,02
15.000	Bank of Nova Scotia/The 2.380% 01-May-2023	12.027	0,06
5.000	Bank of Nova Scotia/The 3.100% 02-Feb-2028	4.211	0,02
5.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 2.836% 03-Jul-2029	4.039	0,02
10.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.890% 18-Jan-2029	8.239	0,04
10.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 3.350% 12-Mar-2025	8.233	0,04
15.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 6.170% 26-Feb-2037	15.621	0,07
10.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN' 3.410% 09-Oct-2029	8.247	0,04
10.000	Brookfield Property Finance ULC 'MTN' 4.300% 01-Mar-2024	8.075	0,04
10.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 3.630% 15-Jan-2027	8.415	0,04
10.000	Bruce Power LP 3.969% 23-Jun-2026	8.497	0,04
2.000	Cameco Corp 2.950% 21-Oct-2027	1.597	0,01
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.000% 17-Apr-2025	7.951	0,04
5.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.970% 11-Jul-2023	4.059	0,02
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 3.290% 15-Jan-2024	8.181	0,04
5.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 2.010% 21-Jul-2030	3.937	0,02
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 3.450% 04-Apr-2028	8.091	0,04
5.000	Canadian National Railway Co 3.050% 08-Feb-2050	3.898	0,02
5.000	Canadian Tire Corp Ltd 'MTN' 6.570% 24-Feb-2034	4.978	0,02
10.000	Canadian Western Bank 2.597% 06-Sep-2024	8.060	0,04
15.000	Cenovus Energy Inc 3.550% 12-Mar-2025	12.310	0,06
2.000	CGI Inc 2.100% 18-Sep-2028	1.553	0,01
20.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 2.981% 04-Mar-2030	16.024	0,08
10.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.178% 08-Mar-2028	8.647	0,04
5.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.293% 08-Feb-2024	4.139	0,02
5.000	CU Inc 2.963% 07-Sep-2049	3.904	0,02
5.000	CU Inc 3.964% 27-Jul-2045	4.559	0,02
5.000	CU Inc 4.543% 24-Oct-2041	4.852	0,02
5.000	CU Inc 4.722% 09-Sep-2043	4.996	0,02
10.000	Emera Inc 2.900% 16-Jun-2023	8.061	0,04
5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.200% 02-Jun-2044	4.655	0,02
5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.500% 23-Nov-2043	4.828	0,02
10.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.880% 21-Jun-2041	9.953	0,05
10.000	Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 5.080% 19-Dec-2036	9.203	0,04
5.000	Energir Inc 3.530% 16-May-2047	4.360	0,02
10.000	Fairfax Financial Holdings Ltd 4.250% 06-Dec-2027	8.472	0,04
5.000	First Capital Real Estate Investment Trust 4.790% 30-Aug-2024	4.205	0,02
5.000	Greater Toronto Airports Authority 'MTN' 5.300% 25-Feb-2041	5.319	0,03
5.000	Great-West Lifeco Inc 3.337% 28-Feb-2028	4.208	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Kanadischer Dollar Forts.</b>			
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.670% 21-Mar-2033	5.433	0,03
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.740% 24-Nov-2031	5.341	0,03
5.000	Honda Canada Finance Inc 2.500% 04-Jun-2024	4.033	0,02
10.000	Honda Canada Finance Inc 3.444% 23-May-2025	8.320	0,04
15.000	HSBC Bank Canada 3.245% 15-Sep-2023	12.224	0,06
5.000	Hydro One Inc 7.350% 03-Jun-2030	5.402	0,03
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 2.540% 05-Apr-2024	4.047	0,02
10.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.630% 25-Jun-2049	8.828	0,04
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.720% 18-Nov-2047	4.455	0,02
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 6.590% 22-Apr-2043	6.173	0,03
5.000	IGM Financial Inc 4.206% 21-Mar-2050	4.584	0,02
5.000	Inter Pipeline Ltd/AB 'MTN' 2.608% 13-Sep-2023	3.998	0,02
15.000	Inter Pipeline Ltd/AB 'MTN' 4.637% 30-May-2044	11.863	0,06
10.000	John Deere Financial Inc 2.410% 14-Jan-2025	8.062	0,04
5.000	Loblaws Cos Ltd 4.488% 11-Dec-2028	4.461	0,02
5.000	Loblaws Cos Ltd 'MTN' 5.900% 18-Jan-2036	5.031	0,02
5.000	Macquarie Group Ltd FRN 2.723% 21-Aug-2029	3.933	0,02
15.000	Manulife Financial Corp FRN 2.818% 13-May-2035	12.021	0,06
10.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.950% 20-Mar-2028	7.785	0,04
10.000	Molson Coors International LP 3.440% 15-Jul-2026	8.204	0,04
10.000	Mondelez International Inc 3.250% 07-Mar-2025	8.230	0,04
10.000	National Bank of Canada 2.983% 04-Mar-2024	8.141	0,04
10.000	NAV Canada 7.400% 01-Jun-2027	10.034	0,05
5.000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 4.350% 10-Jan-2039	4.472	0,02
5.000	Pembina Pipeline Corp 4.020% 27-Mar-2028	4.247	0,02
10.000	Pembina Pipeline Corp 4.750% 26-Mar-2048	8.634	0,04
10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 3.310% 01-Feb-2030	8.125	0,04
10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.740% 21-Jan-2047	8.604	0,04
10.000	RioCan Real Estate Investment Trust 3.287% 12-Feb-2024	8.136	0,04
5.000	Rogers Communications Inc 3.250% 01-May-2029	4.065	0,02
10.000	Rogers Communications Inc 3.650% 31-Mar-2027	8.320	0,04
5.000	Rogers Communications Inc 4.000% 13-Mar-2024	4.120	0,02
5.000	Rogers Communications Inc 'MTN' 6.560% 22-Mar-2041	5.275	0,02
15.000	Royal Bank of Canada 2.328% 28-Jan-2027	11.997	0,06
5.000	Royal Bank of Canada 2.352% 02-Jul-2024	4.022	0,02
15.000	Royal Bank of Canada 2.609% 01-Nov-2024	12.144	0,06
5.000	Royal Bank of Canada 3.296% 26-Sep-2023	4.080	0,02
10.000	Royal Bank of Canada FRN 2.880% 23-Dec-2029	8.101	0,04
10.000	Shaw Communications Inc 4.350% 31-Jan-2024	8.274	0,04
5.000	Shaw Communications Inc 6.750% 09-Nov-2039	5.285	0,03
5.000	Sun Life Assurance Co of Canada 6.300% 15-May-2028	4.820	0,02
5.000	Sun Life Financial Inc 'MTN' FRN 5.400% 29-May-2042	5.038	0,02
15.000	Suncor Energy Inc 'MTN' 5.000% 09-Apr-2030	13.703	0,07
10.000	Sysco Canada Inc 3.650% 25-Apr-2025	8.299	0,04
10.000	TCHC Issuer Trust 4.877% 11-May-2037	10.031	0,05
5.000	TELUS Corp 3.150% 19-Feb-2030	4.092	0,02
5.000	TELUS Corp 5.150% 26-Nov-2043	4.717	0,02
15.000	TELUS Corp 'MTN' 3.350% 01-Apr-2024	12.255	0,06
5.000	TELUS Corp 'MTN' 4.400% 29-Jan-2046	4.304	0,02
2.000	Teranet Holdings LP 5.754% 17-Dec-2040	1.945	0,01
5.000	TMX Group Ltd 4.461% 03-Oct-2023	4.139	0,02
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.943% 13-Mar-2025	3.972	0,02
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 2.496% 02-Dec-2024	8.078	0,04
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.060% 26-Jan-2032	8.173	0,04
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.105% 22-Apr-2030	4.083	0,02
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.224% 25-Jul-2029	8.164	0,04
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.589% 14-Sep-2028	8.161	0,04
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 3.800% 05-Apr-2027	8.452	0,04
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 3.390% 15-Mar-2028	8.299	0,04

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Kanadischer Dollar Forts.</b>			
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 4.350% 06-Jun-2046	8.441	0,04
10.000	United Parcel Service Inc 2.125% 21-May-2024	8.009	0,04
10.000	Ventas Canada Finance Ltd 2.800% 12-Apr-2024	8.072	0,04
5.000	Ventas Canada Finance Ltd 4.125% 30-Sep-2024	4.166	0,02
15.000	VW Credit Canada Inc 2.850% 26-Sep-2024	12.189	0,06
10.000	Wells Fargo & Co 2.975% 19-May-2026	8.176	0,04
10.000	Wells Fargo & Co 3.184% 08-Feb-2024	8.148	0,04
<b>Euro - 4.725.066</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.438.007)</b>		<b>4.725.066</b>	<b>22,84</b>
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.000% 16-Apr-2025	11.766	0,06
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 2.500% 29-Nov-2023	11.989	0,06
100.000	Allianz SE FRN 3.099% 06-Jul-2047	126.969	0,61
15.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.750% 17-Mar-2036	20.277	0,10
50.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 5.125% 16-Sep-2024	65.204	0,31
100.000	AT&T Inc 1.800% 05-Sep-2026	120.975	0,58
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 14-Dec-2022	115.840	0,56
100.000	Bank of America Corp 'EMTN' 0.750% 26-Jul-2023	115.482	0,56
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 04-Nov-2026	120.014	0,58
50.000	BASF Finance Europe NV 'EMTN' 0.750% 10-Nov-2026	58.941	0,28
5.000	BASF SE 1.625% 15-Nov-2037	6.384	0,03
100.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030	118.787	0,57
25.000	Bayer AG FRN 2.375% 02-Apr-2075	28.721	0,14
35.000	Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2074	41.398	0,20
10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2027	11.535	0,06
5.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.000% 21-Jan-2025	5.877	0,03
10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.500% 06-Feb-2029	12.416	0,06
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 0.625% 03-Dec-2032	109.702	0,53
20.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2.375% 20-May-2024	24.112	0,12
20.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2.875% 26-Sep-2023	24.017	0,12
20.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 4.250% 25-Feb-2030	25.554	0,12
100.000	Coca-Cola Co/The 1.625% 09-Mar-2035	124.446	0,60
10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.375% 01-Sep-2027	11.349	0,05
5.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2023	5.746	0,03
10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 04-Dec-2026	11.492	0,06
5.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.625% 28-Aug-2024	5.774	0,03
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.000% 04-Mar-2026	17.566	0,08
10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.500% 28-Aug-2028	12.207	0,06
15.000	Continental AG 0.000% 12-Sep-2023	17.114	0,08
15.000	Continental AG 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2025	17.183	0,08
15.000	Cooperative Rabobank UA 4.125% 14-Jul-2025	19.604	0,09
15.000	Cooperative Rabobank UA 'GMTN' 1.250% 23-Mar-2026	17.919	0,09
25.000	Cooperative Rabobank UA 'GMTN' 1.375% 03-Feb-2027	30.292	0,15
15.000	Covestro AG 1.750% 25-Sep-2024	17.833	0,09
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029	121.158	0,59
20.000	Daimler AG 'EMTN' 1.000% 15-Nov-2027	23.845	0,12
15.000	Daimler AG 'EMTN' 1.500% 03-Jul-2029	18.562	0,09
10.000	Daimler AG 'EMTN' 2.000% 27-Feb-2031	12.892	0,06
10.000	Daimler AG 'EMTN' 2.125% 03-Jul-2037	13.264	0,06
10.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.625% 27-Feb-2023	11.518	0,06
20.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	23.693	0,11
20.000	Deutsche Bank AG 'MTN' 1.125% 30-Aug-2023	23.237	0,11
30.000	Deutsche Boerse AG 1.125% 26-Mar-2028	36.160	0,17
10.000	Deutsche Boerse AG 1.625% 08-Oct-2025	12.073	0,06
15.000	Deutsche Post AG 'EMTN' 0.375% 20-May-2026	17.281	0,08
15.000	Deutsche Post AG 'EMTN' 1.250% 01-Apr-2026	17.940	0,09
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034	12.074	0,06
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 25-Mar-2031	12.658	0,06
15.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 09-Dec-2049	17.716	0,09
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 2.250% 29-Mar-2039	13.325	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.875% 30-Jan-2024	11.629	0,06
15.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.375% 01-Dec-2025	17.928	0,09
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.375% 30-Jan-2027	12.080	0,06
15.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.500% 03-Apr-2028	18.324	0,09
20.000	E.ON International Finance BV 1.000% 13-Apr-2025	23.459	0,11
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	12.018	0,06
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.500% 31-Jul-2029	12.264	0,06
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 3.000% 17-Jan-2024	12.128	0,06
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033	8.607	0,04
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0.000% 18-Dec-2023	5.716	0,03
10.000	E.ON SE 'EMTN' 0.100% 19-Dec-2028	11.157	0,05
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0.250% 24-Oct-2026	5.714	0,03
10.000	E.ON SE 'EMTN' 0.375% 29-Sep-2027	11.476	0,06
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0.750% 18-Dec-2030	5.816	0,03
10.000	E.ON SE 'EMTN' 1.000% 07-Oct-2025	11.758	0,06
50.000	Enel SpA 'EMTN' 5.625% 21-Jun-2027	72.688	0,35
5.000	Engie SA 'EMTN' 3.000% 01-Feb-2023	5.904	0,03
5.000	Engie SA 'EMTN' 5.950% 16-Mar-2111	11.295	0,05
15.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 0.375% 07-Sep-2024	17.245	0,08
15.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 1.000% 23-Jan-2023	17.265	0,08
100.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	119.164	0,58
10.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.250% 29-Nov-2029	11.828	0,06
10.000	Fresenius SE & Co KGaA 1.875% 15-Feb-2025	11.960	0,06
30.000	General Electric Co 'EMTN' 4.125% 19-Sep-2035	46.635	0,23
15.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 4.000% 16-Jun-2025	19.477	0,09
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	18.828	0,09
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.125% 19-Aug-2024	17.114	0,08
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.875% 21-Jan-2030	11.451	0,06
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.375% 15-May-2024	5.814	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.625% 27-Jul-2026	12.028	0,06
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 27-Jul-2023	5.889	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028	12.308	0,06
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.000% 12-Feb-2031	13.451	0,06
30.000	Grenke Finance Plc 'EMTN' 1.500% 05-Oct-2023	34.100	0,16
25.000	HBOS Plc 'EMTN' FRN 4.500% 18-Mar-2030	31.992	0,15
10.000	HeidelbergCement AG 'EMTN' 2.250% 03-Jun-2024	11.955	0,06
20.000	Hella GmbH & Co KGaA 1.000% 17-May-2024	23.194	0,11
30.000	Knorr-Bremse AG 'EMTN' 1.125% 13-Jun-2025	35.326	0,17
30.000	LANXESS AG 'EMTN' 1.000% 07-Oct-2026	35.352	0,17
20.000	LANXESS AG 'EMTN' 1.125% 16-May-2025	23.505	0,11
10.000	Linde Finance BV 'EMTN' 1.875% 22-May-2024	11.949	0,06
30.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN' 0.750% 26-May-2024	34.831	0,17
30.000	Merck KGaA FRN 3.375% 12-Dec-2074	37.027	0,18
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' 1.750% 30-Jan-2025	119.615	0,58
10.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 0.625% 10-Nov-2023	11.567	0,06
15.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 1.250% 18-May-2026	17.865	0,09
85.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030	105.719	0,51
30.000	OMV AG 'EMTN' 1.000% 14-Dec-2026	35.514	0,17
10.000	Orange SA 'EMTN' 8.125% 28-Jan-2033	20.031	0,10
5.000	PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033	8.273	0,04



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
30.000	Roche Finance Europe BV 'EMTN' 0.875% 25-Feb-2025	35.167	0,17
10.000	RWE AG 0.625% 11-Jun-2031	11.184	0,05
100.000	Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	122.808	0,59
10.000	SAP SE 'EMTN' 1.000% 01-Apr-2025	11.762	0,06
10.000	SAP SE 'EMTN' 1.125% 20-Feb-2023	11.539	0,06
10.000	SAP SE 'EMTN' 1.750% 22-Feb-2027	12.321	0,06
30.000	Schaeffler AG 'EMTN' 1.875% 26-Mar-2024	35.109	0,17
20.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2.875% 26-Mar-2027	24.706	0,12
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.000% 05-Sep-2024	11.448	0,06
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0.375% 06-Sep-2023	11.528	0,06
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1.750% 22-Mar-2029	121.065	0,58
10.000	Stellantis NV 'EMTN' 2.000% 23-Mar-2024	11.861	0,06
15.000	Stellantis NV 'EMTN' 2.375% 14-Apr-2023	17.628	0,09
10.000	Telefonica Europe BV 'EMTN' 5.875% 14-Feb-2033	17.226	0,08
50.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.875% 01-Oct-2025	64.897	0,31
100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.125% 01-Mar-2025	114.112	0,55
50.000	TotalEnergies Capital SA 'EMTN' 5.125% 26-Mar-2024	63.642	0,31
100.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025	119.354	0,58
10.000	Toyota Motor Credit Corp 'EMTN' 2.375% 01-Feb-2023	11.725	0,06
100.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025	116.642	0,56
5.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 6.125% 25-Nov-2033	9.037	0,04
100.000	Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026	119.908	0,58
30.000	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 3.750% 02-Mar-2046	38.284	0,18
100.000	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 2.500% 31-Jul-2026	124.478	0,60
5.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 4.625% 24-Mar-2026	6.378	0,03
26.000	Vonovia Finance BV 1.500% 31-Mar-2025	30.893	0,15
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029	111.795	0,54
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 1.375% 26-Oct-2026	118.555	0,57
100.000	Wintershall Dea Finance BV 1.332% 25-Sep-2028	116.390	0,56
20.000	Wurth Finance International BV 'EMTN' 1.000% 26-May-2025	23.510	0,11
<b>Pfund Sterling - 859.008</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.053.411)</b>		<b>859.008</b>	<b>4,15</b>
5.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.250% 24-May-2029	6.997	0,03
15.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.850% 25-May-2037	21.780	0,10
10.000	Aviva Plc FRN 6.125% 14-Nov-2036	15.837	0,08
35.000	Barclays Bank Plc 'EMTN' 5.750% 14-Sep-2026	55.646	0,27
25.000	Citigroup Inc 'EMTN' 5.150% 21-May-2026	38.853	0,19
5.000	Coöperatieve Rabobank UA 'GMTN' 5.250% 23-May-2041	10.516	0,05
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.250% 03-Jun-2030	17.989	0,09
15.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.375% 07-Jun-2032	28.429	0,14
20.000	Freshwater Finance Plc 5.182% 20-Apr-2035	36.276	0,18
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.125% 25-Jul-2029	14.639	0,07
5.000	Hammerson Plc 6.000% 23-Feb-2026	7.461	0,04
10.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP FRN (Perpetual) 5.844% 05-Nov-2031	18.882	0,09
10.000	HSBC Bank Plc 'EMTN' 5.375% 22-Aug-2033	17.670	0,09
10.000	HSBC Bank Plc 'EMTN' 6.500% 07-Jul-2023	14.545	0,07
10.000	HSBC Bank Plc 'EMTN' FRN 5.375% 04-Nov-2030	15.252	0,07
10.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 5.750% 20-Dec-2027	15.967	0,08
20.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN' 5.875% 11-Dec-2031	37.259	0,18
5.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 6.500% 17-Sep-2040	11.367	0,05
10.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 7.625% 22-Apr-2025	16.064	0,08
50.000	London & Quadrant Housing Trust 5.500% 27-Jan-2040	102.072	0,49
8.000	McDonald's Corp 'EMTN' 5.875% 23-Apr-2032	14.830	0,07

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Pfund Sterling Forts.</b>			
30.000	Northern Powergrid Holdings Co 7.250% 15-Dec-2022	43.022	0,21
50.000	Orange SA 'EMTN' 5.375% 22-Nov-2050	110.383	0,53
20.000	Prudential Plc 'EMTN' 6.125% 19-Dec-2031	35.665	0,17
5.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 6.250% 07-Jun-2029	8.922	0,04
10.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN' 5.500% 05-Jun-2026	15.874	0,08
10.000	Sunderland SHG Finance Plc 6.380% 31-Mar-2042	18.711	0,09
10.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 6.750% 16-Nov-2028	17.699	0,09
5.000	THFC Funding No 1 Plc 5.125% 21-Dec-2035	9.193	0,04
10.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN' 5.625% 20-Dec-2027	16.727	0,08
15.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2025	20.607	0,10
10.000	Walmart Inc 5.250% 28-Sep-2035	19.331	0,09
5.000	Wessex Water Services Finance Plc 5.375% 10-Mar-2028	8.195	0,04
10.000	Western Power Distribution South West Plc 5.875% 25-Mar-2027	16.348	0,08
<b>US-Dollar - 13.202.095</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 27.936.158)</b>		<b>13.202.095</b>	<b>63,80</b>
5.000	3M Co 2.375% 26-Aug-2029	5.139	0,02
5.000	3M Co 'MTN' 5.700% 15-Mar-2037	6.973	0,03
5.000	Abbott Laboratories 1.400% 30-Jun-2030	4.833	0,02
15.000	Abbott Laboratories 3.875% 15-Sep-2025	16.310	0,08
10.000	Abbott Laboratories 6.150% 30-Nov-2037	14.792	0,07
10.000	AbbVie Inc 2.600% 21-Nov-2024	10.385	0,05
15.000	AbbVie Inc 2.950% 21-Nov-2026	15.824	0,08
10.000	AbbVie Inc 3.200% 21-Nov-2029	10.713	0,05
15.000	AbbVie Inc 3.600% 14-May-2025	15.968	0,08
15.000	AbbVie Inc 3.800% 15-Mar-2025	15.984	0,08
5.000	AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039	5.775	0,03
15.000	AbbVie Inc 4.250% 21-Nov-2049	18.030	0,09
5.000	AbbVie Inc 4.450% 14-May-2046	6.081	0,03
5.000	AbbVie Inc 4.500% 14-May-2035	6.008	0,03
10.000	AbbVie Inc 4.700% 14-May-2045	12.474	0,06
10.000	AbbVie Inc 4.850% 15-Jun-2044	12.596	0,06
25.000	AES Corp/The '144A' 3.300% 15-Jul-2025	25.972	0,13
10.000	Aetna Inc 2.800% 15-Jun-2023	10.250	0,05
5.000	Aetna Inc 4.500% 15-May-2042	5.950	0,03
5.000	Aetna Inc 6.625% 15-Jun-2036	7.112	0,03
5.000	Affiliated Managers Group Inc 4.250% 15-Feb-2024	5.315	0,03
15.000	Aflac Inc 3.250% 17-Mar-2025	15.871	0,08
5.000	Ahold Finance USA LLC 6.875% 01-May-2029	6.520	0,03
5.000	AlG SunAmerica Global Financing X '144A' 6.900% 15-Mar-2032	6.975	0,03
12.696	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030	12.846	0,06
5.000	Aircastle Ltd 4.250% 15-Jun-2026	5.364	0,03
5.000	Alexander Funding Trust '144A' 1.841% 15-Nov-2023	5.020	0,02
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 1.875% 01-Feb-2033	9.424	0,05
5.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 2.750% 15-Dec-2029	5.167	0,02
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.000% 18-May-2051	9.941	0,05
10.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.400% 06-Dec-2057	11.433	0,06
20.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 2.950% 25-Jan-2030	20.701	0,10
20.000	Allegion US Holding Co Inc 3.200% 01-Oct-2024	20.816	0,10
15.000	Allstate Corp/The 3.280% 15-Dec-2026	16.129	0,08
9.000	Allstate Corp/The FRN 5.750% 15-Aug-2053	9.362	0,05
5.000	Allstate Corp/The FRN 6.500% 15-May-2057	6.571	0,03
5.000	Ally Financial Inc 3.050% 05-Jun-2023	5.128	0,02
5.000	Ally Financial Inc 3.875% 21-May-2024	5.273	0,03
15.000	Altera Corp 4.100% 15-Nov-2023	15.872	0,08
15.000	Altria Group Inc 3.700% 04-Feb-2051	14.059	0,07
20.000	Altria Group Inc 4.800% 14-Feb-2029	22.596	0,11

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Altria Group Inc 5.375% 31-Jan-2044	5.799	0,03
5.000	Altria Group Inc 5.950% 14-Feb-2049	6.272	0,03
10.000	Amazon.com Inc 2.100% 12-May-2031	10.154	0,05
5.000	Amazon.com Inc 2.700% 03-Jun-2060	4.858	0,02
5.000	Amazon.com Inc 3.150% 22-Aug-2027	5.407	0,03
5.000	Amazon.com Inc 3.250% 12-May-2061	5.426	0,03
10.000	Amazon.com Inc 3.875% 22-Aug-2037	11.788	0,06
10.000	Amazon.com Inc 4.250% 22-Aug-2057	12.895	0,06
15.000	Amazon.com Inc 5.200% 03-Dec-2025	17.089	0,08
15.000	Amcor Finance USA Inc 4.500% 15-May-2028	17.084	0,08
10.000	America Movil SAB de CV 6.375% 01-Mar-2035	13.859	0,07
5.000	American Express Co 2.650% 02-Dec-2022	5.096	0,02
20.000	American Express Co 3.700% 03-Aug-2023	20.862	0,10
15.000	American Financial Group Inc/OH 3.500% 15-Aug-2026	16.070	0,08
5.000	American Homes 4 Rent LP 4.900% 15-Feb-2029	5.789	0,03
10.000	American International Group Inc 4.500% 16-Jul-2044	12.381	0,06
10.000	American Tower Corp 2.300% 15-Sep-2031	9.735	0,05
10.000	American Tower Corp 2.400% 15-Mar-2025	10.280	0,05
20.000	American Tower Corp 2.750% 15-Jan-2027	20.640	0,10
10.000	American Tower Corp 2.950% 15-Jan-2025	10.396	0,05
15.000	American Tower Corp 3.375% 15-Oct-2026	15.957	0,08
5.000	American Tower Corp 3.800% 15-Aug-2029	5.450	0,03
10.000	American Tower Corp 4.000% 01-Jun-2025	10.714	0,05
10.000	American Tower Corp 4.400% 15-Feb-2026	10.933	0,05
20.000	American Water Capital Corp 3.400% 01-Mar-2025	21.158	0,10
5.000	American Water Capital Corp 3.450% 01-Jun-2029	5.400	0,03
5.000	American Water Capital Corp 4.150% 01-Jun-2049	5.938	0,03
20.000	AmerisourceBergen Corp 2.700% 15-Mar-2031	20.250	0,10
5.000	AmerisourceBergen Corp 3.400% 15-May-2024	5.228	0,03
15.000	Amgen Inc 1.900% 21-Feb-2025	15.297	0,07
10.000	Amgen Inc 2.300% 25-Feb-2031	10.080	0,05
5.000	Amgen Inc 2.770% 01-Sep-2053	4.704	0,02
20.000	Amgen Inc 3.125% 01-May-2025	21.106	0,10
10.000	Amgen Inc 4.400% 01-May-2045	12.000	0,06
10.000	Amgen Inc 4.663% 15-Jun-2051	12.874	0,06
5.000	Analog Devices Inc 3.500% 05-Dec-2026	5.460	0,03
5.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14-May-2025	5.457	0,03
10.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.650% 01-Feb-2026	10.751	0,05
15.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.700% 01-Feb-2036	18.157	0,09
20.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.900% 01-Feb-2046	25.416	0,12
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.350% 01-Jun-2040	5.904	0,03
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.600% 15-Apr-2048	12.282	0,06
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029	11.659	0,06
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.450% 23-Jan-2039	6.571	0,03
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.550% 23-Jan-2049	13.913	0,07
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.800% 23-Jan-2059	7.277	0,03
9.000	Anthem Inc 2.375% 15-Jan-2025	9.289	0,04
10.000	Anthem Inc 3.350% 01-Dec-2024	10.573	0,05
5.000	Anthem Inc 3.500% 15-Aug-2024	5.284	0,03
10.000	Anthem Inc 3.650% 01-Dec-2027	10.986	0,05
10.000	Anthem Inc 4.375% 01-Dec-2047	12.249	0,06
10.000	Anthem Inc 4.550% 01-Mar-2048	12.561	0,06
5.000	Anthem Inc 4.650% 15-Jan-2043	6.279	0,03
5.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 21-Jan-2028	5.438	0,03
5.000	Aon Plc 4.000% 27-Nov-2023	5.237	0,03
5.000	Apollo Management Holdings LP '144A' 2.650% 05-Jun-2030	5.053	0,02
5.000	Appalachian Power Co 3.300% 01-Jun-2027	5.343	0,03
5.000	Apple Inc 2.550% 20-Aug-2026	4.735	0,02
20.000	Apple Inc 2.750% 13-Jan-2020	20.915	0,10

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	Apple Inc 3.200% 13-May-2025	10.653	0,05
10.000	Apple Inc 3.250% 23-Feb-2026	10.705	0,05
20.000	Apple Inc 3.350% 09-Feb-2027	21.734	0,10
10.000	Apple Inc 3.450% 06-May-2024	10.584	0,05
5.000	Applied Materials Inc 5.100% 01-Oct-2035	6.510	0,03
20.000	APT Pipelines Ltd '144A' 4.200% 23-Mar-2025	21.411	0,10
15.000	Aptiv Plc 4.350% 15-Mar-2029	17.034	0,08
10.000	Ares Capital Corp 3.250% 15-Jul-2025	10.341	0,05
20.000	Ares Capital Corp 3.875% 15-Jan-2026	21.108	0,10
10.000	Ares Capital Corp 4.250% 01-Mar-2025	10.595	0,05
10.000	Arrow Electronics Inc 4.500% 01-Mar-2023	10.292	0,05
10.000	AstraZeneca Plc 3.125% 12-Jun-2027	10.732	0,05
15.000	AstraZeneca Plc 3.375% 16-Nov-2025	16.120	0,08
10.000	AstraZeneca Plc 6.450% 15-Sep-2037	14.754	0,07
10.000	AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031	10.225	0,05
10.000	AT&T Inc 3.100% 01-Feb-2043	9.772	0,05
15.000	AT&T Inc 3.400% 15-May-2025	15.865	0,08
18.000	AT&T Inc 3.500% 15-Sep-2053	18.265	0,09
17.000	AT&T Inc 3.550% 15-Sep-2055	17.159	0,08
15.000	AT&T Inc 3.650% 01-Jun-2051	15.626	0,08
17.000	AT&T Inc 3.650% 15-Sep-2059	17.274	0,08
5.000	AT&T Inc 4.125% 17-Feb-2026	5.461	0,03
5.000	AT&T Inc 4.250% 01-Mar-2027	5.553	0,03
15.000	AT&T Inc 4.300% 15-Feb-2030	16.915	0,08
5.000	AT&T Inc 4.300% 15-Dec-2042	5.681	0,03
15.000	AT&T Inc 4.350% 01-Mar-2029	16.877	0,08
5.000	AT&T Inc 4.350% 15-Jun-2045	5.667	0,03
5.000	AT&T Inc 4.450% 01-Apr-2024	5.340	0,03
5.000	AT&T Inc 4.500% 15-May-2035	5.793	0,03
5.000	AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048	5.863	0,03
5.000	AT&T Inc 4.550% 09-Mar-2049	5.982	0,03
10.000	AT&T Inc 4.650% 01-Jun-2044	11.786	0,06
5.000	AT&T Inc 4.850% 15-Jul-2045	5.990	0,03
10.000	Athene Holding Ltd 3.500% 15-Jan-2031	10.598	0,05
10.000	Atmos Energy Corp 1.500% 15-Jan-2031	9.406	0,05
15.000	AutoZone Inc 3.125% 18-Apr-2024	15.681	0,08
10.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN' 3.200% 15-Jan-2028	10.715	0,05
10.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN' 3.300% 01-Jun-2029	10.815	0,05
15.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 4.375% 30-Jan-2024	15.744	0,08
15.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 4.875% 01-Oct-2025	16.240	0,08
20.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.528% 18-Nov-2027	19.456	0,09
20.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.875% 15-Feb-2025	20.453	0,10
15.000	AXA SA 8.600% 15-Dec-2030	21.661	0,10
5.000	BAE Systems Holdings Inc '144A' 3.850% 15-Dec-2025	5.366	0,03
10.000	Banco de Credito del Peru 'REGS' FRN 3.125% 01-Jul-2030	9.892	0,05
10.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' 3.250% 04-Oct-2026	10.223	0,05
10.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	10.926	0,05
5.000	Bank of America Corp 3.950% 21-Apr-2025	5.351	0,03
5.000	Bank of America Corp 4.183% 25-Nov-2027	5.478	0,03
6.200	Bank of America Corp 4.750% 21-Apr-2045	6.279	0,03
5.000	Bank of America Corp 6.110% 29-Jan-2037	6.750	0,03
30.000	Bank of America Corp FRN 1.734% 22-Jul-2027	29.815	0,14
15.000	Bank of America Corp FRN 2.592% 29-Apr-2031	15.184	0,07
20.000	Bank of America Corp FRN 3.004% 20-Dec-2023	20.419	0,10
5.000	Bank of America Corp FRN 3.366% 23-Jan-2026	5.266	0,03
20.000	Bank of America Corp FRN 3.419% 20-Dec-2028	21.382	0,10
5.000	Bank of America Corp FRN 3.550% 05-Mar-2024	5.150	0,02
5.000	Bank of America Corp FRN 3.705% 24-Apr-2028	5.434	0,03
15.000	Bank of America Corp FRN 4.244% 24-Apr-2038	17.671	0,09
20.000	Bank of America Corp 'GMTN' 3.300% 11-Jan-2023	20.554	0,10
5.000	Bank of America Corp 'GMTN' FRN 3.593% 21-Jul-2028	5.389	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Bank of America Corp 'MTN' 3.248% 21-Oct-2027	5.329	0,03
10.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.000% 22-Jan-2025	10.691	0,05
10.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.200% 26-Aug-2024	10.728	0,05
5.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.250% 22-Oct-2026	5.524	0,03
15.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.450% 03-Mar-2026	16.539	0,08
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031	5.023	0,02
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.458% 15-Mar-2025	10.465	0,05
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.559% 23-Apr-2027	10.705	0,05
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.824% 20-Jan-2028	5.421	0,03
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.864% 23-Jul-2024	20.847	0,10
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.970% 05-Mar-2029	5.483	0,03
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.974% 07-Feb-2030	16.552	0,08
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.078% 23-Apr-2040	11.539	0,06
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029	16.748	0,08
10.000	Bank of Montreal 3.300% 05-Feb-2024	10.469	0,05
20.000	Bank of Montreal FRN 4.338% 05-Oct-2028	21.043	0,10
5.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.500% 28-Jun-2024	5.160	0,02
5.000	Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027	4.846	0,02
7.000	Barclays Plc 3.684% 10-Jan-2023	7.003	0,03
20.000	BAT Capital Corp 2.726% 25-Mar-2031	19.454	0,09
10.000	BAT Capital Corp 3.215% 06-Sep-2026	10.424	0,05
10.000	BAT Capital Corp 3.222% 15-Aug-2024	10.401	0,05
15.000	BAT Capital Corp 3.557% 15-Aug-2027	15.754	0,08
10.000	BAT International Finance Plc '144A' 3.950% 15-Jun-2025	10.634	0,05
20.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.375% 15-Dec-2028	22.377	0,11
15.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.875% 25-Jun-2048	18.540	0,09
10.000	Bayer US Finance LLC '144A' 3.375% 08-Oct-2024	10.461	0,05
10.000	Becton Dickinson and Co 3.363% 06-Jun-2024	10.477	0,05
10.000	Becton Dickinson and Co 4.669% 06-Jun-2047	12.682	0,06
10.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4.464% 01-Apr-2048	12.441	0,06
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.500% 01-Feb-2025	10.593	0,05
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.750% 15-Nov-2023	10.455	0,05
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 01-Apr-2036	13.651	0,07
5.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.850% 12-Mar-2030	4.964	0,02
10.000	Berkshire Hathaway Inc 2.750% 15-Mar-2023	10.214	0,05
5.000	Berkshire Hathaway Inc 3.125% 15-Mar-2026	5.359	0,03
5.000	BG Energy Capital Plc '144A' 5.125% 15-Oct-2041	6.443	0,03
5.000	Black Hills Corp 3.050% 15-Oct-2029	5.209	0,02
10.000	Black Hills Corp 3.150% 15-Jan-2027	10.414	0,05
10.000	Black Hills Corp 4.250% 30-Nov-2023	10.507	0,05
5.000	BlackRock Inc 2.400% 30-Apr-2030	5.155	0,02
15.000	Blackstone Secured Lending Fund 2.750% 16-Sep-2026	15.022	0,07
30.000	Blackstone Secured Lending Fund 3.625% 15-Jan-2026	31.343	0,15
5.000	BMW US Capital LLC '144A' 3.800% 06-Apr-2023	5.186	0,02
20.000	BMW US Capital LLC '144A' 3.900% 09-Apr-2025	21.527	0,10
15.000	BMW US Capital LLC '144A' 4.150% 09-Apr-2030	17.018	0,08
20.000	BNP Paribas SA '144A' 3.375% 09-Jan-2025	21.021	0,10
25.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 5.198% 10-Jan-2030	29.135	0,14
20.000	Boeing Co/The 4.508% 01-May-2023	20.897	0,10
10.000	Boeing Co/The 5.805% 01-May-2050	13.611	0,07
10.000	Boeing Co/The 5.930% 01-May-2060	13.967	0,07
10.000	Boeing Co/The 6.625% 15-Feb-2038	13.529	0,07
10.000	Booking Holdings Inc 4.625% 13-Apr-2030	11.683	0,06
10.000	Boston Properties LP 3.200% 15-Jan-2025	10.481	0,05
10.000	Boston Properties LP 3.250% 30-Jan-2031	10.478	0,05

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Boston Scientific Corp 3.750% 01-Mar-2026	5.379	0,03
10.000	Boston Scientific Corp 3.850% 15-May-2025	10.763	0,05
5.000	Boston Scientific Corp 4.000% 01-Mar-2029	5.562	0,03
15.000	Boston Scientific Corp 4.550% 01-Mar-2039	18.020	0,09
5.000	Boston Scientific Corp 4.700% 01-Mar-2049	6.371	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 2.750% 10-May-2023	5.123	0,02
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.119% 04-May-2026	5.294	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.194% 06-Apr-2025	5.275	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.379% 08-Feb-2061	5.174	0,02
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.410% 11-Feb-2026	5.341	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.633% 06-Apr-2030	5.533	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.796% 21-Sep-2025	5.403	0,03
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.937% 21-Sep-2028	5.545	0,03
10.000	BP Capital Markets America Inc 4.234% 06-Nov-2028	11.304	0,05
5.000	BP Capital Markets Plc 3.279% 19-Sep-2027	5.379	0,03
5.000	BP Capital Markets Plc 3.814% 10-Feb-2024	5.272	0,03
20.000	BPCE SA '144A' 4.500% 15-Mar-2025	21.576	0,10
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 2.900% 26-Jul-2024	10.472	0,05
5.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.250% 20-Feb-2023	5.133	0,02
15.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.400% 26-Jul-2029	16.456	0,08
5.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.875% 15-Aug-2025	5.417	0,03
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 4.125% 15-Jun-2039	11.880	0,06
5.000	British Telecommunications Plc 9.625% 15-Dec-2030	7.336	0,04
5.000	British Telecommunications Plc '144A' 3.250% 08-Nov-2029	5.121	0,02
15.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15-Jan-2027	16.283	0,08
10.000	Broadcom Inc 4.110% 15-Sep-2028	10.981	0,05
10.000	Broadcom Inc 4.300% 15-Nov-2032	11.266	0,05
10.000	Broadcom Inc 4.700% 15-Apr-2025	10.947	0,05
15.000	Broadcom Inc 4.750% 15-Apr-2029	17.105	0,08
10.000	Broadcom Inc 5.000% 15-Apr-2030	11.665	0,06
10.000	Broadcom Inc '144A' 2.450% 15-Feb-2031	9.826	0,05
10.000	Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033	9.775	0,05
5.000	Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051	5.255	0,03
5.000	Brown & Brown Inc 4.200% 15-Sep-2024	5.338	0,03
5.000	Brown-Forman Corp 3.500% 15-Apr-2025	5.334	0,03
15.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.250% 15-Jun-2027	16.172	0,08
5.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.750% 01-Apr-2024	5.265	0,03
20.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.850% 01-Sep-2023	20.822	0,10
15.000	Cabot Corp 4.000% 01-Jul-2029	16.413	0,08
5.000	Cadence Design Systems Inc 4.375% 15-Oct-2024	5.379	0,03
5.000	Camden Property Trust 2.800% 15-May-2030	5.211	0,02
15.000	Cameron LNG LLC '144A' 3.302% 15-Jan-2035	15.711	0,08
10.000	Campbell Soup Co 3.950% 15-Mar-2025	10.704	0,05
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.250% 28-Jan-2025	20.454	0,10
15.000	Canadian National Railway Co 2.950% 21-Nov-2024	15.656	0,08
10.000	Canadian National Railway Co 6.900% 15-Jul-2028	13.053	0,06
20.000	Canadian Pacific Railway Co 2.900% 01-Feb-2025	20.826	0,10
5.000	Canadian Pacific Railway Co 6.125% 15-Sep-2115	7.515	0,04
5.000	Capital One Financial Corp 3.200% 30-Jan-2023	5.123	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 3.200% 05-Feb-2025	10.490	0,05
10.000	Capital One Financial Corp 3.300% 30-Oct-2024	10.534	0,05
5.000	Capital One Financial Corp 3.500% 15-Jun-2023	5.184	0,02
5.000	Capital One Financial Corp 3.750% 24-Apr-2024	5.274	0,03
10.000	Capital One Financial Corp 3.900% 29-Jan-2024	10.530	0,05
20.000	Capital One Financial Corp 4.200% 29-Oct-2025	21.774	0,11
5.000	Cargill Inc '144A' 2.125% 23-Apr-2030	4.955	0,02

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Carlisle Cos Inc 2.750% 01-Mar-2030	5.106	0,02
15.000	Carlisle Cos Inc 3.500% 01-Dec-2024	15.833	0,08
10.000	Carrier Global Corp 2.242% 15-Feb-2025	10.251	0,05
5.000	Carrier Global Corp 2.700% 15-Feb-2031	5.090	0,02
5.000	Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030	5.117	0,02
5.000	Carrier Global Corp 3.577% 05-Apr-2050	5.350	0,03
10.000	CC Holdings GS V LLC / Crown Castle GS III Corp 3.849% 15-Apr-2023	10.352	0,05
5.000	CH Robinson Worldwide Inc 4.200% 15-Apr-2028	5.641	0,03
20.000	Charles Schwab Corp/The 3.625% 01-Apr-2025	21.331	0,10
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.800% 01-Apr-2031	9.906	0,05
15.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.400% 01-Dec-2061	15.617	0,08
5.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.500% 01-Feb-2024	5.321	0,03
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.800% 01-Mar-2050	11.261	0,05
15.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23-Jul-2025	16.521	0,08
5.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.125% 01-Jul-2049	5.832	0,03
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 01-May-2047	11.999	0,06
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.750% 01-Apr-2048	12.537	0,06
5.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.384% 23-Oct-2035	6.462	0,03
5.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 23-Oct-2045	6.862	0,03
10.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31-Mar-2025	11.094	0,05
15.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.000% 30-Jun-2024	16.604	0,08
20.000	Chevron Corp 1.995% 11-May-2027	20.326	0,10
20.000	Chevron Corp 2.236% 11-May-2030	20.271	0,10
5.000	Chevron Corp 3.326% 17-Nov-2025	5.343	0,03
15.000	Chevron Phillips Chemical Co LLC / Chevron Phillips Chemical Co LP '144A' 5.125% 01-Apr-2025	16.673	0,08
10.000	Chubb INA Holdings Inc 3.350% 03-May-2026	10.737	0,05
15.000	Church & Dwight Co Inc 3.950% 01-Aug-2047	17.594	0,08
5.000	Cigna Corp 3.000% 15-Jul-2023	5.145	0,02
5.000	Cigna Corp 3.400% 01-Mar-2027	5.378	0,03
5.000	Cigna Corp 3.875% 15-Oct-2047	5.620	0,03
5.000	Cigna Corp 4.125% 15-Nov-2025	5.475	0,03
15.000	Cigna Corp 4.375% 15-Oct-2028	17.073	0,08
15.000	Cigna Corp 4.800% 15-Aug-2038	18.526	0,09
10.000	Cigna Corp 4.900% 15-Dec-2048	12.997	0,06
5.000	Cintas Corp No 2 3.700% 01-Apr-2027	5.477	0,03
10.000	Cisco Systems Inc/Delaware 5.900% 15-Feb-2039	14.417	0,07
10.000	Citigroup Inc 3.200% 21-Oct-2026	10.610	0,05
15.000	Citigroup Inc 3.500% 15-May-2024	15.513	0,07
10.000	Citigroup Inc 3.875% 26-Mar-2025	10.684	0,05
10.000	Citigroup Inc 4.300% 20-Nov-2026	11.078	0,05
10.000	Citigroup Inc 4.400% 10-Jun-2025	10.903	0,05
5.000	Citigroup Inc 4.450% 29-Sep-2027	5.583	0,03
10.000	Citigroup Inc 4.750% 18-May-2046	12.366	0,06
5.000	Citigroup Inc 5.300% 06-May-2044	6.559	0,03
20.000	Citigroup Inc 5.500% 13-Sep-2025	22.647	0,11
5.000	Citigroup Inc 8.125% 15-Jul-2039	8.487	0,04
10.000	Citigroup Inc FRN 2.572% 03-Jun-2031	10.108	0,05
10.000	Citigroup Inc FRN 2.666% 29-Jan-2031	10.172	0,05
5.000	Citigroup Inc FRN 2.976% 05-Nov-2030	5.202	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 3.106% 08-Apr-2026	10.494	0,05
20.000	Citigroup Inc FRN 3.352% 24-Apr-2025	20.898	0,10

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Citigroup Inc FRN 3.887% 10-Jan-2028	5.427	0,03
20.000	Citigroup Inc FRN 3.980% 20-Mar-2030	22.117	0,11
10.000	Citigroup Inc FRN 4.044% 01-Jun-2024	10.426	0,05
10.000	Citigroup Inc FRN 4.075% 23-Apr-2029	11.045	0,05
10.000	Citigroup Inc FRN 4.412% 31-Mar-2031	11.443	0,06
10.000	Cleco Corporate Holdings LLC 4.973% 01-May-2046	12.183	0,06
15.000	Cleveland Electric Illuminating Co/The 5.950% 15-Dec-2036	20.109	0,10
15.000	Clorox Co/The 3.900% 15-May-2028	16.850	0,08
10.000	CME Group Inc 3.000% 15-Mar-2025	10.509	0,05
10.000	CNH Industrial Capital LLC 1.450% 15-Jul-2026	9.802	0,05
5.000	Coca-Cola Co/The 2.125% 06-Sep-2029	5.093	0,02
10.000	Coca-Cola Co/The 2.250% 05-Jan-2032	10.187	0,05
10.000	Coca-Cola Co/The 2.500% 01-Jun-2040	10.089	0,05
10.000	Coca-Cola Co/The 2.900% 25-May-2027	10.661	0,05
5.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV 2.750% 22-Jan-2030	5.121	0,02
10.000	Colgate-Palmolive Co 'MTN' 3.250% 15-Mar-2024	10.494	0,05
10.000	Columbia Pipeline Group Inc 4.500% 01-Jun-2025	10.798	0,05
10.000	Comcast Corp 1.500% 15-Feb-2031	9.462	0,05
10.000	Comcast Corp 1.950% 15-Jan-2031	9.821	0,05
5.000	Comcast Corp 2.650% 01-Feb-2030	5.196	0,02
10.000	Comcast Corp 3.700% 15-Apr-2024	10.631	0,05
10.000	Comcast Corp 3.950% 15-Oct-2025	10.931	0,05
5.000	Comcast Corp 4.049% 01-Nov-2052	5.878	0,03
10.000	Comcast Corp 4.150% 15-Oct-2028	11.369	0,05
10.000	Comcast Corp 4.200% 15-Aug-2034	11.794	0,06
5.000	Comcast Corp 4.250% 15-Oct-2030	5.782	0,03
10.000	Comcast Corp 4.600% 15-Oct-2038	12.184	0,06
5.000	Comcast Corp 4.950% 15-Oct-2058	6.955	0,03
5.000	Comcast Corp 5.650% 15-Jun-2035	6.644	0,03
10.000	Comcast Corp 6.950% 15-Aug-2037	15.201	0,07
10.000	Comcast Corp '144A' 2.987% 01-Nov-2063	9.558	0,05
8.990	Cometa Energia SA de CV 'REGS' 6.375% 24-Apr-2035	10.251	0,05
5.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.625% 06-Sep-2026	5.259	0,03
5.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.150% 19-Sep-2027	5.420	0,03
25.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 4.500% 09-Dec-2025	27.464	0,13
10.000	Commonwealth Edison Co 2.950% 15-Aug-2027	10.567	0,05
13.000	Conagra Brands Inc 3.200% 25-Jan-2023	13.251	0,06
5.000	Conagra Brands Inc 5.400% 01-Nov-2048	6.772	0,03
10.000	ConocoPhillips 6.500% 01-Feb-2039	14.585	0,07
5.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.125% 15-Nov-2027	5.272	0,03
15.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 4.500% 15-May-2058	18.491	0,09
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 01-Dec-2039	12.907	0,06
15.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.375% 04-Aug-2025	16.269	0,08
10.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.625% 01-Dec-2023	10.662	0,05
25.000	Cooperatieve Rabobank UA '144A' 2.625% 22-Jul-2024	25.831	0,12
10.000	Cooperatieve Rabobank UA 'BKNT' 3.750% 21-Jul-2026	10.787	0,05
5.000	Cooperatieve Rabobank UA 'BKNT' 5.250% 24-May-2041	7.043	0,03
10.000	Corning Inc 5.850% 15-Nov-2068	14.844	0,07
15.000	Cox Communications Inc '144A' 3.500% 15-Aug-2027	16.136	0,08
5.000	Credit Agricole SA '144A' 3.250% 14-Jan-2030	5.188	0,02
20.000	Credit Agricole SA '144A' 4.375% 17-Mar-2025	21.510	0,10
10.000	Credit Suisse Group AG 3.750% 26-Mar-2025	10.624	0,05
10.000	Credit Suisse Group AG 4.550% 17-Apr-2026	11.035	0,05
15.000	Credit Suisse Group AG 4.875% 15-May-2045	19.096	0,09
8.000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 09-Jan-2023	8.002	0,04
5.000	Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028	5.435	0,03
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 4.194% 01-Apr-2031	11.051	0,05

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
15.000	CRH America Finance Inc '144A' 4.400% 09-May-2047	18.057	0,09
10.000	Crown Castle International Corp 1.050% 15-Jul-2026	9.673	0,05
15.000	Crown Castle International Corp 2.100% 01-Apr-2031	14.386	0,07
10.000	Crown Castle International Corp 3.200% 01-Sep-2024	10.446	0,05
15.000	Crown Castle International Corp 3.800% 15-Feb-2028	16.347	0,08
5.000	Crown Castle International Corp 4.300% 15-Feb-2029	5.591	0,03
5.000	Crown Castle International Corp 4.450% 15-Feb-2026	5.480	0,03
5.000	CSX Corp 4.250% 01-Nov-2066	6.160	0,03
5.000	CSX Corp 4.750% 15-Nov-2048	6.483	0,03
10.000	CSX Corp 6.000% 01-Oct-2036	13.587	0,07
10.000	CSX Corp 6.220% 30-Apr-2040	14.313	0,07
5.000	Cummins Inc 1.500% 01-Sep-2030	4.743	0,02
5.000	CVS Health Corp 1.750% 21-Aug-2030	4.776	0,02
5.000	CVS Health Corp 3.750% 01-Apr-2030	5.493	0,03
20.000	CVS Health Corp 3.875% 20-Jul-2025	21.520	0,10
20.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	22.478	0,11
20.000	CVS Health Corp 4.780% 25-Mar-2038	24.487	0,12
10.000	CVS Health Corp 5.050% 25-Mar-2048	13.140	0,06
10.000	CVS Health Corp 5.125% 20-Jul-2045	13.069	0,06
20.000	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The '144A' FRN (Perpetual) 4.000% 24-Jul-2026	21.350	0,10
10.000	Daimler Finance North America LLC 8.500% 18-Jan-2031	14.899	0,07
15.000	Danaher Corp 3.350% 15-Sep-2025	15.991	0,08
5.000	Danske Bank A/S '144A' FRN 1.171% 08-Dec-2023	5.000	0,02
5.000	DENTSPLY SIRONA Inc 3.250% 01-Jun-2030	5.292	0,03
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 8.750% 15-Jun-2030	14.559	0,07
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 4.375% 21-Jun-2028	5.589	0,03
5.000	DH Europe Finance II Sarl 2.200% 15-Nov-2024	5.114	0,02
5.000	DH Europe Finance II Sarl 2.600% 15-Nov-2029	5.176	0,02
15.000	Diageo Capital Plc 2.375% 24-Oct-2029	15.350	0,07
5.000	Discover Bank 'BKNT' 4.650% 13-Sep-2028	5.683	0,03
10.000	Discover Financial Services 3.950% 06-Nov-2024	10.646	0,05
10.000	DNB Bank ASA '144A' 2.150% 02-Dec-2022	10.149	0,05
5.000	Dollar General Corp 3.500% 03-Apr-2030	5.414	0,03
5.000	Dollar General Corp 3.875% 15-Apr-2027	5.496	0,03
10.000	Dollar General Corp 4.125% 01-May-2028	11.132	0,05
5.000	Dollar General Corp 4.150% 01-Nov-2025	5.440	0,03
10.000	Dominion Energy Inc 3.300% 15-Mar-2025	10.475	0,05
5.000	Dominion Energy Inc 3.375% 01-Apr-2030	5.317	0,03
10.000	Dominion Energy Inc 3.600% 15-Mar-2027	10.780	0,05
5.000	Dominion Energy Inc 3.900% 01-Oct-2025	5.400	0,03
10.000	Dominion Energy Inc Step-Up Coupon 3.071% 15-Aug-2024	10.360	0,05
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc 6.050% 15-Jan-2038	14.116	0,07
4.000	Dow Chemical Co/The 4.250% 01-Oct-2034	4.631	0,02
5.000	Dow Chemical Co/The 4.375% 15-Nov-2042	5.935	0,03
5.000	Dow Chemical Co/The 4.625% 01-Oct-2044	6.076	0,03
5.000	Dow Chemical Co/The 4.800% 15-May-2049	6.399	0,03
5.000	Dow Chemical Co/The 5.250% 15-Nov-2041	6.422	0,03
10.000	Dow Chemical Co/The 7.375% 01-Nov-2029	13.479	0,06
20.000	DR Horton Inc 5.750% 15-Aug-2023	21.253	0,10
10.000	Duke Energy Carolinas LLC 5.300% 15-Feb-2040	13.221	0,06
15.000	Duke Energy Corp 2.550% 15-Jun-2031	15.047	0,07
10.000	Duke Energy Corp 3.150% 15-Aug-2027	10.534	0,05
5.000	Duke Energy Florida LLC 2.500% 01-Dec-2029	5.149	0,02
5.000	Duke Energy Florida LLC 3.200% 15-Jan-2027	5.326	0,03
30.000	Duke Energy Florida Project Finance LLC 2.538% 01-Sep-2029	30.923	0,15
5.000	Duke Energy Progress LLC 2.000% 15-Aug-2031	4.896	0,02
10.000	Duke Realty LP 1.750% 01-Feb-2031	9.483	0,05
7.000	DuPont de Nemours Inc 4.205% 15-Nov-2023	7.406	0,04
15.000	DuPont de Nemours Inc 4.725% 15-Nov-2028	17.403	0,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	DuPont de Nemours Inc 5.319% 15-Nov-2038	12.938	0,06
5.000	DuPont de Nemours Inc 5.419% 15-Nov-2048	7.020	0,03
15.000	Eastman Chemical Co 3.800% 15-Mar-2025	16.036	0,08
20.000	eBay Inc 2.700% 11-Mar-2030	20.485	0,10
10.000	eBay Inc 3.450% 01-Aug-2024	10.511	0,05
5.000	Ecotal Inc 2.700% 01-Nov-2026	5.257	0,03
15.000	Edison International 4.125% 15-Mar-2028	15.856	0,08
10.000	EDP Finance BV '144A' 3.625% 15-Jul-2024	10.502	0,05
5.000	Edwards Lifesciences Corp 4.300% 15-Jun-2028	5.627	0,03
15.000	Electronic Arts Inc 1.850% 15-Feb-2031	14.409	0,07
15.000	Electronic Arts Inc 2.950% 15-Feb-2051	14.225	0,07
5.000	Eli Lilly & Co 2.750% 01-Jun-2025	5.220	0,02
1.000	Emera US Finance LP 3.550% 15-Jun-2026	1.065	0,00
20.000	Enbridge Inc 2.500% 15-Jan-2025	20.577	0,10
10.000	Enbridge Inc 4.000% 01-Oct-2023	10.445	0,05
5.000	Enbridge Inc 4.500% 10-Jun-2044	5.886	0,03
12.000	Enel Finance International NV '144A' 2.650% 10-Sep-2024	12.368	0,06
5.000	Enel Finance International NV '144A' 4.750% 25-May-2047	6.168	0,03
10.000	Enel SpA '144A' FRN 8.750% 24-Sep-2073	11.158	0,05
8.000	Energy Transfer LP 4.250% 15-Mar-2023	8.223	0,04
10.000	Energy Transfer LP 7.500% 01-Jul-2038	13.843	0,07
10.000	Entergy Louisiana LLC 4.050% 01-Sep-2023	10.407	0,05
15.000	Enterprise Products Operating LLC 3.350% 15-Mar-2023	15.353	0,07
20.000	Enterprise Products Operating LLC 3.900% 15-Feb-2024	21.014	0,10
10.000	Enterprise Products Operating LLC 3.950% 31-Jan-2060	10.875	0,05
5.000	Enterprise Products Operating LLC 4.200% 31-Jan-2050	5.640	0,03
10.000	Enterprise Products Operating LLC 4.850% 15-Aug-2042	12.013	0,06
10.000	Enterprise Products Operating LLC 5.100% 15-Feb-2045	12.395	0,06
5.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.250% 16-Aug-2077	5.114	0,02
5.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.375% 15-Feb-2078	5.025	0,02
15.000	Equifax Inc 3.300% 15-Dec-2022	15.268	0,07
20.000	Equinix Inc 2.625% 18-Nov-2024	20.626	0,10
10.000	Equinix Inc 3.200% 18-Nov-2029	10.530	0,05
5.000	ERP Operating LP 3.500% 01-Mar-2028	5.442	0,03
10.000	ERP Operating LP 4.150% 01-Dec-2028	11.312	0,05
15.000	Essex Portfolio LP 3.875% 01-May-2024	15.802	0,08
5.000	Estee Lauder Cos Inc/The 2.600% 15-Apr-2030	5.193	0,02
10.000	Eversource Energy 1.400% 15-Aug-2026	9.817	0,05
10.000	Eversource Energy 3.300% 15-Jan-2028	10.678	0,05
5.000	Eversource Energy 3.800% 01-Dec-2023	5.252	0,03
10.000	Exelon Generation Co LLC 5.750% 01-Oct-2041	11.961	0,06
10.000	Exelon Generation Co LLC 6.250% 01-Oct-2039	12.540	0,06
5.000	Expedia Group Inc '144A' 6.250% 01-May-2025	5.647	0,03
10.000	Exxon Mobil Corp 2.610% 15-Oct-2030	10.386	0,05
5.000	Exxon Mobil Corp 2.992% 19-Mar-2025	5.260	0,03
20.000	Exxon Mobil Corp 3.043% 01-Mar-2026	21.188	0,10
10.000	Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040	11.877	0,06
10.000	Farmers Insurance Exchange '144A' FRN 4.747% 01-Nov-2057	11.600	0,06
5.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 2.050% 10-Feb-2025	5.068	0,02
5.000	FedEx Corp 4.050% 15-Feb-2048	5.647	0,03
5.000	FedEx Corp 4.550% 01-Apr-2046	6.025	0,03
5.000	FedEx Corp 4.750% 15-Nov-2045	6.126	0,03
5.000	FedEx Corp 5.250% 15-May-2050	6.729	0,03
5.000	Fidelity Insurance Holdings Ltd '144A' 4.875% 30-Jun-2030	5.420	0,03
10.000	Fidelity National Information Services Inc 4.500% 15-Aug-2046	12.186	0,06
10.000	Fifth Third Bancorp 4.300% 16-Jan-2024	10.581	0,05
15.000	First American Financial Corp 4.600% 15-Nov-2024	16.252	0,08
35.000	FirstEnergy Corp 4.750% 15-Mar-2023	36.444	0,18

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	13.519	0,07
5.000	Fiserv Inc 2.750% 01-Jul-2024	5.176	0,02
10.000	Fiserv Inc 3.500% 01-Jul-2029	10.774	0,05
10.000	Fiserv Inc 4.400% 01-Jul-2049	11.985	0,06
5.000	Florida Power & Light Co 5.950% 01-Feb-2038	6.988	0,03
10.000	FMC Corp 3.450% 01-Oct-2029	10.668	0,05
15.000	FMC Corp 4.100% 01-Feb-2024	15.737	0,08
15.000	FMC Corp 4.500% 01-Oct-2049	18.107	0,09
5.000	FMR LLC '144A' 7.570% 15-Jun-2029	6.899	0,03
10.000	FNB Corp/PA 2.200% 24-Feb-2023	10.088	0,05
4.000	Fortis Inc/Canada 3.055% 04-Oct-2026	4.169	0,02
10.000	Fortune Brands Home & Security Inc 3.250% 15-Sep-2029	10.592	0,05
15.000	Fox Corp 5.476% 25-Jan-2039	19.424	0,09
5.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 2.375% 16-Feb-2031	4.789	0,02
10.000	GE Capital Funding LLC 4.400% 15-May-2030	10.863	0,05
25.000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4.418% 15-Nov-2035	29.919	0,14
5.000	General Dynamics Corp 3.500% 15-May-2025	5.336	0,03
5.000	General Electric Co 3.625% 01-May-2030	5.376	0,03
15.000	General Mills Inc 3.200% 10-Feb-2027	15.964	0,08
5.000	General Mills Inc 4.000% 17-Apr-2025	5.375	0,03
5.000	General Mills Inc 4.200% 17-Apr-2028	5.591	0,03
20.000	General Motors Co 4.875% 02-Oct-2023	21.257	0,10
30.000	General Motors Co 6.125% 01-Oct-2025	34.506	0,17
10.000	General Motors Financial Co Inc 2.700% 10-Jun-2031	9.986	0,05
10.000	Georgia Power Co 3.250% 30-Mar-2027	10.558	0,05
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.100% 30-Apr-2027	5.068	0,02
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.300% 30-Apr-2030	5.016	0,02
20.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 3.734% 15-Jul-2023	20.717	0,10
5.000	Gilead Sciences Inc 1.650% 01-Oct-2030	4.803	0,02
5.000	Gilead Sciences Inc 2.800% 01-Oct-2050	4.879	0,02
20.000	Gilead Sciences Inc 3.650% 01-Mar-2026	21.575	0,10
10.000	Gilead Sciences Inc 4.000% 01-Sep-2036	11.539	0,06
15.000	Gilead Sciences Inc 4.600% 01-Sep-2035	18.204	0,09
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 2.800% 18-Mar-2023	5.123	0,02
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3.375% 15-May-2023	5.179	0,02
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3.625% 15-May-2025	5.391	0,03
10.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 6.375% 15-May-2038	14.691	0,07
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3.000% 01-Jun-2024	5.235	0,03
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3.375% 01-Jun-2029	5.462	0,03
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.125% 30-May-2023	10.412	0,05
15.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.875% 12-Mar-2029	16.994	0,08
15.000	Global Atlantic Fin Co '144A' 4.400% 15-Oct-2029	16.180	0,08
5.000	Global Payments Inc 2.650% 15-Feb-2025	5.144	0,02
20.000	Global Payments Inc 2.900% 15-May-2030	20.406	0,10
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2030	5.297	0,03
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2031	5.342	0,03
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.300% 15-Jan-2029	5.683	0,03
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 01-Nov-2023	5.312	0,03
15.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026	16.723	0,08
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.600% 07-Feb-2030	5.094	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 23-Jan-2025	10.548	0,05
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 01-Apr-2025	5.293	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 22-May-2025	10.684	0,05
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 25-Feb-2026	10.784	0,05
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.800% 15-Mar-2030	11.030	0,05
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.850% 26-Jan-2027	10.759	0,05
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.000% 03-Mar-2024	21.218	0,10

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.150% 22-May-2045	6.534	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.250% 01-Feb-2041	14.601	0,07
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.450% 01-May-2036	6.860	0,03
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.750% 01-Oct-2037	28.464	0,14
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.542% 10-Sep-2027	9.809	0,05
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.383% 21-Jul-2032	9.866	0,05
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.272% 29-Sep-2025	5.251	0,03
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.691% 05-Jun-2028	5.392	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.814% 23-Apr-2029	10.895	0,05
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.017% 31-Oct-2038	5.742	0,03
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.223% 01-May-2029	16.689	0,08
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.411% 23-Apr-2039	5.997	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN' 3.850% 08-Jul-2024	10.577	0,05
5.000	Goodman US Finance Three LLC '144A' 3.700% 15-Mar-2028	5.407	0,03
10.000	Hartford Financial Services Group Inc/The 4.400% 15-Mar-2048	12.348	0,06
5.000	Hasbro Inc 3.000% 19-Nov-2024	5.208	0,02
10.000	Hasbro Inc 3.900% 19-Nov-2029	11.047	0,05
5.000	Hasbro Inc 5.100% 15-May-2044	6.255	0,03
5.000	HBOS Plc '144A' 6.000% 01-Nov-2033	6.610	0,03
20.000	HCA Inc 4.125% 15-Jun-2029	22.048	0,11
10.000	HCA Inc 4.750% 01-May-2023	10.478	0,05
5.000	HCA Inc 5.250% 15-Apr-2025	5.538	0,03
5.000	HCA Inc 5.250% 15-Jun-2049	6.455	0,03
5.000	HCA Inc 5.500% 15-Jun-2047	6.579	0,03
5.000	Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co '144A' 2.200% 01-Jun-2030	4.907	0,02
5.000	Healthcare Trust of America Holdings LP 3.100% 15-Feb-2030	5.172	0,02
5.000	Healthpeak Properties Inc 3.000% 15-Jan-2030	5.259	0,03
10.000	Healthpeak Properties Inc 3.400% 01-Feb-2025	10.507	0,05
15.000	Hewlett Packard Enterprise Co 4.450% 02-Oct-2023	15.836	0,08
10.000	Home Depot Inc/The 3.000% 01-Apr-2026	10.640	0,05
10.000	Home Depot Inc/The 3.350% 15-Sep-2025	10.689	0,05
5.000	Home Depot Inc/The 3.500% 15-Sep-2056	5.682	0,03
10.000	Home Depot Inc/The 5.875% 16-Dec-2036	14.209	0,07
5.000	Honeywell International Inc 5.700% 15-Mar-2036	6.837	0,03
35.000	HSBC Holdings Plc 4.300% 08-Mar-2026	38.408	0,19
10.000	HSBC Holdings Plc 4.375% 23-Nov-2026	10.985	0,05
20.000	HSBC Holdings Plc 4.950% 31-Mar-2030	23.514	0,11
10.000	HSBC Holdings Plc 7.625% 17-May-2032	13.829	0,07
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.803% 11-Mar-2025	10.501	0,05
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.950% 18-May-2024	20.749	0,10
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.973% 22-May-2030	21.734	0,10
25.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.583% 19-Jun-2029	28.051	0,14
20.000	HSBC USA Inc 3.500% 23-Jun-2024	21.112	0,10
14.000	Hubbell Inc 3.150% 15-Aug-2027	14.758	0,07
5.000	Hubbell Inc 3.350% 01-Mar-2026	5.285	0,03
5.000	Humana Inc 2.900% 15-Dec-2022	5.100	0,02
5.000	Humana Inc 3.850% 01-Oct-2024	5.312	0,03
10.000	Huntington Ingalls Industries Inc 3.483% 01-Dec-2027	10.607	0,05
5.000	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033	7.441	0,04
20.000	Hyundai Capital America '144A' 2.375% 10-Feb-2023	20.284	0,10
15.000	Hyundai Capital America '144A' 5.875% 07-Apr-2025	16.802	0,08
5.000	IHS Markit Ltd 4.125% 01-Aug-2023	5.237	0,03
30.000	IHS Markit Ltd '144A' 4.750% 15-Feb-2025	32.741	0,16

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
15.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 3.500% 11-Feb-2023	15.284	0,07
10.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 4.250% 21-Jul-2025	10.750	0,05
10.000	Intel Corp 2.000% 12-Aug-2031	9.957	0,05
10.000	Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032	9.595	0,05
5.000	Intercontinental Exchange Inc 3.100% 15-Sep-2027	5.316	0,03
10.000	Intercontinental Exchange Inc 3.750% 21-Sep-2028	11.052	0,05
10.000	Intercontinental Exchange Inc 4.250% 21-Sep-2048	12.254	0,06
25.000	International Business Machines Corp 3.500% 15-May-2029	27.181	0,13
15.000	International Business Machines Corp 7.000% 30-Oct-2025	18.126	0,09
10.000	International Flavors & Fragrances Inc 4.375% 01-Jun-2047	11.681	0,06
5.000	International Paper Co 7.300% 15-Nov-2039	7.686	0,04
10.000	Interpublic Group of Cos Inc/The 4.750% 30-Mar-2030	11.635	0,06
5.000	Interstate Power and Light Co 3.250% 01-Dec-2024	5.254	0,03
15.000	Interstate Power and Light Co 3.600% 01-Apr-2029	16.335	0,08
10.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 4.700% 23-Sep-2049	12.027	0,06
15.000	Intuit Inc 0.650% 15-Jul-2023	14.961	0,07
15.000	Intuit Inc 0.950% 15-Jul-2025	14.803	0,07
5.000	Intuit Inc 1.650% 15-Jul-2030	4.833	0,02
15.000	ITC Holdings Corp '144A' 2.950% 14-May-2030	15.352	0,07
10.000	J M Smucker Co/The 2.375% 15-Mar-2030	10.042	0,05
15.000	Jackson National Life Global Funding '144A' 3.875% 11-Jun-2025	16.151	0,08
15.000	Jefferies Group LLC / Jefferies Group Capital Finance Inc 4.150% 23-Jan-2024	16.663	0,08
4.573	JetBlue 2019-1 Class AA Pass Through Trust 2.750% 15-May-2032	4.626	0,02
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 2.000% 17-Jun-2031	10.020	0,05
10.000	Johnson & Johnson 1.300% 01-Sep-2030	9.655	0,05
10.000	Johnson & Johnson 2.450% 01-Mar-2026	10.443	0,05
10.000	Johnson & Johnson 2.450% 01-Sep-2060	9.523	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co 3.875% 10-Sep-2024	10.616	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co 4.250% 01-Oct-2027	11.234	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co 5.500% 15-Oct-2040	13.664	0,07
5.000	JPMorgan Chase & Co 6.400% 15-May-2038	7.303	0,04
30.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.470% 22-Sep-2027	29.438	0,14
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	10.162	0,05
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.739% 15-Oct-2030	20.590	0,10
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.220% 01-Mar-2025	15.604	0,08
5.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.509% 23-Jan-2029	5.364	0,03
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.540% 01-May-2028	16.313	0,08
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.559% 23-Apr-2024	10.338	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030	10.949	0,05
5.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.782% 01-Feb-2028	5.420	0,03
35.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.797% 23-Jul-2024	36.493	0,18
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.882% 24-Jul-2038	11.395	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.005% 23-Apr-2029	11.055	0,05
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.023% 05-Dec-2024	15.824	0,08
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.493% 24-Mar-2031	23.190	0,11
10.000	Kansas City Southern/Old 4.200% 15-Nov-2069	11.913	0,06
15.000	Kellogg Co 4.300% 15-May-2028	17.004	0,08
5.000	Kellogg Co 4.500% 01-Apr-2046	6.245	0,03
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 3.130% 15-Dec-2023	10.369	0,05
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4.420% 15-Dec-2046	11.930	0,06
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4.597% 25-May-2028	11.391	0,05
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4.985% 25-May-2038	12.409	0,06
5.000	Keysight Technologies Inc 4.550% 30-Oct-2024	5.411	0,03
10.000	Kilroy Realty LP 3.450% 15-Dec-2024	10.484	0,05
15.000	Kilroy Realty LP 4.750% 15-Dec-2028	17.184	0,08
5.000	Kimco Realty Corp 3.700% 01-Oct-2049	5.361	0,03
5.000	Kimco Realty Corp 4.125% 01-Dec-2046	5.675	0,03
5.000	Kimco Realty Corp 4.450% 01-Sep-2047	5.995	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.150% 01-Feb-2024	5.264	0,03
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 6.550% 15-Sep-2040	6.759	0,03
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 'MTN' 6.950% 15-Jan-2038	6.944	0,03
10.000	Kinder Morgan Inc 3.150% 15-Jan-2023	10.214	0,05
15.000	Kinder Morgan Inc 3.600% 15-Feb-2051	15.175	0,07
5.000	Kinder Morgan Inc 5.050% 15-Feb-2046	6.026	0,03
5.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN' 7.750% 15-Jan-2032	7.040	0,03
5.000	KLA Corp 3.300% 01-Mar-2050	5.355	0,03
5.000	KLA Corp 4.100% 15-Mar-2029	5.654	0,03
20.000	KLA Corp 4.650% 01-Nov-2024	21.701	0,10
5.000	Koninklijke Philips NV 5.000% 15-Mar-2042	6.386	0,03
5.000	Koninklijke Philips NV 6.875% 11-Mar-2038	7.333	0,04
5.000	Kroger Co/The 2.200% 01-May-2030	4.991	0,02
10.000	L3Harris Technologies Inc 3.832% 27-Apr-2025	10.673	0,05
15.000	L3Harris Technologies Inc 3.950% 28-May-2024	15.878	0,08
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.400% 15-Jun-2028	11.242	0,05
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.854% 27-Apr-2035	12.252	0,06
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 2.950% 01-Dec-2029	5.213	0,02
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 4.700% 01-Feb-2045	6.118	0,03
10.000	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	10.189	0,05
10.000	Lazard Group LLC 3.625% 01-Mar-2027	10.728	0,05
5.000	Lazard Group LLC 3.750% 13-Feb-2025	5.324	0,03
5.000	Legg Mason Inc 4.750% 15-Mar-2026	5.611	0,03
5.000	Leidos Inc 2.300% 15-Feb-2031	4.822	0,02
5.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	5.169	0,02
15.000	Life Storage LP 3.875% 15-Dec-2027	16.480	0,08
20.000	Lockheed Martin Corp 3.550% 15-Jan-2026	21.680	0,10
5.000	Lockheed Martin Corp 4.090% 15-Sep-2052	6.168	0,03
20.000	Lowe's Cos Inc 4.050% 03-May-2047	23.146	0,11
10.000	Lowe's Cos Inc 6.500% 15-Mar-2029	12.757	0,06
10.000	LyondellBasell Industries NV 4.625% 26-Feb-2055	12.274	0,06
5.000	Macquarie Bank Ltd '144A' 3.624% 03-Jun-2030	5.228	0,03
10.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 2.691% 23-Jun-2032	9.996	0,05
5.000	Magellan Midstream Partners LP 3.950% 01-Mar-2050	5.329	0,03
5.000	Magellan Midstream Partners LP 4.200% 03-Oct-2047	5.480	0,03
20.000	Marriott International Inc/MD 3.600% 15-Apr-2024	20.931	0,10
2.000	Marriott International Inc/MD 5.750% 01-May-2025	2.254	0,01
5.000	Mars Inc '144A' 3.200% 01-Apr-2030	5.395	0,03
5.000	Mars Inc '144A' 4.200% 01-Apr-2059	6.448	0,03
15.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.300% 14-Mar-2023	15.399	0,07
5.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.875% 15-Mar-2024	5.292	0,03
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15-Mar-2029	11.419	0,05
15.000	Martin Marietta Materials Inc 3.500% 15-Dec-2027	16.155	0,08
5.000	Massachusetts Institute of Technology 3.885% 01-Jul-2116	6.296	0,03
5.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 3.729% 15-Oct-2070	5.580	0,03
10.000	Mastercard Inc 2.950% 01-Jun-2029	10.732	0,05
15.000	McCormick & Co Inc/MD 0.900% 15-Feb-2026	14.518	0,07
15.000	McCormick & Co Inc/MD 1.850% 15-Feb-2031	14.340	0,07
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 1.450% 01-Sep-2025	5.051	0,02
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.375% 26-May-2025	5.320	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.500% 01-Mar-2027	5.408	0,03
10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.700% 30-Jan-2026	10.774	0,05
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.800% 01-Apr-2028	5.502	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050	6.090	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.450% 01-Sep-2048	6.193	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.600% 26-May-2045	6.242	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.700% 09-Dec-2035	6.106	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.875% 09-Dec-2045	6.459	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 6.300% 15-Oct-2037	7.051	0,03
15.000	Merck & Co Inc 2.750% 10-Feb-2025	15.722	0,08

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	Merck & Co Inc 2.800% 18-May-2023	10.298	0,05
5.000	Merck & Co Inc 2.900% 07-Mar-2024	5.220	0,02
10.000	Merck & Co Inc 3.400% 07-Mar-2029	10.898	0,05
5.000	MetLife Inc 10.750% 01-Aug-2039	8.485	0,04
19.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 1.950% 13-Jan-2023	19.249	0,09
5.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 2.950% 09-Apr-2030	5.283	0,03
5.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 3.000% 10-Jan-2023	5.121	0,02
15.000	Microchip Technology Inc 0.972% 15-Feb-2024	14.852	0,07
20.000	Microchip Technology Inc 2.670% 01-Sep-2023	20.436	0,10
4.000	Microsoft Corp 2.675% 01-Jun-2060	4.019	0,02
10.000	Microsoft Corp 2.921% 17-Mar-2052	10.688	0,05
10.000	Microsoft Corp 3.041% 17-Mar-2062	10.780	0,05
15.000	Microsoft Corp 4.200% 03-Nov-2035	18.426	0,09
15.000	Mid-America Apartments LP 3.750% 15-Jun-2024	15.806	0,08
5.000	Midwest Connector Capital Co LLC '144A' 3.900% 01-Apr-2024	5.186	0,02
10.000	Mississippi Power Co 3.950% 30-Mar-2028	10.976	0,05
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.193% 25-Feb-2025	10.210	0,05
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.559% 25-Feb-2030	10.106	0,05
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 0.848% 15-Sep-2024	9.956	0,05
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1.538% 20-Jul-2027	9.833	0,05
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 2.494% 13-Oct-2032	10.036	0,05
15.000	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd '144A' FRN (Perpetual) 4.950% 06-Mar-2029	17.100	0,08
35.000	Mizuho Financial Group Inc 4.018% 05-Mar-2028	38.895	0,19
15.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 3.153% 16-Jul-2030	15.759	0,08
15.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 3.922% 11-Sep-2024	15.678	0,08
15.000	Mondelez International Inc 2.750% 13-Apr-2030	15.490	0,07
5.000	Moody's Corp 4.250% 01-Feb-2029	5.651	0,03
5.000	Morgan Stanley 3.625% 20-Jan-2027	5.428	0,03
15.000	Morgan Stanley 3.875% 29-Apr-2024	15.913	0,08
5.000	Morgan Stanley 3.950% 23-Apr-2027	5.505	0,03
10.000	Morgan Stanley 5.000% 24-Nov-2025	11.204	0,05
20.000	Morgan Stanley FRN 1.593% 04-May-2027	19.808	0,10
10.000	Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028	10.796	0,05
20.000	Morgan Stanley FRN 3.737% 24-Apr-2024	20.699	0,10
10.000	Morgan Stanley FRN 3.971% 22-Jul-2038	11.444	0,06
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3.750% 25-Feb-2023	10.347	0,05
5.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3.875% 27-Jan-2026	5.415	0,03
5.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4.000% 23-Jul-2025	5.426	0,03
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4.350% 08-Sep-2026	11.059	0,05
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031	10.252	0,05
5.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 3.772% 24-Jan-2029	5.449	0,03
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 4.431% 23-Jan-2030	11.415	0,05
5.000	Morgan Stanley 'MTN' 3.125% 27-Jul-2026	5.305	0,03
15.000	Morgan Stanley 'MTN' 4.100% 22-May-2023	15.627	0,08
15.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 2.720% 22-Jul-2025	15.470	0,07
20.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 3.822% 01-Apr-2031	21.838	0,11
12.000	Motorola Solutions Inc 4.000% 01-Sep-2024	12.791	0,06
10.000	Motorola Solutions Inc 4.600% 23-May-2029	11.446	0,06
10.000	MPLX LP 4.500% 15-Jul-2023	10.415	0,05
5.000	MPLX LP 4.500% 15-Apr-2038	5.622	0,03
5.000	MPLX LP 5.200% 01-Mar-2047	6.155	0,03
5.000	MPLX LP 5.500% 15-Feb-2049	6.420	0,03
10.000	Narragansett Electric Co/The '144A' 5.638% 15-Mar-2040	12.953	0,06
10.000	Nasdaq Inc 3.850% 30-Jun-2026	10.920	0,05
5.000	Nasdaq Inc 4.250% 01-Jun-2024	5.316	0,03
10.000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.990% 21-May-2031	10.051	0,05
15.000	National Fuel Gas Co 2.950% 01-Mar-2031	15.106	0,07
5.000	National Fuel Gas Co 3.950% 15-Sep-2027	5.317	0,03
5.000	National Fuel Gas Co 5.200% 15-Jul-2025	5.487	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	National Retail Properties Inc 3.000% 15-Apr-2052	9.520	0,05
10.000	National Retail Properties Inc 3.900% 15-Jun-2024	10.570	0,05
10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 4.023% 01-Nov-2032	11.308	0,05
20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp FRN 5.250% 20-Apr-2046	21.538	0,10
35.000	Nationwide Building Society '144A' 3.900% 21-Jul-2025	37.792	0,18
10.000	Nationwide Building Society '144A' FRN 4.125% 18-Oct-2032	10.677	0,05
5.000	Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 9.375% 15-Aug-2039	8.678	0,04
25.000	NatWest Group Plc 5.125% 28-May-2024	26.978	0,13
20.000	NatWest Group Plc 6.100% 10-Jun-2023	21.332	0,10
10.000	NatWest Group Plc FRN 3.032% 28-Nov-2035	9.889	0,05
10.000	NatWest Group Plc FRN 5.076% 27-Jan-2030	11.618	0,06
5.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.350% 24-Sep-2023	5.208	0,02
5.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.500% 24-Sep-2025	5.369	0,03
5.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.900% 24-Sep-2038	5.837	0,03
10.000	Nevada Power Co 6.750% 01-Jul-2037	14.881	0,07
5.000	New York and Presbyterian Hospital/The 3.954% 01-Aug-2119	6.129	0,03
5.000	New York Community Bancorp Inc FRN 5.900% 06-Nov-2028	5.386	0,03
10.000	New York Life Global Funding '144A' 0.950% 24-Jun-2025	9.867	0,05
5.000	New York Life Global Funding '144A' 1.100% 05-May-2023	5.024	0,02
5.000	New York Life Global Funding '144A' 2.000% 22-Jan-2025	5.109	0,02
5.000	New York Life Insurance Co '144A' 6.750% 15-Nov-2039	7.597	0,04
10.000	New York State Electric & Gas Corp '144A' 3.250% 01-Dec-2026	10.654	0,05
10.000	NewMarket Corp 2.700% 18-Mar-2031	9.981	0,05
15.000	NewMarket Corp 4.100% 15-Dec-2022	15.455	0,07
5.000	Newmont Corp 2.800% 01-Oct-2029	5.151	0,02
5.000	Newmont Corp 4.875% 15-Mar-2042	6.293	0,03
5.000	Newmont Corp 6.250% 01-Oct-2039	7.002	0,03
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 0.650% 01-Mar-2023	4.991	0,02
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 2.750% 01-Nov-2029	5.147	0,02
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 4.800% 01-Dec-2077	5.334	0,03
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 5.650% 01-May-2079	5.675	0,03
10.000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15-Aug-2027	11.144	0,05
10.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 5.100% 18-Oct-2044	10.780	0,05
20.000	NiSource Inc 0.950% 15-Aug-2025	19.493	0,09
10.000	NiSource Inc 1.700% 15-Feb-2031	9.360	0,05
5.000	NiSource Inc 4.375% 15-May-2047	5.922	0,03
5.000	NiSource Inc 5.250% 15-Feb-2043	6.436	0,03
20.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 3.043% 15-Sep-2023	20.532	0,10
20.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.810% 17-Sep-2030	22.413	0,11
15.000	Norfolk Southern Corp 2.550% 01-Nov-2029	15.396	0,07
5.000	Norfolk Southern Corp 3.850% 15-Jan-2024	5.243	0,03
10.000	Norfolk Southern Corp 3.942% 01-Nov-2047	11.644	0,06
10.000	Norfolk Southern Corp 4.650% 15-Jan-2046	12.752	0,06
5.000	Norfolk Southern Corp 4.837% 01-Oct-2041	6.341	0,03
10.000	Northrop Grumman Corp 2.930% 15-Jan-2025	10.428	0,05
5.000	Northrop Grumman Corp 4.030% 15-Oct-2047	5.928	0,03
5.000	Northrop Grumman Corp 4.750% 01-Jun-2043	6.322	0,03
10.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 3.625% 30-Sep-2059	11.094	0,05
10.000	Novartis Capital Corp 2.000% 14-Feb-2027	10.173	0,05
10.000	Novartis Capital Corp 3.400% 06-May-2024	10.558	0,05
10.000	NRG Energy Inc '144A' 2.450% 02-Dec-2027	9.924	0,05
10.000	Nucor Corp 2.979% 15-Dec-2055	9.899	0,05
10.000	Nucor Corp 4.000% 01-Aug-2023	10.428	0,05
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 5.550% 01-Dec-2028	23.998	0,12



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
10.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	10.016	0,05
5.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	5.195	0,02
20.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	25.540	0,12
5.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030	5.672	0,03
5.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.375% 01-Aug-2023	5.220	0,02
15.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 15-Jan-2025	16.045	0,08
10.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 01-Apr-2027	10.951	0,05
10.000	ONEOK Inc 4.500% 15-Mar-2050	11.147	0,05
5.000	ONEOK Partners LP 6.125% 01-Feb-2041	6.338	0,03
5.000	ONEOK Partners LP 6.200% 15-Sep-2043	6.504	0,03
5.000	ONEOK Partners LP 6.850% 15-Oct-2037	6.736	0,03
10.000	Oracle Corp 2.400% 15-Sep-2023	10.203	0,05
10.000	Oracle Corp 2.500% 01-Apr-2025	10.245	0,05
20.000	Oracle Corp 2.650% 15-Jul-2026	20.586	0,10
10.000	Oracle Corp 2.800% 01-Apr-2027	10.322	0,05
10.000	Oracle Corp 2.950% 15-Nov-2024	10.409	0,05
5.000	Oracle Corp 3.625% 15-Jul-2023	5.184	0,02
10.000	Oracle Corp 3.800% 15-Nov-2037	10.484	0,05
10.000	Oracle Corp 3.850% 15-Jul-2036	10.599	0,05
10.000	Oracle Corp 3.850% 01-Apr-2060	9.945	0,05
10.000	Oracle Corp 3.900% 15-May-2035	10.746	0,05
10.000	Oracle Corp 4.300% 08-Jul-2034	11.107	0,05
10.000	Oracle Corp 4.375% 15-May-2055	11.018	0,05
10.000	Oracle Corp 4.500% 08-Jul-2044	11.351	0,05
10.000	Oracle Corp 6.500% 15-Apr-2038	13.541	0,07
10.000	Orange SA 9.000% 01-Mar-2031	15.354	0,07
10.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044	12.300	0,06
15.000	O'Reilly Automotive Inc 3.900% 01-Jun-2029	16.591	0,08
10.000	O'Reilly Automotive Inc 4.350% 01-Jun-2028	11.298	0,05
15.000	ORIX Corp 2.250% 09-Mar-2031	14.995	0,07
5.000	ORIX Corp 3.250% 04-Dec-2024	5.273	0,03
5.000	ORIX Corp 4.050% 16-Jan-2024	5.281	0,03
10.000	Otis Worldwide Corp 2.565% 15-Feb-2030	10.163	0,05
20.000	Owl Rock Capital Corp 3.750% 22-Jul-2025	20.744	0,10
20.000	Pacific Gas and Electric Co 1.700% 15-Nov-2023	20.051	0,10
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.250% 15-Mar-2046	10.038	0,05
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.950% 01-Jul-2050	10.952	0,05
5.000	PacifiCorp 3.600% 01-Apr-2024	5.244	0,03
10.000	PacifiCorp 7.700% 15-Nov-2031	14.323	0,07
10.000	Packaging Corp of America 3.000% 15-Dec-2029	10.477	0,05
15.000	Packaging Corp of America 3.650% 15-Sep-2024	15.857	0,08
20.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 4.500% 15-Mar-2023	20.649	0,10
10.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.500% 15-Feb-2024	10.730	0,05
5.000	Parker-Hannifin Corp 4.100% 01-Mar-2047	5.848	0,03
15.000	PartnerRe Finance B LLC 3.700% 02-Jul-2029	16.369	0,08
10.000	PayPal Holdings Inc 1.350% 01-Jun-2023	10.085	0,05
5.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.700% 14-Mar-2023	5.098	0,02
5.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.700% 01-Nov-2024	5.157	0,02
15.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.350% 01-Nov-2029	15.935	0,08
15.000	Pentair Finance Sarl 4.500% 01-Jul-2029	17.001	0,08
10.000	People's United Financial Inc 3.650% 06-Dec-2022	10.195	0,05
10.000	PepsiCo Inc 1.950% 21-Oct-2031	10.018	0,05
10.000	PepsiCo Inc 2.750% 19-Mar-2030	10.577	0,05
15.000	PepsiCo Inc 3.500% 17-Jul-2025	16.120	0,08
5.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	4.991	0,02
10.000	Pfizer Inc 2.550% 28-May-2040	10.028	0,05
5.000	Pfizer Inc 3.000% 15-Jun-2023	5.177	0,02
10.000	Pfizer Inc 7.200% 15-Mar-2039	16.202	0,08
5.000	Philip Morris International Inc 3.125% 17-Aug-2027	5.349	0,03
5.000	Philip Morris International Inc 3.375% 11-Aug-2025	5.310	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Philip Morris International Inc 3.375% 15-Aug-2029	5.398	0,03
10.000	Phillips 66 4.650% 15-Nov-2034	11.755	0,06
5.000	Phillips 66 4.875% 15-Nov-2044	6.336	0,03
5.000	Phillips 66 5.875% 01-May-2042	6.919	0,03
10.000	Phillips 66 Partners LP 4.900% 01-Oct-2046	12.243	0,06
5.000	Physicians Realty LP 3.950% 15-Jan-2028	5.471	0,03
10.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.700% 15-Jun-2044	10.688	0,05
10.000	PNC Financial Services Group Inc/The 2.550% 22-Jan-2030	10.301	0,05
10.000	Precision Castparts Corp 2.500% 15-Jan-2023	10.150	0,05
5.000	Principal Financial Group Inc 3.100% 15-Nov-2026	5.266	0,03
15.000	Principal Financial Group Inc 3.700% 15-May-2029	16.604	0,08
15.000	Principal Life Global Funding II '144A' 2.250% 21-Nov-2024	15.343	0,07
20.000	Procter & Gamble Co/The 1.200% 29-Oct-2030	18.959	0,09
5.000	Procter & Gamble Co/The 2.700% 02-Feb-2026	5.290	0,03
5.000	Procter & Gamble Co/The 5.550% 05-Mar-2037	7.150	0,03
15.000	Progressive Corp/The 4.000% 01-Mar-2029	16.977	0,08
10.000	Prologis LP 4.375% 01-Feb-2029	11.462	0,06
15.000	Prospect Capital Corp 3.364% 15-Nov-2026	14.993	0,07
20.000	Prospect Capital Corp 3.706% 22-Jan-2026	20.369	0,10
10.000	Prudential Financial Inc FRN 5.200% 15-Mar-2044	10.422	0,05
15.000	Prudential Financial Inc FRN 5.375% 15-May-2045	16.023	0,08
20.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	20.816	0,10
5.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 2.100% 10-Mar-2030	5.017	0,02
15.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	16.043	0,08
10.000	Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 5.500% 01-Mar-2040	13.541	0,07
10.000	Public Storage 3.385% 01-May-2029	10.920	0,05
5.000	Puget Energy Inc 3.650% 15-May-2025	5.290	0,03
15.000	Puget Energy Inc 4.100% 15-Jun-2030	16.251	0,08
5.000	Quest Diagnostics Inc 2.950% 30-Jun-2030	5.207	0,02
10.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	10.561	0,05
10.000	Raytheon Technologies Corp 3.030% 15-Mar-2052	10.110	0,05
10.000	Raytheon Technologies Corp 3.500% 15-Mar-2027	10.725	0,05
5.000	Raytheon Technologies Corp 3.950% 16-Aug-2025	5.428	0,03
10.000	Raytheon Technologies Corp 4.125% 16-Nov-2028	11.204	0,05
5.000	Raytheon Technologies Corp 4.150% 15-May-2045	5.860	0,03
10.000	Raytheon Technologies Corp 4.500% 01-Jun-2042	12.491	0,06
5.000	Raytheon Technologies Corp 4.875% 15-Oct-2040	6.361	0,03
10.000	Realty Income Corp 3.650% 15-Jan-2028	10.910	0,05
10.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc '144A' 3.000% 26-Jun-2027	10.626	0,05
5.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 2.800% 15-Sep-2050	4.718	0,02
5.000	RELX Capital Inc 4.000% 18-Mar-2029	5.556	0,03
10.000	Republic Services Inc 1.750% 15-Feb-2032	9.448	0,05
5.000	Republic Services Inc 2.300% 01-Mar-2030	5.023	0,02
15.000	Republic Services Inc 3.375% 15-Nov-2027	16.098	0,08
15.000	Reynolds American Inc 4.450% 12-Jun-2025	16.209	0,08
5.000	Reynolds American Inc 5.850% 15-Aug-2045	6.105	0,03
20.000	Roper Technologies Inc 1.000% 15-Sep-2025	19.567	0,09
10.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2.250% 01-Nov-2024	10.281	0,05
20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.650% 27-Jan-2026	22.211	0,11
5.000	RPM International Inc 4.550% 01-Mar-2029	5.676	0,03
10.000	S&P Global Inc 2.950% 22-Jan-2027	10.572	0,05
5.000	S&P Global Inc 4.000% 15-Jun-2025	5.416	0,03
15.000	Sabal Trail Transmission LLC '144A' 4.682% 01-May-2038	18.065	0,09
20.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.500% 15-May-2030	22.601	0,11
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.000% 15-Mar-2027	11.246	0,05
5.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15-Apr-2023	5.231	0,03
5.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01-Mar-2025	5.557	0,03
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.750% 15-May-2024	10.883	0,05

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30-Jun-2026	5.745	0,03
4.000	San Diego Gas & Electric Co 1.700% 01-Oct-2030	3.836	0,02
20.000	Sands China Ltd 5.125% 08-Aug-2025	21.004	0,10
20.000	Santander Holdings USA Inc 3.400% 18-Jan-2023	20.447	0,10
5.000	Santander Holdings USA Inc 3.500% 07-Jun-2024	5.215	0,02
20.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 4.796% 15-Nov-2024	21.239	0,10
20.000	Santander UK Plc 2.100% 13-Jan-2023	20.294	0,10
5.000	Santander UK Plc 4.000% 13-Mar-2024	5.296	0,03
5.000	Santander UK Plc '144A' 5.000% 07-Nov-2023	5.323	0,03
5.000	SBL Holdings Inc '144A' 5.125% 13-Nov-2026	5.448	0,03
50.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	53.553	0,26
35.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	37.151	0,18
5.000	Sempra Energy 6.000% 15-Oct-2039	6.931	0,03
10.000	Sempra Energy FRN 4.125% 01-Apr-2052	10.142	0,05
20.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	19.029	0,09
10.000	SES GLOBAL Americas Holdings GP '144A' 5.300% 25-Mar-2044	11.487	0,06
10.000	Shell International Finance BV 6.375% 15-Dec-2038	14.621	0,07
5.000	Sherwin-Williams Co/The 2.300% 15-May-2030	5.000	0,02
10.000	Sherwin-Williams Co/The 2.950% 15-Aug-2029	10.541	0,05
5.000	Sherwin-Williams Co/The 3.800% 15-Aug-2049	5.667	0,03
5.000	Sherwin-Williams Co/The 4.550% 01-Aug-2045	6.131	0,03
15.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23-Sep-2023	15.435	0,07
10.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.200% 23-Sep-2026	10.624	0,05
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.350% 15-Oct-2026	10.301	0,05
5.000	Sirius International Group Ltd '144A' 4.600% 01-Nov-2026	5.121	0,02
15.000	SK Telecom Co Ltd 'REGS' 3.750% 16-Apr-2023	15.506	0,07
15.000	Societe Generale SA '144A' 2.625% 16-Oct-2024	15.423	0,07
20.000	Societe Generale SA '144A' 4.250% 14-Apr-2025	21.308	0,10
12.000	Societe Generale SA '144A' 4.750% 14-Sep-2028	13.649	0,07
10.000	Societe Generale SA '144A' 5.625% 24-Nov-2045	13.235	0,06
8.549	Solar Star Funding LLC '144A' 5.375% 30-Jun-2035	9.882	0,05
10.000	Southern California Edison Co 5.950% 01-Feb-2038	12.979	0,06
5.000	Southern California Gas Co 2.550% 01-Feb-2030	5.137	0,02
10.000	Southern California Gas Co 2.600% 15-Jun-2026	10.403	0,05
10.000	Southern Co Gas Capital Corp 1.750% 15-Jan-2031	9.393	0,05
5.000	Southern Co Gas Capital Corp 2.450% 01-Oct-2023	5.107	0,02
5.000	Southern Co Gas Capital Corp 4.400% 01-Jun-2043	5.730	0,03
10.000	Southern Co/The 1.750% 15-Mar-2028	9.750	0,05
5.000	Southern Co/The 2.950% 01-Jul-2023	5.123	0,02
5.000	Southern Co/The 3.250% 01-Jul-2026	5.297	0,03
20.000	Southern Co/The FRN 4.000% 15-Jan-2051	20.500	0,10
10.000	Southern Copper Corp 3.875% 23-Apr-2025	10.701	0,05
5.000	Southern Copper Corp 5.875% 23-Apr-2045	6.876	0,03
5.000	Southern Copper Corp 6.750% 16-Apr-2040	7.005	0,03
5.000	Southwestern Electric Power Co 3.900% 01-Apr-2045	5.427	0,03
10.000	Southwestern Electric Power Co 6.200% 15-Mar-2040	13.926	0,07
5.000	Spectra Energy Partners LP 4.500% 15-Mar-2045	5.812	0,03
10.000	Spectra Energy Partners LP 4.750% 15-Mar-2024	10.660	0,05
5.000	Standard Chartered Bank '144A' 8.000% 30-May-2031	6.817	0,03
30.000	Standard Chartered Plc '144A' 3.950% 11-Jan-2023	30.747	0,15
35.000	Standard Chartered Plc '144A' 4.050% 12-Apr-2026	37.737	0,18
5.000	Standard Chartered Plc '144A' 5.300% 09-Jan-2043	6.116	0,03
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.819% 30-Jan-2026	20.525	0,10
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.644% 01-Apr-2031	11.337	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
15.000	Stanley Black & Decker Inc FRN 4.000% 15-Mar-2060	15.432	0,07
5.000	Starbucks Corp 2.250% 12-Mar-2030	4.976	0,02
5.000	Starbucks Corp 2.550% 15-Nov-2030	5.111	0,02
5.000	Starbucks Corp 3.100% 01-Mar-2023	5.121	0,02
5.000	Starbucks Corp 3.500% 01-Mar-2028	5.416	0,03
5.000	Starbucks Corp 3.750% 01-Dec-2047	5.537	0,03
15.000	Starbucks Corp 3.800% 15-Aug-2025	16.203	0,08
5.000	Starbucks Corp 4.300% 15-Jun-2045	5.906	0,03
10.000	Starbucks Corp 4.500% 15-Nov-2048	12.440	0,06
5.000	Steel Dynamics Inc 5.000% 15-Dec-2026	5.140	0,02
5.000	Stellantis NV 5.250% 15-Apr-2023	5.251	0,03
5.000	Stryker Corp 3.375% 01-Nov-2025	5.337	0,03
5.000	Stryker Corp 3.500% 15-Mar-2026	5.366	0,03
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.474% 08-Jul-2025	9.961	0,05
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.130% 08-Jul-2030	9.737	0,05
6.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.724% 27-Sep-2029	6.156	0,03
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.750% 15-Jan-2030	5.128	0,02
13.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.040% 16-Jul-2029	13.576	0,07
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.944% 19-Jul-2028	5.550	0,03
7.000	Suzano Austria GmbH 3.750% 15-Jan-2031	7.126	0,03
5.000	SVB Financial Group 3.500% 29-Jan-2025	5.286	0,03
15.000	Synchrony Financial 4.250% 15-Aug-2024	15.899	0,08
5.000	Sysco Corp 3.300% 15-Jul-2026	5.333	0,03
10.000	Sysco Corp 4.500% 01-Apr-2046	11.707	0,06
10.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.050% 31-Mar-2030	9.815	0,05
15.000	TC PipeLines LP 4.375% 13-Mar-2025	16.109	0,08
5.000	Telstra Corp Ltd '144A' 3.125% 07-Apr-2025	5.256	0,03
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2.390% 03-Jun-2030	9.814	0,05
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.595% 19-Jan-2028	10.628	0,05
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.925% 19-Jan-2038	10.663	0,05
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	10.892	0,05
5.000	Tennessee Gas Pipeline Co LLC '144A' 2.900% 01-Mar-2030	5.089	0,02
5.000	Texas Eastern Transmission LP 7.000% 15-Jul-2032	6.789	0,03
5.000	Texas Instruments Inc 1.750% 04-May-2030	4.914	0,02
5.000	Texas Instruments Inc 2.250% 04-Sep-2029	5.117	0,02
10.000	Texas Instruments Inc 3.875% 15-Mar-2039	11.871	0,06
5.000	Thomson Reuters Corp 5.500% 15-Aug-2035	6.477	0,03
5.000	Thomson Reuters Corp 5.850% 15-Apr-2040	7.022	0,03
5.000	Time Warner Cable LLC 4.500% 15-Sep-2042	5.478	0,03
5.000	Time Warner Cable LLC 5.500% 01-Sep-2041	6.089	0,03
5.000	Time Warner Cable LLC 5.875% 15-Nov-2040	6.266	0,03
5.000	Time Warner Cable LLC 6.550% 01-May-2037	6.566	0,03
5.000	Time Warner Cable LLC 7.300% 01-Jul-2038	7.104	0,03
5.000	Timken Co/The 3.875% 01-Sep-2024	5.261	0,03
10.000	T-Mobile USA Inc 2.550 % 15-Feb-2031	9.969	0,05
25.000	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2025	26.516	0,13
10.000	T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027	10.841	0,05
15.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	16.441	0,08
10.000	T-Mobile USA Inc 4.500% 15-Apr-2050	11.761	0,06
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 0.750% 12-Jun-2023	20.009	0,10
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 1.900% 01-Dec-2022	5.063	0,02
19.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 2.650% 12-Jun-2024	19.723	0,10
15.000	Toyota Motor Corp 3.669% 20-Jul-2028	16.635	0,08
5.000	Toyota Motor Credit Corp 3.350% 08-Jan-2024	5.240	0,03
5.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 1.150% 13-Aug-2027	4.864	0,02
5.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 2.250% 18-Oct-2023	5.130	0,02
5.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3.000% 01-Apr-2025	5.252	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
5.000	Trane Technologies Global Holding Co Ltd 5.750% 15-Jun-2043	7.079	0,03
5.000	TransCanada PipeLines Ltd 3.750% 16-Oct-2023	5.206	0,02
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.625% 01-Mar-2034	11.778	0,06
5.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.750% 15-May-2038	5.999	0,03
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 5.850% 15-Mar-2036	13.105	0,06
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 7.625% 15-Jan-2039	15.623	0,08
7.000	Transelec SA '144A' 4.625% 26-Jul-2023	7.329	0,04
10.000	Travelers Cos Inc/The 'MTN' 6.250% 15-Jun-2037	14.401	0,07
10.000	Trimble Inc 4.150% 15-Jun-2023	10.405	0,05
5.000	Tri-State Generation and Transmission Association Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2040	6.784	0,03
10.000	Truist Bank 3.200% 01-Apr-2024	10.475	0,05
5.000	Truist Bank 'BKNT' 2.250% 11-Mar-2030	4.997	0,02
20.000	Truist Bank 'BKNT' 3.000% 02-Feb-2023	20.448	0,10
10.000	Trust Fibrá Uno 'REGS' 6.390% 15-Jan-2050	11.695	0,06
5.000	Tyson Foods Inc 3.550% 02-Jun-2027	5.390	0,03
5.000	Tyson Foods Inc 3.950% 15-Aug-2024	5.319	0,03
10.000	Tyson Foods Inc 4.550% 02-Jun-2047	12.465	0,06
5.000	Tyson Foods Inc 5.100% 28-Sep-2048	6.764	0,03
5.000	UBS Group AG '144A' 3.491% 23-May-2023	5.051	0,02
25.000	UBS Group AG '144A' 4.125% 24-Sep-2025	27.027	0,13
5.000	UDR Inc 3.100% 01-Nov-2034	5.202	0,02
5.000	UDR Inc 'MTN' 3.200% 15-Jan-2030	5.265	0,03
15.000	Unilever Capital Corp 2.125% 06-Sep-2029	15.149	0,07
5.000	Unilever Capital Corp 3.500% 22-Mar-2028	5.471	0,03
10.000	Union Electric Co 8.450% 15-Mar-2039	16.801	0,08
5.000	Union Pacific Corp 2.400% 05-Feb-2030	5.106	0,02
5.000	Union Pacific Corp 3.150% 01-Mar-2024	5.215	0,02
5.000	Union Pacific Corp 3.250% 15-Jan-2025	5.264	0,03
10.000	Union Pacific Corp 3.646% 15-Feb-2024	10.458	0,05
5.000	Union Pacific Corp 3.750% 15-Mar-2024	5.260	0,03
5.000	Union Pacific Corp 3.750% 05-Feb-2070	5.713	0,03
5.000	Union Pacific Corp 'MTN' 3.550% 15-Aug-2039	5.567	0,03
10.000	UnitedHealth Group Inc 2.300% 15-May-2031	10.196	0,05
5.000	UnitedHealth Group Inc 2.875% 15-Mar-2023	5.129	0,02
4.000	UnitedHealth Group Inc 2.950% 15-Oct-2027	4.272	0,02
5.000	UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Feb-2024	5.273	0,03
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Aug-2039	11.138	0,05
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.750% 15-Jul-2025	10.857	0,05
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15-Aug-2059	12.056	0,06
5.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	5.139	0,02
20.000	US Bancorp 'MTN' 3.600% 11-Sep-2024	21.261	0,10
5.000	Vale Overseas Ltd 6.875% 21-Nov-2036	6.652	0,03
15.000	Valero Energy Corp 6.625% 15-Jun-2037	20.291	0,10
5.000	Ventas Realty LP 4.000% 01-Mar-2028	5.541	0,03
20.000	Verisk Analytics Inc 4.000% 15-Jun-2025	21.514	0,10
7.000	Verizon Communications Inc 1.680% 30-Oct-2030	6.665	0,03
10.000	Verizon Communications Inc 1.750% 20-Jan-2031	9.487	0,05
10.000	Verizon Communications Inc 2.625% 15-Aug-2026	10.428	0,05
13.000	Verizon Communications Inc 2.987% 30-Oct-2056	12.388	0,06
15.000	Verizon Communications Inc 3.376% 15-Feb-2025	15.974	0,08
10.000	Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051	10.835	0,05
10.000	Verizon Communications Inc 3.700% 22-Mar-2061	10.912	0,05
10.000	Verizon Communications Inc 4.016% 03-Dec-2029	11.233	0,05
5.000	Verizon Communications Inc 4.125% 15-Aug-2046	5.833	0,03
20.000	Verizon Communications Inc 4.272% 15-Jan-2036	23.535	0,11
20.000	Verizon Communications Inc 4.329% 21-Sep-2028	22.758	0,11
15.000	Verizon Communications Inc 4.400% 01-Nov-2034	17.522	0,08
10.000	Verizon Communications Inc 4.500% 10-Aug-2033	11.789	0,06
10.000	Verizon Communications Inc 4.862% 21-Aug-2046	12.944	0,06
5.000	Verizon Communications Inc 5.012% 15-Apr-2049	6.662	0,03
10.000	Viatis Inc 3.850% 22-Jun-2040	10.636	0,05
5.000	Vinci SA '144A' 3.750% 10-Apr-2029	5.472	0,03
5.000	Visa Inc 2.750% 15-Sep-2027	5.278	0,03
20.000	Visa Inc 3.150% 14-Dec-2025	21.345	0,10
5.000	Visa Inc 4.150% 14-Dec-2035	6.002	0,03
30.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 3.550% 15-Jul-2024	30.918	0,15
5.000	VMware Inc 1.400% 15-Aug-2026	4.922	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
15.000	VMware Inc 3.900% 21-Aug-2027	16.353	0,08
5.000	VMware Inc 4.500% 15-May-2025	5.451	0,03
5.000	Vodafone Group Plc 4.250% 17-Sep-2050	5.807	0,03
10.000	Vodafone Group Plc 4.375% 30-May-2028	11.270	0,05
10.000	Vodafone Group Plc 5.000% 30-May-2038	12.483	0,06
10.000	Vodafone Group Plc 5.250% 30-May-2048	13.099	0,06
20.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.625% 13-Nov-2025	22.058	0,11
15.000	Vulcan Materials Co 3.900% 01-Apr-2027	16.437	0,08
5.000	Vulcan Materials Co 4.500% 15-Jun-2047	6.175	0,03
10.000	W R Berkley Corp 4.750% 01-Aug-2044	12.556	0,06
10.000	Walmart Inc 3.700% 26-Jun-2028	11.212	0,05
10.000	Walmart Inc 3.950% 28-Jun-2038	11.994	0,06
10.000	Walt Disney Co/The 2.650% 13-Jan-2031	10.426	0,05
10.000	Walt Disney Co/The 3.375% 15-Nov-2026	10.769	0,05
5.000	Walt Disney Co/The 3.800% 13-May-2060	5.836	0,03
10.000	Walt Disney Co/The 6.400% 15-Dec-2035	14.357	0,07
5.000	Waste Management Inc 2.400% 15-May-2023	5.095	0,02
5.000	Waste Management Inc 3.150% 15-Nov-2027	5.347	0,03
5.000	Waste Management Inc 4.150% 15-Jul-2049	6.355	0,03
5.000	WEA Finance LLC '144A' 2.875% 15-Jan-2027	5.152	0,02
10.000	WEC Energy Group Inc 1.375% 15-Oct-2027	9.657	0,05
10.000	Weibo Corp 3.375% 08-Jul-2030	9.919	0,05
10.000	Weibo Corp 3.500% 05-Jul-2024	10.304	0,05
20.000	Wells Fargo & Co 3.000% 22-Apr-2026	21.040	0,10
20.000	Wells Fargo & Co 4.125% 15-Aug-2023	20.989	0,10
5.000	Wells Fargo & Co 7.950% 15-Nov-2029	6.890	0,03
15.000	Wells Fargo & Co FRN 3.068% 30-Apr-2041	15.457	0,07
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.750% 24-Jan-2024	10.513	0,05
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 4.150% 24-Jan-2029	11.213	0,05
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.393% 02-Jun-2028	10.177	0,05
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.406% 30-Oct-2025	10.253	0,05
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.879% 30-Oct-2030	10.416	0,05
15.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.584% 22-May-2028	16.148	0,08
10.000	Welltower Inc 3.100% 15-Jan-2030	10.498	0,05
15.000	Welltower Inc 4.000% 01-Jun-2025	16.174	0,08
5.000	West Fraser Timber Co Ltd '144A' 4.350% 15-Oct-2024	5.351	0,03
20.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	21.811	0,11
10.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 3.450% 15-Nov-2026	10.593	0,05
5.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 4.950% 15-Sep-2028	5.693	0,03
5.000	Westlake Chemical Corp 4.375% 15-Nov-2047	5.914	0,03
5.000	Westpac Banking Corp 2.350% 19-Feb-2025	5.168	0,02
5.000	Westpac Banking Corp 3.350% 08-Mar-2027	5.405	0,03
10.000	Westpac Banking Corp 4.421% 24-Jul-2039	11.744	0,06
15.000	Westpac Banking Corp FRN 2.894% 04-Feb-2030	15.332	0,07
5.000	Williams Cos Inc/The 3.700% 15-Jan-2023	5.112	0,02
10.000	Williams Cos Inc/The 3.750% 15-Jun-2027	10.811	0,05
10.000	Williams Cos Inc/The 4.300% 04-Mar-2024	10.560	0,05
15.000	Williams Cos Inc/The 4.550% 24-Jun-2024	16.063	0,08
5.000	Williams Cos Inc/The 4.900% 15-Jan-2045	6.023	0,03
5.000	Williams Cos Inc/The 6.300% 15-Apr-2040	6.800	0,03
5.000	Willis North America Inc 2.950% 15-Sep-2029	5.129	0,02
5.000	Willis North America Inc 3.600% 15-May-2024	5.241	0,03
10.000	WP Carey Inc 4.600% 01-Apr-2024	10.624	0,05
10.000	WW Grainger Inc 1.850% 15-Feb-2025	10.198	0,05
5.000	Wyeth LLC 5.950% 01-Apr-2037	7.069	0,03
15.000	XLIT Ltd 4.450% 31-Mar-2025	16.282	0,08
5.000	Zions Bancorp NA 3.250% 29-Oct-2029	5.181	0,02
15.000	Zoetis Inc 3.900% 20-Aug-2028	16.677	0,08
5.000	Zoetis Inc 3.950% 12-Sep-2047	5.906	0,03
10.000	Zoetis Inc 4.500% 13-Nov-2025	11.025	0,05
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>19.611.588</b>	<b>94,78</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps - 43.971</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 98.005)</b>			
(1.800.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 1.000% 20-Dec-2026	43.971	0,21
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>43.971</b>	<b>0,21</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 12.616</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.608)</b>				
(1)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(146.437)	1.342	0,01
(1)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(218.172)	295	0,00
(1)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(120.977)	84	0,00
6	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.182.750	10.895	0,05
<b>Summe Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>12.616</b>	<b>0,06</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 496.198 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 992.308)			496.198	2,40
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>20.164.373</b>	<b>97,45</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (7.074) 31. Dezember 2020: 44.678</b>				
(1)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(112.747)	(2.888)	(0,01)
1	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	195.105	(3.872)	(0,02)
1	SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	131.800	(314)	(0,00)
<b>Summe Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(7.074)</b>	<b>(0,03)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (53.875) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (345.060))			(53.875)	(0,26)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(60.949)</b>	<b>(0,29)</b>

<b>Nettoumlaufvermögen</b>	<b>587.881</b>	<b>2,84</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>	<b>20.691.305</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.  
Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,38
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,06
OTC-derivative Finanzinstrumente	2,60
Sonstiges Umlaufvermögen	2,96
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
Euro	US-Dollar	105.000	118.858	14. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	710
Euro	US-Dollar	17.000	19.336	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	23
US-Dollar	Kanadischer Dollar	3.958	5.000	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	5
<b>USD</b>						<b>738</b>
Pfund Sterling	US-Dollar	12.000	16.253	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(11)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	824.683	1.048.000	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.800)
US-Dollar	Euro	4.887.683	4.319.000	14. Jan. 22	Goldman Sachs	(30.520)
US-Dollar	Pfund Sterling	863.491	652.400	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(19.544)
<b>USD</b>						<b>(53.875)</b>

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	13.613	15.405	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	96
<b>USD</b>						<b>96</b>
<b>EUR</b>						<b>84</b>

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	15.267.114	20.168.943	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	495.364
<b>USD</b>						<b>495.364</b>
<b>GBP</b>						<b>365.974</b>

# BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Grundstoffe - 39.961.439</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 84.859.332)</b>		<b>39.961.439</b>	<b>2,08</b>
6.420.000	Domtar Corp 6.250% 01-Sep-2042	6.566.215	0,34
4.071.000	Domtar Corp 6.750% 15-Feb-2044	4.190.862	0,22
1.700.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	1.789.735	0,09
3.723.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	3.903.770	0,20
14.662.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	15.505.065	0,81
5.610.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	5.641.192	0,30
2.100.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	2.364.600	0,12
<b>Kommunikation - 126.738.429</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 63.388.584)</b>		<b>126.738.429</b>	<b>6,60</b>
800.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	924.272	0,05
361.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	424.002	0,02
12.055.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	13.521.370	0,70
464.000	Frontier Florida LLC 6.860% 01-Feb-2028	494.408	0,03
1.083.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	1.155.003	0,06
374.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	410.055	0,02
1.405.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	1.533.424	0,08
3.276.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	3.649.333	0,19
5.367.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	5.763.648	0,30
5.140.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	5.538.350	0,29
3.300.000	Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039	4.570.929	0,24
11.266.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	14.270.417	0,74
15.829.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	23.770.093	1,24
5.889.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	6.237.481	0,33
4.015.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	4.329.435	0,23
4.719.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	5.418.356	0,28
7.881.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	9.274.243	0,48
987.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	1.195.711	0,06
20.033.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	24.257.899	1,26
<b>Zyklische Konsumgüter - 574.267.939</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 358.211.669)</b>		<b>574.267.939</b>	<b>29,89</b>
10.974.805	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	10.618.741	0,55
14.010.851	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023	14.325.511	0,75
19.333.181	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	19.657.504	1,02
17.177.154	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	17.060.817	0,89
4.513.282	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	4.450.197	0,23
7.769.614	American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028	7.530.579	0,39
7.130.174	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	6.803.295	0,35
1.959.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	2.294.890	0,12
1.731.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	2.105.597	0,11
667.000	Bed Bath & Beyond Inc 3.749% 01-Aug-2024	673.550	0,04
140.000	Bed Bath & Beyond Inc 4.915% 01-Aug-2034	126.300	0,01
6.091.000	Bed Bath & Beyond Inc 5.165% 01-Aug-2044	5.068.473	0,26
480.000	Brinker International Inc 3.875% 15-May-2023	491.398	0,03
4.900.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	5.056.433	0,26
4.800.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	5.595.000	0,29
12.852.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	13.114.808	0,68
8.823.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	9.059.688	0,47
5.918.000	Delta Air Lines Inc 3.800% 19-Apr-2023	6.052.877	0,32
9.910.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	10.574.673	0,55
838.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	1.167.363	0,06
4.750.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	5.187.309	0,27
6.219.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	6.875.260	0,36
4.300.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	5.060.305	0,26
550.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	647.383	0,03
1.689.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	2.033.353	0,11
600.000	Ford Motor Co 7.125% 15-Nov-2025	690.180	0,04
1.030.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	1.420.417	0,07
3.620.000	Ford Motor Co 7.450% 16-Jul-2031	4.908.394	0,26
220.000	Ford Motor Co 7.500% 01-Aug-2026	259.349	0,01
4.975.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.087% 09-Jan-2023	5.065.644	0,26
3.952.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 04-May-2023	4.031.297	0,21
2.235.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	2.323.964	0,12

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
3.110.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	3.229.673	0,17
2.250.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	2.382.176	0,12
5.100.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024	5.372.774	0,28
5.100.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	5.418.138	0,28
2.741.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.140% 15-Feb-2023	2.809.662	0,15
3.130.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	3.368.287	0,18
2.200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-Aug-2023	2.291.817	0,12
2.510.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	2.729.136	0,14
2.010.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	2.162.871	0,11
4.860.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	5.530.510	0,29
4.322.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024	4.662.379	0,24
3.835.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	4.136.546	0,22
2.235.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	2.215.646	0,12
500.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000% 15-Mar-2028	573.125	0,03
6.945.929	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	6.884.707	0,36
6.648.000	Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-Feb-2023	6.723.156	0,35
5.233.000	Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-Jun-2024	5.356.263	0,28
2.990.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	2.628.090	0,14
1.172.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.375% 01-Sep-2023	1.211.772	0,06
5.626.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	5.564.198	0,29
3.634.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	3.475.703	0,18
2.190.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	2.323.426	0,12
4.900.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	5.750.836	0,30
745.000	Mattel Inc 3.150% 15-Mar-2023	760.604	0,04
5.855.000	Mattel Inc 5.450% 01-Nov-2041	6.997.720	0,36
3.100.000	Mattel Inc 6.200% 01-Oct-2040	4.019.785	0,21
496.000	Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024	520.733	0,03
11.755.000	Newell Brands Inc 4.350% 01-Apr-2023	12.122.344	0,63
15.372.000	Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026	16.782.765	0,87
3.660.000	Newell Brands Inc 5.875% 01-Apr-2036	4.516.001	0,24
7.032.000	Newell Brands Inc 6.000% 01-Apr-2046	9.032.604	0,47
7.117.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	7.159.702	0,37
18.670.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	18.371.560	0,96
12.130.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	12.254.939	0,64
21.310.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	19.904.819	1,04
6.285.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	7.087.657	0,37
12.523.000	QVC Inc 4.375% 15-Mar-2023	12.913.405	0,67
7.287.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	7.695.473	0,40
9.640.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	9.916.090	0,52
7.047.000	QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024	7.529.649	0,39
5.500.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	5.452.727	0,28
3.722.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	3.713.272	0,19
6.000.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	5.968.550	0,31
10.000.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	10.088.597	0,53
500.000	Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027	457.395	0,02
8.101.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	7.617.370	0,40
4.750.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 5.250% 15-Nov-2022	4.821.464	0,25
4.877.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	5.650.005	0,29
22.924.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023	25.073.469	1,30
30.578.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	34.286.041	1,78
1.507.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	1.602.694	0,08
2.348.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	2.560.541	0,13
1.129.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	1.257.141	0,07
27.827	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02-Jul-2022	28.454	0,00
3.430.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	3.541.475	0,18
1.279.243	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	1.275.579	0,07
16.156.204	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	16.335.976	0,85
3.246.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	3.599.084	0,19
4.191.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	5.323.471	0,28
10.150.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	10.897.344	0,57

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter - 225.134.980</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 105.320.827)</b>		<b>225.134.980</b>	<b>11,72</b>
1.661.000	ADT Security Corp/The 4.125% 15-Jun-2023	1.726.942	0,09
2.201.000	Avon Products Inc 6.500% 15-Mar-2023	2.310.500	0,12
804.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	990.050	0,05
300.000	HCA Inc 7.050% 01-Dec-2027	369.762	0,02
1.828.000	HCA Inc 7.500% 15-Nov-2095	2.673.450	0,14
600.000	HCA Inc 7.690% 15-Jun-2025	709.553	0,04
500.000	HCA Inc 8.360% 15-Apr-2024	572.917	0,03
2.200.000	IHS Markit Ltd 3.625% 01-May-2024	2.312.948	0,12
1.800.000	IHS Markit Ltd 4.125% 01-Aug-2023	1.885.311	0,10
3.700.000	IHS Markit Ltd 4.250% 01-May-2029	4.221.034	0,22
3.700.000	IHS Markit Ltd 4.750% 01-Aug-2028	4.301.787	0,22
2.700.000	IHS Markit Ltd '144A' 4.000% 01-Mar-2026	2.924.977	0,15
2.700.000	IHS Markit Ltd '144A' 4.750% 15-Feb-2025	2.946.699	0,15
9.540.000	Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026	9.992.718	0,52
16.228.000	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	19.071.224	0,99
1.250.000	Kraft Heinz Foods Co 4.625% 30-Jan-2029	1.434.581	0,08
5.004.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 15-Jul-2035	6.134.705	0,32
7.960.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042	9.919.853	0,52
9.700.000	Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045	12.378.301	0,65
1.160.000	Kraft Heinz Foods Co 6.375% 15-Jul-2028	1.441.948	0,08
3.998.000	Kraft Heinz Foods Co 6.500% 09-Feb-2040	5.695.411	0,30
4.749.000	Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-Jan-2039	6.990.597	0,36
5.463.381	Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039	8.327.107	0,43
4.456.000	North Queensland Export Terminal Pty Ltd '144A' 4.450% 15-Dec-2022	4.287.399	0,22
500.000	Owens & Minor Inc 4.375% 15-Dec-2024	531.983	0,03
2.940.000	Perrigo Co Plc 4.000% 15-Nov-2023	3.028.901	0,16
25.898.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	27.159.372	1,41
33.767.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030	34.275.600	1,78
33.235.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	35.590.391	1,85
10.948.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	10.928.959	0,57
<b>Energie - 379.945.923</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 261.936.133)</b>		<b>379.945.923</b>	<b>19,77</b>
5.700.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	6.193.820	0,32
8.226.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	8.973.414	0,47
3.000.000	Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043	3.304.425	0,17
10.522.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	11.906.485	0,62
2.083.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	2.408.937	0,13
7.200.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	8.236.728	0,43
3.220.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	3.945.756	0,21
2.411.000	Apache Corp 7.375% 15-Aug-2047	3.029.241	0,16
1.472.000	Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029	1.871.089	0,10
6.900.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	7.039.828	0,37
5.663.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	5.853.107	0,30
3.081.000	Buckeye Partners LP 4.150% 01-Jul-2023	3.161.275	0,16
295.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	307.849	0,02
2.566.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	2.505.712	0,13
6.224.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	6.116.045	0,32
1.301.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	1.512.595	0,08
1.317.000	DCP Midstream Operating LP 3.875% 15-Mar-2023	1.352.012	0,07
2.038.000	DCP Midstream Operating LP 5.600% 01-Apr-2044	2.538.166	0,13
1.220.000	DCP Midstream Operating LP 8.125% 16-Aug-2030	1.661.408	0,09
1.158.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.450% 03-Nov-2036	1.517.044	0,08
1.000.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037	1.339.025	0,07
500.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	519.277	0,03
300.000	EnLink Midstream Partners LP 4.400% 01-Apr-2024	313.816	0,02
5.400.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	5.218.830	0,27
5.500.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	5.556.650	0,29
4.396.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	4.439.872	0,23
8.792.000	EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024	9.141.966	0,48
9.223.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	9.463.305	0,49
13.340.000	EQM Midstream Partners LP 4.750% 15-Jul-2023	13.887.674	0,72

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
13.716.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	15.004.138	0,78
11.350.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	13.806.197	0,72
1.989.000	Murphy Oil Corp 6.375% 01-Dec-2042	1.991.795	0,10
706.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	777.592	0,04
1.235.000	Occidental Petroleum Corp 2.700% 15-Feb-2023	1.252.204	0,07
3.152.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	3.220.962	0,17
2.300.000	Occidental Petroleum Corp 3.000% 15-Feb-2027	2.336.926	0,12
300.000	Occidental Petroleum Corp 3.200% 15-Aug-2026	309.471	0,02
950.000	Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026	974.752	0,05
2.257.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Jun-2025	2.314.125	0,12
950.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029	976.296	0,05
1.443.000	Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047	1.416.326	0,07
1.154.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	1.155.869	0,06
2.178.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	2.175.354	0,11
2.500.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	2.567.225	0,13
1.200.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049	1.216.818	0,06
1.901.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	1.960.910	0,10
1.732.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	1.799.574	0,09
2.985.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	3.326.424	0,17
2.019.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	2.486.318	0,13
3.650.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	4.661.032	0,24
568.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	737.872	0,04
3.715.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	4.124.189	0,21
2.400.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	3.160.896	0,16
1.970.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	2.632.669	0,14
3.800.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	5.021.339	0,26
1.025.000	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	1.031.304	0,05
5.960.000	Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028	5.995.589	0,31
3.645.000	Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029	3.703.697	0,19
6.270.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	6.464.715	0,34
3.800.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	3.967.257	0,21
7.700.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	8.221.444	0,43
8.529.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	9.652.056	0,50
4.100.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	4.639.560	0,24
279.818	Ruby Pipeline LLC '144A' 8.000% 01-Apr-2022	261.490	0,01
9.505.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	9.792.051	0,51
718.000	Southwestern Energy Co 6.450% 23-Jan-2025	789.929	0,04
4.662.326	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	5.566.633	0,29
6.698.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	3.626.331	0,19
4.880.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	2.888.496	0,15
2.559.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	1.514.966	0,08
5.090.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	5.339.410	0,28
11.361.000	Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025	11.886.560	0,62
4.303.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	4.692.594	0,24
8.610.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	9.380.121	0,49
3.841.000	Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028	4.249.817	0,22
18.393.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030	20.287.571	1,06
6.293.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	7.592.221	0,39
7.184.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	8.595.081	0,45
5.460.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048	6.537.995	0,34
15.664.000	Western Midstream Operating LP 6.500% 01-Feb-2050	18.546.411	0,97
<b>Finanzwerte - 130.630.248</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 105.500.701)</b>		<b>130.630.248</b>	<b>6,80</b>
2.973.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	3.108.992	0,16
9.714.000	Commerzbank AG '144A' 8.125% 19-Sep-2023	10.709.125	0,56

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
400.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 01-May-2024	410.000	0,02
785.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	770.446	0,04
8.950.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	12.682.060	0,66
6.100.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	6.541.589	0,34
2.300.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	3.192.917	0,17
700.000	Navient Corp 5.500% 25-Jan-2023	729.890	0,04
889.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	848.022	0,04
300.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	367.500	0,02
4.537.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	4.159.703	0,22
12.000.000	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	11.773.020	0,61
5.626.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	5.184.134	0,27
6.650.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Jun-2023	6.655.719	0,35
5.874.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	5.733.523	0,30
5.362.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	5.300.793	0,27
6.325.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	6.157.925	0,32
5.363.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	5.207.875	0,27
6.316.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	6.009.358	0,31
4.790.000	Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026	4.735.202	0,25
11.300.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	12.353.491	0,64
14.991.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	17.998.964	0,94
<b>Industrie - 159.825.622</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 82.932.064)</b>			
5.250.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	6.457.500	0,34
2.150.000	Fluor Corp 3.500% 15-Dec-2024	2.253.705	0,12
5.840.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	6.134.190	0,32
13.702.000	Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027	14.731.057	0,77
9.390.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	10.252.938	0,53
5.046.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	5.631.588	0,29
21.984.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	23.716.339	1,23
13.420.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	15.345.770	0,80
13.994.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	16.568.336	0,86
8.099.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	9.629.266	0,50
11.295.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	12.990.267	0,68
800.000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2040	940.056	0,05
18.800.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	19.103.244	0,99
2.860.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	3.639.836	0,19
320.000	Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026	327.538	0,02
1.508.000	Spirit AeroSystems Inc 3.950% 15-Jun-2023	1.521.512	0,08
8.054.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	8.086.337	0,42
1.000.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	1.049.110	0,05
1.177.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	1.447.033	0,08
<b>Technologie - 127.647.613</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 55.889.452)</b>			
700.000	CDK Global Inc 5.000% 15-Oct-2024	764.085	0,04
400.000	Pitney Bowes Inc 4.625% 15-Mar-2024	409.238	0,02
16.262.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	16.854.506	0,88
15.594.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	16.246.375	0,85
13.553.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jun-2023	14.180.097	0,74
16.314.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	17.473.191	0,91
17.212.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	18.269.678	0,95
17.960.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	19.594.360	1,02
12.735.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	14.695.171	0,76
630.000	Xerox Corp 3.800% 15-May-2024	653.124	0,03
3.000.000	Xerox Corp 4.375% 15-Mar-2023	3.102.750	0,16
2.135.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	2.158.965	0,11
2.907.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	3.246.073	0,17
<b>Versorger - 106.782.678</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 51.834.512)</b>			
3.402.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	3.299.906	0,17
3.795.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	3.776.974	0,20
4.821.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	4.653.157	0,24
7.835.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	7.756.650	0,40
5.742.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	5.641.515	0,29
11.684.000	FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027	12.599.614	0,66
10.630.000	FirstEnergy Corp 4.750% 15-Mar-2023	11.068.488	0,58

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Versorger Forts.</b>			
11.952.000	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	14.261.143	0,74
19.400.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	26.226.860	1,37
6.850.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.350% 15-Jan-2025	7.290.318	0,38
2.336.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049	2.682.389	0,14
4.400.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044	5.580.498	0,29
534.755	Lea Power Partners LLC '144A' 6.595% 15-Jun-2033	561.851	0,03
1.342.123	Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6.000% 15-Mar-2025	1.383.315	0,07
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>1.870.934.871</b>	<b>97,38</b>
<b>Offene Terminkontrakte - 409.474</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 499.680)</b>			
(102)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(13.307.813)	11.243
431	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	69.148.563	398.231
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>		<b>409.474</b>	<b>0,02</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 14.611.501 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 5.338.922)			
		14.611.501	0,76
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>1.885.955.846</b>	<b>98,16</b>
<b>Offene Terminkontrakte - (1.062.188)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (396.547))</b>			
(323)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(47.299.312)	(689.133)
338	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	73.742.093	(1.926)
(194)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(23.469.453)	(86.839)
(111)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(21.880.875)	(284.290)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>		<b>(1.062.188)</b>	<b>(0,05)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (2.130.766) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (49.500))			
		(2.130.766)	(0,11)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(3.192.954)</b>	<b>(0,16)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>38.545.280</b>	<b>2,00</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>1.921.308.172</b>	<b>100,00</b>
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.			
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
		97,18	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente			
		0,02	
Derivative OTC-Finanzinstrumente			
		0,76	
Sonstiges Umlaufvermögen			
		2,04	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

<b>Devisenterminkontrakte</b>							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	341.270	386.922	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.695
Euro	US-Dollar	83.943	95.221	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		368
Euro	US-Dollar	674.12.790	76.290.202	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		475.204
						<b>USD</b>	<b>477.267</b>
						<b>EUR</b>	<b>419.207</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	19.000	21.452	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		184
Euro	US-Dollar	1.869.523	2.115.715	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		13.179
						<b>USD</b>	<b>13.363</b>
						<b>EUR</b>	<b>11.737</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR N (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	9.980	11.294	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		70
						<b>USD</b>	<b>70</b>
						<b>EUR</b>	<b>61</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	91.318	103.343	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		644
						<b>USD</b>	<b>644</b>
						<b>EUR</b>	<b>566</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	10.183.767	11.524.840	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		71.787
						<b>USD</b>	<b>71.787</b>
						<b>EUR</b>	<b>63.054</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	6.400	8.638	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		25
Pfund Sterling	US-Dollar	17.400	23.338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		213
Pfund Sterling	US-Dollar	1.559.448	2.107.437	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3.303
Pfund Sterling	US-Dollar	19.600	25.887	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		641
Pfund Sterling	US-Dollar	3.800	5.042	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		102
Pfund Sterling	US-Dollar	417	552	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		13
Pfund Sterling	US-Dollar	8.800	11.631	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		280
Pfund Sterling	US-Dollar	17.400	23.015	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		536
Pfund Sterling	US-Dollar	1.999.218	2.845.818	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		60.159
Pfund Sterling	US-Dollar	365.412.045	482.735.296	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		11.856.335
						<b>USD</b>	<b>11.921.607</b>
						<b>GBP</b>	<b>8.807.659</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	23.337	17.400	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(215)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.637	6.400	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(26)

<b>Devisenterminkontrakte Forts.</b>							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
US-Dollar	Pfund Sterling	5.197	3.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(66)
US-Dollar	Pfund Sterling	89.835.487	67.945.780	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(2.130.321)
US-Dollar	Pfund Sterling	191	143	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.949	5.234	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(135)
						<b>USD</b>	<b>(2.130.766)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(1.574.206)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	342.120	461.234	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.831
Pfund Sterling	US-Dollar	67.945.780	89.840.877	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.124.932
						<b>USD</b>	<b>2.126.763</b>
						<b>GBP</b>	<b>1.571.248</b>



# BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Netto- vermögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Grundstoffe - 33.447.812</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 36.952.352)</b>			
470.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	464.224	0,06
290.000	Alcoa Nederland Holding BV '144A' 4.125% 31-Mar-2029	299.116	0,04
85.000	Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.125% 15-May-2028	91.599	0,01
70.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	76.986	0,01
255.000	Arconic Corp '144A' 6.000% 15-May-2025	267.112	0,04
362.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	385.849	0,05
355.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	459.677	0,06
230.000	Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031	228.605	0,03
575.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	600.013	0,08
695.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	673.438	0,09
295.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	307.107	0,04
296.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	320.458	0,04
527.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	564.417	0,08
400.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	397.506	0,05
495.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	518.141	0,07
150.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	153.154	0,02
150.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	156.337	0,02
336.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	361.672	0,05
110.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029	112.363	0,02
480.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	508.762	0,07
258.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 9.875% 17-Oct-2025	292.306	0,04
475.000	Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031	472.138	0,07
496.000	Commercial Metals Co 4.875% 15-May-2023	511.401	0,07
185.000	Compass Minerals International Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2024	189.965	0,03
145.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	153.736	0,02
300.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	293.672	0,04
160.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 6.750% 15-Aug-2024	144.042	0,02
395.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028	417.308	0,06
9.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 9.250% 15-Jun-2023	9.075	0,00
300.000	Diamond BC BV '144A' 4.625% 01-Oct-2029	298.046	0,04
700.000	Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028	720.510	0,10
500.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	503.217	0,07
300.000	EverArc Escrow Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029	300.674	0,04
750.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	788.798	0,11
215.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	229.190	0,03
462.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15-May-2024	490.200	0,07
410.000	Freeport-McMoRan Inc 3.875% 15-Mar-2023	424.813	0,06
175.000	Freeport-McMoRan Inc 4.125% 01-Mar-2028	181.814	0,03
133.000	Freeport-McMoRan Inc 4.250% 01-Mar-2030	140.506	0,02
155.000	Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-Aug-2028	162.779	0,02
550.000	Freeport-McMoRan Inc 4.550% 14-Nov-2024	589.971	0,08
240.000	Freeport-McMoRan Inc 4.625% 01-Aug-2030	257.798	0,04
335.000	Freeport-McMoRan Inc 5.000% 01-Sep-2027	348.867	0,05
225.000	Freeport-McMoRan Inc 5.250% 01-Sep-2029	246.754	0,03
206.000	Freeport-McMoRan Inc 5.400% 14-Nov-2034	251.095	0,03
720.000	Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043	906.509	0,13
170.000	GCP Applied Technologies Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2026	174.420	0,02
300.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	309.819	0,04
193.000	GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026	205.816	0,03
80.000	HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028	82.515	0,01
486.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	521.376	0,07
510.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	500.608	0,07
216.000	Hexion Inc '144A' 7.875% 15-Jul-2027	228.096	0,03
140.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500% 01-Apr-2026	140.161	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Netto- vermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Grundstoffe Forts.</b>			
200.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	212.295	0,03
640.000	Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028	683.414	0,09
300.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc '144A' 3.375% 15-Jan-2026	301.448	0,04
100.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2024	103.193	0,01
190.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	185.300	0,03
150.000	Ingevity Corp '144A' 4.500% 01-Feb-2026	150.540	0,02
83.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	90.322	0,01
130.000	JW Aluminum Continuous Cast Co '144A' 10.250% 01-Jun-2026	137.643	0,02
200.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031	197.053	0,03
300.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028	303.454	0,04
110.000	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025	114.000	0,02
190.000	LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029	187.417	0,03
484.000	Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029	495.161	0,07
117.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	122.681	0,02
470.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	493.970	0,07
270.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	285.525	0,04
275.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	276.529	0,04
330.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	356.398	0,05
200.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	207.595	0,03
100.000	Mountain Province Diamonds Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2022	92.743	0,01
300.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	302.977	0,04
200.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	199.061	0,03
1.050.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	1.105.629	0,15
200.000	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A' 5.750% 30-Apr-2026	204.747	0,03
158.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	166.125	0,02
245.000	Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027	251.676	0,03
215.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	233.230	0,03
140.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	139.425	0,02
200.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	207.350	0,03
140.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	137.696	0,02
394.000	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A' 7.250% 01-Apr-2025	403.212	0,06
591.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 5.500% 01-Jun-2024	593.216	0,08
100.000	Resolute Forest Products Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2026	101.784	0,01
105.000	Schweitzer-Mauduit International Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	109.991	0,02
390.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	375.010	0,05
219.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	205.073	0,03
211.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	208.717	0,03
104.000	Sylvamo Corp '144A' 7.000% 01-Sep-2029	108.801	0,02
100.000	Tacora Resources Inc '144A' 8.250% 15-May-2026	100.020	0,01
530.000	Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026	551.751	0,08
290.000	TPC Group Inc '144A' 10.500% 01-Aug-2024	210.573	0,03
170.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	173.657	0,02
86.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	87.666	0,01
500.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	500.280	0,07
130.000	Tronox Inc '144A' 6.500% 01-May-2025	137.527	0,02
300.000	Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 5.250% 30-Sep-2028	303.810	0,04
180.000	Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 7.500% 30-Sep-2029	182.056	0,03
250.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	281.500	0,04
305.000	United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029	328.747	0,05
250.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	242.444	0,03
570.000	Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030	582.366	0,08
77.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025	74.000	0,01

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Grundstoffe Forts.</b>			
300.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	308.514	0,04
875.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	897.969	0,12
<b>Kommunikation - 122.602.839</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 123.543.554)</b>		<b>122.602.839</b>	<b>16,87</b>
320.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	335.733	0,05
380.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	371.431	0,05
700.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	694.061	0,10
530.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	507.104	0,07
710.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	764.251	0,11
260.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jan-2029	253.874	0,03
1.160.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	1.133.540	0,16
430.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	426.898	0,06
866.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	854.487	0,12
395.000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 01-Feb-2027	421.366	0,06
310.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	308.624	0,04
145.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	148.260	0,02
160.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	156.642	0,02
105.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	105.096	0,01
300.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	302.295	0,04
665.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.500% 01-May-2027	658.483	0,09
95.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	92.945	0,01
615.000	Avaya Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2028	652.961	0,09
100.000	Beasley Mezzanine Holdings LLC '144A' 8.625% 01-Feb-2026	98.854	0,01
70.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	80.874	0,01
400.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	469.808	0,06
150.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	150.226	0,02
470.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081	472.458	0,07
235.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	230.656	0,03
160.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027	155.366	0,02
132.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028	130.312	0,02
387.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	412.710	0,06
1.496.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	1.541.501	0,21
1.745.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	1.764.631	0,24
1.060.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	1.044.776	0,14
1.435.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	1.471.212	0,20
920.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	940.070	0,13
1.858.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	1.935.618	0,27
1.450.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	1.510.900	0,21
1.895.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	1.954.171	0,27
875.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	945.744	0,13
265.000	Cengage Learning Inc '144A' 9.500% 15-Jun-2024	266.932	0,04
530.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	566.687	0,08
320.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	342.890	0,05
305.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	315.980	0,04
590.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026	599.472	0,08
290.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	288.711	0,04
325.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	335.187	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Kommunikation Forts.</b>			
355.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	349.290	0,05
421.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	432.817	0,06
255.000	CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027	238.680	0,03
443.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	443.494	0,06
1.331.000	Connect Finco SARRL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	1.401.011	0,19
130.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	136.825	0,02
176.000	CSC Holdings LLC 5.250% 01-Jun-2024	183.256	0,03
160.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	150.059	0,02
240.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	234.689	0,03
330.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	326.410	0,04
600.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	568.764	0,08
180.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	186.656	0,03
275.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	284.609	0,04
1.078.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	1.068.090	0,15
420.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	450.253	0,06
250.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	268.521	0,04
90.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	93.490	0,01
700.000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 5.375% 15-Aug-2026	350.805	0,05
1.440.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co- Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	1.475.741	0,20
680.000	DISH DBS Corp 5.000% 15-Mar-2023	697.775	0,10
1.310.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	1.194.222	0,16
1.075.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	1.104.713	0,15
795.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	806.213	0,11
1.040.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	1.098.552	0,15
1.630.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	1.658.158	0,23
1.360.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	1.376.150	0,19
400.000	DKT Finance ApS '144A' 9.375% 17-Jun-2023	406.156	0,06
628.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	704.390	0,10
320.000	Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	298.050	0,04
300.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	300.422	0,04
958.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	988.474	0,14
550.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	582.475	0,08
390.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	392.621	0,05
425.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	442.650	0,06
350.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	373.270	0,05
235.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	240.236	0,03
75.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	77.077	0,01
85.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	90.121	0,01
350.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	347.690	0,05
326.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	337.464	0,05
785.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	808.978	0,11
500.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	497.728	0,07
242.000	Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026	250.273	0,03
295.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	293.230	0,04
235.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	257.274	0,04
274.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	306.949	0,04
690.332	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	716.979	0,10
625.886	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	660.701	0,09
174.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	176.723	0,02
705.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	733.976	0,10
1.120.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	1.178.341	0,16
600.000	Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028	631.968	0,09
380.000	Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025	374.695	0,05
350.000	ION Trading Technologies Sarl '144A' 5.750% 15-May-2028	361.016	0,05
395.000	Koninklijke KPN NV '144A' FRN 7.000% 28-Mar-2073	416.606	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Kommunikation Forts.</b>				
615.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	599.794	0,08	
145.000	Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028	145.571	0,02	
160.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	162.550	0,02	
400.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	418.070	0,06	
404.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	406.626	0,06	
874.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	918.574	0,13	
200.000	Level 3 Financing Inc 5.250% 15-Mar-2026	204.713	0,03	
770.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	732.693	0,10	
570.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	542.423	0,07	
950.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	942.039	0,13	
625.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	638.447	0,09	
215.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	235.727	0,03	
84.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	91.678	0,01	
1.881.945	Ligado Networks LLC '144A' 15.500% 01-Nov-2023	1.527.518	0,21	
560.000	LogMeIn Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	567.302	0,08	
168.000	Lumen Technologies Inc 5.625% 01-Apr-2025	177.896	0,02	
205.000	Lumen Technologies Inc 6.750% 01-Dec-2023	221.630	0,03	
60.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	66.838	0,01	
391.000	Lumen Technologies Inc 7.500% 01-Apr-2024	428.614	0,06	
325.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	349.019	0,05	
264.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	284.460	0,04	
412.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	418.510	0,06	
400.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	387.626	0,05	
500.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	521.070	0,07	
500.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.375% 15-Jun-2029	500.775	0,07	
340.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	330.727	0,05	
150.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.125% 01-Aug-2030	151.715	0,02	
150.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028	156.344	0,02	
300.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	312.428	0,04	
215.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	230.347	0,03	
400.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028	396.606	0,05	
465.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	462.096	0,06	
500.000	Midas OpCo Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	512.667	0,07	
690.000	Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026	692.446	0,10	
394.000	Netflix Inc 4.375% 15-Nov-2026	436.601	0,06	
450.000	Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028	513.776	0,07	
365.000	Netflix Inc 5.875% 15-Feb-2025	410.621	0,06	
1.145.000	Netflix Inc 5.875% 15-Nov-2028	1.378.786	0,19	
460.000	Netflix Inc 6.375% 15-May-2029	572.272	0,08	
190.000	Netflix Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2025	200.422	0,03	
345.000	Netflix Inc '144A' 4.875% 15-Jun-2030	402.951	0,06	
346.000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029	411.467	0,06	
542.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	548.358	0,08	
475.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	484.773	0,07	
871.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	911.314	0,13	
75.000	Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027	81.091	0,01	
212.000	Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039	293.648	0,04	
100.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	109.141	0,02	
520.000	NortonLifeLock Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025	524.550	0,07	
75.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2029	75.250	0,01	
80.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030	79.921	0,01	
340.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	348.344	0,05	
100.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.250% 15-Jun-2025	104.102	0,01	
360.000	Photo Holdings Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-Oct-2026	374.855	0,05	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Kommunikation Forts.</b>				
400.000	Quebecor Media Inc 5.750% 15-Jan-2023	416.402	0,06	
250.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	252.805	0,03	
475.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	477.874	0,07	
465.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125% 22-Apr-2026	468.116	0,06	
400.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	423.000	0,06	
155.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	155.047	0,02	
775.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	814.961	0,11	
90.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030	85.411	0,01	
170.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030	165.139	0,02	
118.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	119.893	0,02	
300.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	300.482	0,04	
726.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	713.095	0,10	
770.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	775.636	0,11	
785.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	786.393	0,11	
528.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	549.426	0,08	
503.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	542.828	0,07	
1.212.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	1.535.216	0,21	
958.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	1.438.609	0,20	
1.240.000	Sprint Corp 7.125% 15-Jun-2024	1.393.661	0,19	
860.000	Sprint Corp 7.625% 15-Feb-2025	990.088	0,14	
689.000	Sprint Corp 7.625% 01-Mar-2026	828.085	0,11	
1.597.000	Sprint Corp 7.875% 15-Sep-2023	1.761.052	0,24	
80.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	82.000	0,01	
206.000	Switch Ltd '144A' 3.750% 15-Sep-2028	207.841	0,03	
200.000	Switch Ltd '144A' 4.125% 15-Jun-2029	204.787	0,03	
545.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	552.011	0,08	
592.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	606.392	0,08	
200.000	TEGNA Inc '144A' 4.750% 15-Mar-2026	208.211	0,03	
100.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	105.918	0,01	
214.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	230.759	0,03	
374.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	429.427	0,06	
318.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	374.218	0,05	
480.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	505.800	0,07	
400.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	414.000	0,06	
345.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	305.670	0,04	
385.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	361.954	0,05	
300.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	233.100	0,03	
490.000	Terrier Media Buyer Inc '144A' 8.875% 15-Dec-2027	530.327	0,07	
670.000	T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026	672.697	0,09	
775.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Apr-2026	779.886	0,11	
649.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Feb-2029	640.388	0,09	
340.000	T-Mobile USA Inc 2.875% 15-Feb-2031	336.372	0,05	
644.000	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2031	670.874	0,09	
810.000	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	853.926	0,12	
199.000	T-Mobile USA Inc 5.375% 15-Apr-2027	207.288	0,03	
450.000	T-Mobile USA Inc '144A' 2.250% 15-Feb-2026	451.811	0,06	
350.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3.375% 15-Apr-2029	357.234	0,05	
160.000	Townsquare Media Inc '144A' 6.875% 01-Feb-2026	169.966	0,02	
880	Trilogy International South Pacific LLC / TISP Finance Inc '144A' 8.875% 15-May-2023	860	0,00	
300.000	TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025	316.804	0,04	
200.000	Twitter Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2027	209.156	0,03	
725.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	739.656	0,10	
300.000	Uber Technologies Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	322.467	0,04	
487.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	512.399	0,07	
700.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027	762.650	0,10	
234.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	283.482	0,04	
301.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	304.546	0,04	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Kommunikation Forts.</b>				
660.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	711.820	0,10	
440.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	449.511	0,06	
289.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	300.239	0,04	
121.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	124.806	0,02	
815.000	VEON Holdings BV '144A' 3.375% 25-Nov-2027	796.915	0,11	
815.000	VEON Holdings BV '144A' 4.000% 09-Apr-2025	831.129	0,11	
325.000	VEON Holdings BV 'REGS' 4.950% 16-Jun-2024	341.513	0,05	
200.000	VEON Holdings BV 'REGS' 5.950% 13-Feb-2023	208.761	0,03	
400.000	VEON Holdings BV 'REGS' 7.250% 26-Apr-2023	421.820	0,06	
210.000	ViacomCBS Inc FRN 6.250% 28-Feb-2057	236.802	0,03	
340.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	342.116	0,05	
473.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	487.701	0,07	
300.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	301.175	0,04	
440.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	442.831	0,06	
300.000	Videotron Ltd '144A' 5.375% 15-Jun-2024	321.311	0,04	
700.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	697.592	0,10	
450.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030	453.568	0,06	
762.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	803.319	0,11	
275.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028	277.489	0,04	
585.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	574.248	0,08	
510.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	517.298	0,07	
390.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	382.996	0,05	
800.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	793.264	0,11	
520.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	532.535	0,07	
994.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	1.203.632	0,17	
555.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	589.399	0,08	
495.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	488.142	0,07	
464.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	457.750	0,06	
126.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030	126.818	0,02	
400.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	410.888	0,06	

**Zyklische Konsumgüter - 145.277.820**

**(31. Dezember 2020: 158.223.089)**

**145.277.820 19,99**

420.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	416.277	0,06	
960.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	973.910	0,13	
860.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	846.739	0,12	
215.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	219.669	0,03	
144.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025	149.571	0,02	
104.000	AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2024	103.348	0,01	
170.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	183.217	0,03	
330.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	352.504	0,05	
180.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	183.832	0,03	
250.000	Adient US LLC '144A' 9.000% 15-Apr-2025	265.905	0,04	
200.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	208.284	0,03	
600.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	612.789	0,08	
265.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	325.602	0,04	
325.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	339.534	0,05	
400.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	390.710	0,05	
215.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	224.137	0,03	
250.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	272.220	0,04	
600.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.500% 15-Apr-2025	639.624	0,09	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
200.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.500% 24-Apr-2026	212.708	0,03	
275.331	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	266.399	0,04	
363.599	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023	371.764	0,05	
240.766	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	244.805	0,03	
287.458	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	285.511	0,04	
358.076	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	353.071	0,05	
275.220	American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028	266.753	0,04	
192.916	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	184.072	0,03	
400.000	American Airlines 2021-1 Class B Pass Through Trust 3.950% 11-Jul-2030	396.000	0,05	
245.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	229.343	0,03	
215.000	American Airlines Group Inc '144A' 5.000% 01-Jun-2022	215.716	0,03	
675.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	833.689	0,11	
1.530.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	1.593.388	0,22	
1.150.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	1.230.069	0,17	
250.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	256.166	0,04	
152.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	156.342	0,02	
235.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025	239.996	0,03	
711.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	736.244	0,10	
682.000	Aramark Services Inc '144A' 6.375% 01-May-2025	713.560	0,10	
100.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	96.769	0,01	
225.000	Arrow Bidco LLC '144A' 9.500% 15-Mar-2024	230.586	0,03	
205.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	209.394	0,03	
140.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	142.487	0,02	
540.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	551.027	0,08	
200.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032	207.841	0,03	
120.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	118.082	0,02	
25.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	26.463	0,00	
840.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	924.941	0,13	
225.000	At Home Group Inc '144A' 7.125% 15-Jul-2029	221.379	0,03	
96.000	Avient Corp 5.250% 15-Mar-2023	100.659	0,01	
385.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	401.794	0,06	
535.000	Banijay Entertainment SASU '144A' 5.375% 01-Mar-2025	546.302	0,08	
200.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	221.282	0,03	
120.000	Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027	138.120	0,02	
295.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	364.756	0,05	
340.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	422.984	0,06	
125.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	146.433	0,02	
210.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	239.438	0,03	
129.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	156.916	0,02	
562.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	637.406	0,09	
130.000	Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025	158.730	0,02	
400.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	408.828	0,06	
190.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	187.815	0,03	
170.000	Beazer Homes USA Inc 6.750% 15-Mar-2025	175.063	0,02	
15.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	16.743	0,00	
130.000	Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029	132.219	0,02	
420.000	BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	418.490	0,06	
440.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	449.585	0,06	
427.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	436.285	0,06	
353.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	361.583	0,05	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
284.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	296.723	0,04
515.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	516.079	0,07
1.494.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	1.570.045	0,22
840.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	930.569	0,13
420.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025	439.148	0,06
600.000	Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028	596.721	0,08
940.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	941.410	0,13
475.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	473.563	0,07
725.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	760.927	0,10
540.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	617.625	0,09
575.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Feb-2026	657.058	0,09
130.000	Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029	117.183	0,02
530.000	Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	505.593	0,07
410.000	Carvana Co '144A' 5.500% 15-Apr-2027	406.330	0,06
560.000	Carvana Co '144A' 5.625% 01-Oct-2025	560.700	0,08
150.000	Carvana Co '144A' 5.875% 01-Oct-2028	149.648	0,02
285.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	297.598	0,04
330.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	346.861	0,05
300.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	294.312	0,04
205.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	210.434	0,03
360.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	369.365	0,05
100.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 6.500% 01-Oct-2028	106.648	0,01
290.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	300.517	0,04
95.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	100.320	0,01
200.000	Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029	201.787	0,03
425.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	440.604	0,06
235.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	242.285	0,03
90.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	87.904	0,01
215.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	217.956	0,03
70.000	Cinemark USA Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	74.276	0,01
381.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026	399.103	0,06
890.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	944.544	0,13
304.000	Clarios Global LP '144A' 6.750% 15-May-2025	318.749	0,04
315.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	301.186	0,04
100.000	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 13.000% 01-Jun-2024	108.104	0,01
595.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	594.414	0,08
165.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	173.300	0,02
115.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	122.346	0,02
204.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	217.722	0,03
180.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	187.620	0,03
300.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	306.135	0,04
215.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	220.768	0,03
187.000	Delta Air Lines Inc 3.800% 19-Apr-2023	191.262	0,03
190.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	202.743	0,03
340.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	400.595	0,06
300.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	296.625	0,04
465.000	eG Global Finance Plc '144A' 6.750% 07-Feb-2025	471.296	0,06
300.000	eG Global Finance Plc '144A' 8.500% 30-Oct-2025	311.187	0,04
200.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	207.232	0,03
190.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	184.029	0,03
310.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	300.592	0,04
75.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	75.040	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
200.000	Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029	200.630	0,03
460.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	640.796	0,09
1.000.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	1.026.000	0,14
888.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	969.754	0,13
415.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	458.793	0,06
749.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	881.434	0,12
140.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	164.788	0,02
270.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	325.048	0,04
295.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	406.819	0,06
500.000	Ford Motor Co 9.000% 22-Apr-2025	611.933	0,08
514.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.700% 10-Aug-2026	519.140	0,07
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028	100.394	0,01
750.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.087% 09-Jan-2023	763.665	0,11
305.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 04-May-2023	311.120	0,04
405.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.350% 01-Nov-2022	410.595	0,06
750.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.370% 17-Nov-2023	774.375	0,11
880.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-Nov-2025	915.407	0,13
350.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.625% 17-Jun-2031	367.937	0,05
430.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	447.116	0,06
402.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	417.469	0,06
255.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	269.980	0,04
585.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	630.355	0,09
735.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024	774.311	0,11
475.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	513.294	0,07
493.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	523.753	0,07
560.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.140% 15-Feb-2023	574.028	0,08
284.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	305.621	0,04
445.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-Aug-2023	463.572	0,06
230.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	250.080	0,03
340.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	365.859	0,05
560.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	637.260	0,09
845.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16-Jun-2025	920.036	0,13
735.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024	792.885	0,11
439.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	473.519	0,07
140.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	144.176	0,02
300.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	295.172	0,04
140.000	Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028	147.199	0,02
115.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	113.925	0,02
115.000	Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031	113.607	0,02
600.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	594.804	0,08
300.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	319.500	0,04
156.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	163.703	0,02
675.000	Golden Nugget Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2024	675.877	0,09
100.000	Golden Nugget Inc '144A' 8.750% 01-Oct-2025	104.101	0,01
105.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	111.288	0,02
185.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026	190.100	0,03
70.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033	76.490	0,01
300.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	324.657	0,04
500.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.000% 15-Jul-2029	538.050	0,07
500.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.250% 15-Jul-2031	543.600	0,07
609.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	607.730	0,08
150.000	GYP Holdings III Corp '144A' 4.625% 01-May-2029	150.604	0,02
295.000	H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028	293.311	0,04
486.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.625% 15-May-2024	509.459	0,07
485.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	518.948	0,07
239.247	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	237.138	0,03
245.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	256.661	0,04

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettvermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
572.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	612.206	0,08	
490.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	488.238	0,07	
255.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	257.278	0,04	
755.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	774.056	0,11	
580.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025	604.148	0,08	
568.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	607.646	0,08	
162.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	166.302	0,02	
255.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	262.905	0,04	
240.000	IAA Inc '144A' 5.500% 15-Jun-2027	248.940	0,03	
155.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4.750% 15-Sep-2026	158.434	0,02	
505.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.000% 15-May-2027	521.842	0,07	
275.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	296.128	0,04	
150.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	156.221	0,02	
125.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	128.914	0,02	
100.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	106.115	0,01	
300.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	336.300	0,05	
260.000	International Game Technology Plc '144A' 6.500% 15-Feb-2025	282.426	0,04	
300.000	IRB Holding Corp '144A' 6.750% 15-Feb-2026	305.942	0,04	
202.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	213.915	0,03	
255.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4.500% 01-Oct-2027	247.625	0,03	
165.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	165.409	0,02	
190.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	193.595	0,03	
300.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	324.750	0,04	
249.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 7.125% 15-Apr-2026	260.901	0,04	
100.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 7.750% 15-Feb-2026	104.807	0,01	
340.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	345.511	0,05	
200.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	207.787	0,03	
156.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	170.498	0,02	
335.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	393.122	0,05	
148.000	KB Home 7.500% 15-Sep-2022	154.438	0,02	
39.000	KB Home 7.625% 15-May-2023	41.042	0,01	
160.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	160.443	0,02	
510.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	510.852	0,07	
360.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	356.458	0,05	
205.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	211.001	0,03	
200.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	204.213	0,03	
510.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	508.840	0,07	
200.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	207.235	0,03	
500.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	509.637	0,07	
835.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	860.050	0,12	
309.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	307.455	0,04	
350.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	360.150	0,05	
165.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	166.825	0,02	
465.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	481.240	0,07	
645.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	706.246	0,10	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettvermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
450.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	455.551	0,06	
155.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	161.800	0,02	
149.000	Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-Feb-2023	150.684	0,02	
32.000	Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-Jun-2024	32.754	0,00	
270.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	237.319	0,03	
290.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	286.814	0,04	
115.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	109.991	0,02	
521.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	552.742	0,08	
300.000	MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6.375% 01-Jun-2029	290.671	0,04	
92.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2025	96.002	0,01	
271.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	276.400	0,04	
240.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	252.760	0,03	
135.000	Mattel Inc 6.200% 01-Oct-2040	175.055	0,02	
210.000	Mattel Inc '144A' 3.375% 01-Apr-2026	215.581	0,03	
290.000	Mattel Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2029	300.929	0,04	
295.000	Mattel Inc '144A' 5.875% 15-Dec-2027	317.520	0,04	
930.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 04-Dec-2029	903.542	0,12	
385.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.750% 21-Jul-2028	387.672	0,05	
550.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	542.437	0,07	
115.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	113.701	0,02	
165.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.625% 17-Jul-2027	163.050	0,02	
17.000	Meritage Homes Corp 5.125% 06-Jun-2027	18.748	0,00	
116.000	Meritage Homes Corp 6.000% 01-Jun-2025	129.636	0,02	
180.000	Meritage Homes Corp '144A' 3.875% 15-Apr-2029	189.258	0,03	
110.000	Meritor Inc '144A' 4.500% 15-Dec-2028	110.442	0,02	
100.000	Meritor Inc '144A' 6.250% 01-Jun-2025	104.352	0,01	
170.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	176.986	0,02	
120.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.250% 18-Jun-2025	119.227	0,02	
465.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15-May-2024	463.958	0,06	
345.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	346.216	0,05	
155.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	161.364	0,02	
300.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	309.443	0,04	
270.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	287.842	0,04	
640.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	689.440	0,09	
480.000	MGM Resorts International 6.000% 15-Mar-2023	502.207	0,07	
397.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	415.262	0,06	
290.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	290.117	0,04	
675.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	666.026	0,09	
410.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	412.673	0,06	
640.000	Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026	672.765	0,09	
165.000	Motion Bondco DAC '144A' 6.625% 15-Nov-2027	167.668	0,02	
280.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	295.102	0,04	
245.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	243.820	0,03	
145.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	137.003	0,02	
590.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	588.156	0,08	
214.000	NCL Corp Ltd '144A' 10.250% 01-Feb-2026	248.992	0,03	
98.000	NCL Corp Ltd '144A' 12.250% 15-May-2024	116.229	0,02	
160.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	157.868	0,02	
248.000	Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024	260.367	0,04	
1.116.000	Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026	1.218.421	0,17	
195.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	212.791	0,03	
315.000	Newell Brands Inc 5.875% 01-Apr-2036	388.672	0,05	
300.000	Newell Brands Inc 6.000% 01-Apr-2046	385.350	0,05	
525.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	558.044	0,08	
440.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	442.640	0,06	
435.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	428.047	0,06	
675.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	681.952	0,09	
1.010.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	943.401	0,13	
305.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	343.952	0,05	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
183.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	182.355	0,03	
180.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	172.153	0,02	
135.000	Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029	132.448	0,02	
285.000	Party City Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	294.559	0,04	
375.000	Peninsula Pacific Entertainment LLC / Peninsula Pacific Entertainment Finance In '144A' 8.500% 15-Nov-2027	405.546	0,06	
304.000	Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029	301.776	0,04	
695.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	714.505	0,10	
570.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	620.169	0,09	
218.000	Picasso Finance Sub Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025	228.031	0,03	
214.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	217.121	0,03	
115.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	114.263	0,02	
350.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031	351.750	0,05	
415.000	QVC Inc 4.375% 15-Mar-2023	427.938	0,06	
550.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	546.807	0,08	
375.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	396.021	0,05	
365.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	375.454	0,05	
375.000	QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024	400.684	0,06	
545.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	540.316	0,07	
125.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	124.707	0,02	
520.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	525.850	0,07	
300.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	299.954	0,04	
140.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	137.550	0,02	
700.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	696.331	0,10	
600.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGGS' 4.625% 16-Apr-2029	605.316	0,08	
300.000	Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027	274.437	0,04	
98.000	Rite Aid Corp '144A' 7.500% 01-Jul-2025	100.846	0,01	
200.000	Rite Aid Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2026	204.233	0,03	
320.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 5.250% 15-Nov-2022	324.814	0,04	
635.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	615.753	0,08	
375.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.000% 31-Aug-2026	381.720	0,05	
875.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.000% 01-Apr-2028	886.620	0,12	
419.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jun-2023	443.618	0,06	
375.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023	410.162	0,06	
488.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	547.177	0,08	
110.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025	112.544	0,02	
150.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc '144A' 8.750% 30-Apr-2025	159.900	0,02	
472.000	Scientific Games International Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2025	486.549	0,07	
325.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	346.665	0,05	
95.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	106.082	0,01	
815.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.250% 15-Mar-2026	858.827	0,12	
575.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.625% 01-Jul-2025	614.502	0,08	
198.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	206.699	0,03	
184.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 5.250% 15-Dec-2026	189.680	0,03	
300.000	Scotts Miracle-Gro Co/The '144A' 4.000% 01-Apr-2031	296.693	0,04	
200.000	Scotts Miracle-Gro Co/The '144A' 4.375% 01-Feb-2032	199.803	0,03	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
190.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	193.754	0,03	
200.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	212.200	0,03	
265.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	271.368	0,04	
125.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 4.750% 01-Apr-2029	127.566	0,02	
540.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31-Jul-2024	546.016	0,08	
40.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 5.500% 15-Apr-2027	41.440	0,01	
190.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	203.122	0,03	
255.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	267.517	0,04	
200.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	220.611	0,03	
250.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	251.320	0,03	
330.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	332.166	0,05	
215.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	217.455	0,03	
933.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	959.870	0,13	
375.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	353.828	0,05	
255.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	256.943	0,04	
415.000	Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029	372.074	0,05	
120.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025	116.825	0,02	
28.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	29.005	0,00	
400.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	405.178	0,06	
255.000	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp '144A' 5.875% 15-May-2025	253.990	0,04	
275.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	283.063	0,04	
290.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	279.157	0,04	
40.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.625% 01-Mar-2024	42.640	0,01	
257.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2023	269.475	0,04	
175.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	192.748	0,03	
200.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	223.776	0,03	
200.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	224.200	0,03	
475.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2027	501.427	0,07	
226.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	230.279	0,03	
150.000	Tenneco Inc '144A' 7.875% 15-Jan-2029	162.211	0,02	
225.000	Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029	223.031	0,03	
525.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	537.374	0,07	
370.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	400.125	0,06	
30.000	Toll Brothers Finance Corp 3.800% 01-Nov-2029	32.293	0,00	
130.000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15-Mar-2027	145.568	0,02	
343.000	Travel + Leisure Co 3.900% 01-Mar-2023	348.672	0,05	
305.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	324.367	0,04	
110.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	119.957	0,02	
127.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	141.415	0,02	
165.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030	166.319	0,02	
330.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	366.313	0,05	
87.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	93.503	0,01	
189.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	208.161	0,03	
41.741	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02-Jul-2022	42.680	0,01	
123.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	126.998	0,02	
215.000	United Airlines Holdings Inc 4.250% 01-Oct-2022	218.492	0,03	
625.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	652.531	0,09	
490.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	506.332	0,07	
100.000	Univar Solutions USA Inc/Washington '144A' 5.125% 01-Dec-2027	104.488	0,01	
274.800	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	274.013	0,04	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
365.391	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	369.457	0,05	
160.000	Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	166.560	0,02	
300.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	307.209	0,04	
190.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	181.108	0,02	
295.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025	292.357	0,04	
160.000	Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029	160.687	0,02	
220.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029	220.034	0,03	
200.000	Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	201.553	0,03	
90.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	89.231	0,01	
120.000	Wheel Pros Inc '144A' 6.500% 15-May-2029	115.369	0,02	
240.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	250.541	0,03	
140.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	143.844	0,02	
322.000	William Carter Co/The '144A' 5.500% 15-May-2025	334.397	0,05	
93.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	96.232	0,01	
350.000	Winnebago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	375.286	0,05	
670.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	669.414	0,09	
149.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 8.500% 15-Nov-2024	138.352	0,02	
323.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 9.000% 15-Nov-2026	307.210	0,04	
200.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029	194.757	0,03	
435.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	448.757	0,06	
230.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 4.250% 30-May-2023	231.971	0,03	
400.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	409.378	0,06	
895.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	923.058	0,13	
310.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024	291.736	0,04	
275.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	250.250	0,03	
380.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	357.624	0,05	
360.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027	335.160	0,05	
400.000	Wynn Macau Ltd '144A' 6.625% 26-Aug-2028	371.000	0,05	
200.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	203.299	0,03	
280.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.750% 15-Apr-2025	293.934	0,04	
390.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	389.138	0,05	
145.000	Yum! Brands Inc 3.875% 01-Nov-2023	151.532	0,02	
216.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	229.918	0,03	
261.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	289.390	0,04	
405.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	514.437	0,07	
610.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	661.200	0,09	
230.000	Yum! Brands Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2025	242.635	0,03	
815.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	875.008	0,12	
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter - 121.724.948</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 118.205.967)</b>		<b>121.724.948</b>	<b>16,75</b>	
165.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	167.299	0,02	
270.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	277.835	0,04	
350.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	368.389	0,05	
60.000	ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	59.641	0,01	
65.000	AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030	66.236	0,01	
505.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	536.045	0,07	
175.000	ADT Security Corp/The 4.125% 15-Jun-2023	181.947	0,02	
390.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	384.854	0,05	
200.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	204.500	0,03	
400.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	391.564	0,05	
384.000	Ahern Rentals Inc '144A' 7.375% 15-May-2023	367.200	0,05	
155.000	AHP Health Partners Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	153.869	0,02	
200.000	Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025	171.458	0,02	
160.000	Akumin Escrow Inc '144A' 7.500% 01-Aug-2028	150.270	0,02	
200.000	Akumin Inc '144A' 7.000% 01-Nov-2025	190.548	0,03	
300.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	305.942	0,04	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>				
560.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	562.066	0,08	
730.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	766.916	0,11	
369.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	398.985	0,05	
325.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	344.949	0,05	
300.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	303.309	0,04	
212.000	Albion Financing 2SARL '144A' 8.750% 15-Apr-2027	215.710	0,03	
365.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	355.515	0,05	
743.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	779.838	0,11	
446.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	477.037	0,07	
480.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	480.540	0,07	
154.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	151.382	0,02	
320.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	324.859	0,04	
210.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	217.875	0,03	
350.000	API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029	352.266	0,05	
250.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	223.125	0,03	
400.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	394.564	0,05	
215.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	225.985	0,03	
605.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	627.340	0,09	
400.000	Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029	404.938	0,06	
775.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	809.228	0,11	
348.000	Avon Products Inc 6.500% 15-Mar-2023	365.313	0,05	
89.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	109.595	0,01	
386.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	399.454	0,05	
755.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	793.841	0,11	
1.020.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	1.078.635	0,15	
445.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	455.818	0,06	
510.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 30-Jan-2028	470.003	0,06	
565.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2029	499.497	0,07	
605.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	533.338	0,07	
600.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	528.180	0,07	
710.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025	722.436	0,10	
80.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	83.120	0,01	
1.042.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 15-Apr-2025	1.064.142	0,15	
700.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	666.316	0,09	
260.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.000% 15-Jan-2028	259.068	0,04	
480.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029	475.874	0,07	
806.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9.000% 15-Dec-2025	849.911	0,12	
411.000	Block Inc '144A' 2.750% 01-Jun-2026	412.030	0,06	
440.000	Block Inc '144A' 3.500% 01-Jun-2031	451.761	0,06	
70.000	Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027	72.179	0,01	
235.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	244.635	0,03	
220.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	220.315	0,03	
145.000	Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029	144.495	0,02	
245.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029	242.020	0,03	
300.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	297.694	0,04	
975.000	Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028	961.876	0,13	
1.300.000	Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031	1.267.734	0,17	
426.000	Centene Corp 2.625% 01-Aug-2031	418.189	0,06	
1.210.000	Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030	1.232.070	0,17	
597.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	610.059	0,08	
2.085.000	Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	2.252.196	0,31	
140.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	141.432	0,02	
109.000	Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028	114.208	0,02	
165.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	166.068	0,02	
845.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	854.663	0,12	



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
200.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031	205.209	0,03
540.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	562.375	0,08
220.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	223.062	0,03
390.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	401.593	0,06
200.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031	202.074	0,03
455.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	482.095	0,07
145.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029	154.835	0,02
600.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	594.501	0,08
300.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.625% 15-Feb-2025	310.840	0,04
165.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 01-Apr-2028	160.283	0,02
700.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	714.196	0,10
465.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	489.338	0,07
90.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027	97.325	0,01
450.000	Cimpress Plc '144A' 7.000% 15-Jun-2026	467.906	0,06
138.000	Cooke Omega Investments Inc / Alpha VesselCo Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Dec-2022	140.566	0,02
254.000	CoreCivic Inc 4.625% 01-May-2023	258.846	0,04
483.000	CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027	437.757	0,06
545.000	CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026	570.302	0,08
450.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	448.972	0,06
765.000	Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026	789.044	0,11
549.000	Coty Inc '144A' 6.500% 15-Apr-2026	566.859	0,08
75.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	76.333	0,01
265.000	CPI CG Inc '144A' 8.625% 15-Mar-2026	280.578	0,04
114.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	117.819	0,02
935.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	910.980	0,13
1.620.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	1.661.407	0,23
215.000	Del Monte Foods Inc '144A' 11.875% 15-May-2025	239.821	0,03
80.000	Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029	83.714	0,01
200.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029	201.795	0,03
215.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	228.427	0,03
394.000	Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028	457.584	0,06
365.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	376.021	0,05
491.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	500.336	0,07
330.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	340.387	0,05
995.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 6.000% 30-Jun-2028	742.797	0,10
390.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 9.500% 31-Jul-2027	397.394	0,05
310.000	Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	304.412	0,04
620.000	Envision Healthcare Corp '144A' 8.750% 15-Oct-2026	357.191	0,05
162.000	FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc '144A' 5.625% 15-Aug-2026	166.214	0,02
630.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	627.568	0,09
300.000	Garda World Security Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	286.922	0,04
240.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	259.104	0,04
120.000	Gartner Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2029	121.521	0,02
270.000	Gartner Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2030	276.435	0,04
250.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	253.153	0,03
535.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	556.266	0,08
200.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	204.374	0,03
222.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	229.431	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
1.330.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	1.408.304	0,19
1.425.000	HCA Inc 5.375% 01-Feb-2025	1.567.927	0,22
450.000	HCA Inc 5.375% 01-Sep-2026	506.273	0,07
495.000	HCA Inc 5.625% 01-Sep-2028	579.234	0,08
660.000	HCA Inc 5.875% 01-May-2023	699.610	0,10
840.000	HCA Inc 5.875% 15-Feb-2026	949.227	0,13
385.000	HCA Inc 5.875% 01-Feb-2029	459.367	0,06
45.000	HCA Inc 7.050% 01-Dec-2027	55.464	0,01
100.000	HCA Inc 7.500% 06-Nov-2033	144.208	0,02
420.000	HCA Inc 7.690% 15-Jun-2025	496.687	0,07
400.000	HCA Inc 8.360% 15-Apr-2024	458.334	0,06
65.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	64.431	0,01
405.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	430.740	0,06
650.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	676.783	0,09
310.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	312.351	0,04
250.000	H-Food Holdings LLC / Hearshside Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	250.260	0,03
215.000	Hill-Rom Holdings Inc '144A' 4.375% 15-Sep-2027	224.809	0,03
290.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	284.969	0,04
340.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	340.525	0,05
495.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	521.285	0,07
500.000	Horizon Therapeutics USA Inc '144A' 5.500% 01-Aug-2027	525.875	0,07
310.000	IHS Markit Ltd 4.750% 01-Aug-2028	360.420	0,05
200.000	Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031	201.787	0,03
450.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	466.358	0,06
815.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	845.294	0,12
51.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	54.812	0,01
175.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	180.501	0,02
1.073.000	Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026	1.123.919	0,15
300.000	Kraft Heinz Foods Co 3.750% 01-Apr-2030	324.435	0,04
550.000	Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-May-2027	595.094	0,08
890.000	Kraft Heinz Foods Co 4.250% 01-Mar-2031	1.014.095	0,14
1.459.000	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	1.714.624	0,24
100.000	Kraft Heinz Foods Co 4.625% 01-Oct-2039	117.601	0,02
633.000	Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049	797.872	0,11
300.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 15-Jul-2035	367.788	0,05
800.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042	996.970	0,14
894.000	Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045	1.140.845	0,16
380.000	Kraft Heinz Foods Co 5.500% 01-Jun-2050	517.297	0,07
90.000	Kraft Heinz Foods Co 6.375% 15-Jul-2028	111.875	0,02
250.000	Kraft Heinz Foods Co 6.500% 09-Feb-2040	356.141	0,05
495.000	Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-Jan-2039	728.647	0,10
300.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039	457.250	0,06
200.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	197.783	0,03
295.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027	278.536	0,04
500.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030	513.960	0,07
100.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032	103.294	0,01
250.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	270.981	0,04
160.000	Lannett Co Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2026	123.953	0,02
140.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027	141.200	0,02
250.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2025	260.879	0,04
70.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	70.443	0,01
245.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	244.128	0,03
90.000	Magellan Health Inc 4.900% 22-Sep-2024	97.519	0,01
432.000	MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	452.503	0,06
180.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	177.047	0,02
182.000	ModivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	186.146	0,03
300.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	311.681	0,04
300.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032	302.363	0,04

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
389.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	401.333	0,05
2.270.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029	2.266.527	0,31
850.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 5.250% 01-Oct-2029	863.362	0,12
600.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	609.159	0,08
540.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	514.358	0,07
45.000	Nathan's Famous Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	46.089	0,01
345.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	356.825	0,05
85.000	Nielsen Co Luxembourg SARL/The '144A' 5.000% 01-Feb-2025	86.445	0,01
280.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 4.500% 15-Jul-2029	275.871	0,04
300.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 4.750% 15-Jul-2031	296.705	0,04
435.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.625% 01-Oct-2028	449.875	0,06
270.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.875% 01-Oct-2030	285.471	0,04
345.000	North Queensland Export Terminal Pty Ltd '144A' 4.450% 15-Dec-2022	331.946	0,05
1.130.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	1.150.317	0,16
985.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	1.030.778	0,14
120.000	Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026	111.236	0,02
243.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.250% 01-Feb-2028	261.582	0,04
268.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	268.614	0,04
335.000	Par Pharmaceutical Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2027	342.849	0,05
540.000	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2029	501.638	0,07
500.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	496.840	0,07
400.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	417.906	0,06
100.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	104.741	0,01
150.000	Perrigo Co Plc 4.000% 15-Nov-2023	154.536	0,02
1.110.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	1.164.063	0,16
900.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030	913.556	0,13
1.050.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	1.124.414	0,15
1.000.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	998.261	0,14
170.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 3.500% 01-Mar-2032	171.982	0,02
840.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 4.250% 15-Apr-2031	883.298	0,12
449.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 5.875% 30-Sep-2027	474.589	0,07
840.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	835.061	0,11
975.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	994.802	0,14
700.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	736.337	0,10
371.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	393.650	0,05
440.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	454.830	0,06
300.000	PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026	300.692	0,04
560.000	Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031	544.048	0,07
200.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	208.536	0,03
300.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	318.353	0,04
425.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	410.450	0,06
460.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2024	489.983	0,07
937.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	1.007.116	0,14
500.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	522.138	0,07
300.000	PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	309.114	0,04
330.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	347.007	0,05
170.000	Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029	177.466	0,02
300.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2025	303.360	0,04
330.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	333.323	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.</b>			
75.000	RR Donnelley & Sons Co '144A' 6.125% 01-Nov-2026	82.500	0,01
445.000	Sabre GLBL Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	465.630	0,06
340.000	Sabre GLBL Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2025	384.591	0,05
255.000	Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031	301.064	0,04
666.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	706.050	0,10
225.000	Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030	221.426	0,03
205.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	207.857	0,03
315.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	329.233	0,05
200.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	214.783	0,03
102.000	Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027	122.788	0,02
170.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	176.333	0,02
305.000	Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026	294.261	0,04
150.000	Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	133.362	0,02
480.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	473.602	0,06
450.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	479.711	0,07
100.000	Sotheby's/Bidfair Holdings Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	102.142	0,01
116.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	121.826	0,02
130.000	StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	134.483	0,02
410.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	436.035	0,06
65.000	Syneos Health Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	64.281	0,01
256.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	241.226	0,03
355.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	369.709	0,05
250.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	257.906	0,04
400.000	Tenet Healthcare Corp 4.625% 15-Jul-2024	405.502	0,06
833.000	Tenet Healthcare Corp 6.750% 15-Jun-2023	891.277	0,12
105.000	Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	120.116	0,02
625.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.250% 01-Jun-2029	635.794	0,09
297.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15-Jan-2030	301.296	0,04
150.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 01-Sep-2024	153.536	0,02
165.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	169.776	0,02
1.200.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 01-Jan-2026	1.234.398	0,17
388.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 01-Nov-2027	404.603	0,06
1.345.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028	1.423.353	0,20
145.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	139.420	0,02
140.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	139.676	0,02
284.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	272.785	0,04
465.000	Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026	466.641	0,06
266.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	268.244	0,04
615.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	625.283	0,09
355.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	365.272	0,05
680.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	715.768	0,10
270.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	292.657	0,04
389.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	405.023	0,06
210.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	220.193	0,03
725.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	737.963	0,10
105.000	Varex Imaging Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2027	116.796	0,02
670.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	652.965	0,09
160.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	165.966	0,02
230.000	Vizient Inc '144A' 6.250% 15-May-2027	240.293	0,03
235.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	247.266	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Diversifizierte Unternehmen - 202.206</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.314.490)</b>		<b>202.206</b>	<b>0,03</b>
195.000	Stena International SA '144A' 5.750% 01-Mar-2024	202.206	0,03
<b>Energie - 89.893.903</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 91.349.765)</b>		<b>89.893.903</b>	<b>12,37</b>
300.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	322.608	0,04
235.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	238.766	0,03
240.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	251.204	0,03
350.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	363.037	0,05
350.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	367.531	0,05
335.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	369.520	0,05
57.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	63.360	0,01
220.000	Antero Resources Corp '144A' 8.375% 15-Jul-2026	250.765	0,03
410.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	445.520	0,06
255.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	278.169	0,04
540.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	611.053	0,08
120.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	138.777	0,02
135.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	154.439	0,02
115.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	140.920	0,02
234.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	244.329	0,03
211.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	221.761	0,03
325.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	329.864	0,05
335.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028	337.993	0,05
102.000	Baytex Energy Corp '144A' 5.625% 01-Jun-2024	102.129	0,01
705.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	739.193	0,10
100.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026	99.104	0,01
145.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	149.785	0,02
120.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	127.325	0,02
520.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	541.653	0,07
262.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	267.309	0,04
345.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	356.582	0,05
230.000	Buckeye Partners LP 4.150% 01-Jul-2023	235.993	0,03
275.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	286.978	0,04
135.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	131.828	0,02
196.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	192.600	0,03
50.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	58.132	0,01
495.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	511.709	0,07
555.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	560.003	0,08
295.000	Buckeye Partners LP FRN 6.375% 22-Jan-2078	261.317	0,04
300.000	California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026	312.031	0,04
410.000	Callon Petroleum Co 6.125% 01-Oct-2024	404.276	0,06
530.000	Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026	504.051	0,07
70.000	Callon Petroleum Co 8.250% 15-Jul-2025	68.953	0,01
500.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	505.710	0,07
141.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp 7.750% 15-Apr-2023	140.618	0,02
125.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 9.250% 15-Jul-2024	135.804	0,02
300.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 15-Apr-2025	323.937	0,04
450.000	Centennial Resource Production LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	459.450	0,06
750.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	794.344	0,11
1.070.000	Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029	1.136.051	0,16
480.000	Cheniere Energy Partners LP '144A' 3.250% 31-Jan-2032	485.760	0,07
564.063	Chesapeake Energy Corp 0.000% 15-Apr-2022	11.281	0,00
150.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	158.053	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
335.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	338.735	0,05
140.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	145.797	0,02
340.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	360.988	0,05
300.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	309.426	0,04
355.000	Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030	364.463	0,05
310.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	336.344	0,05
436.000	Comstock Resources Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	451.576	0,06
235.000	CONSOL Energy Inc '144A' 11.000% 15-Nov-2025	243.621	0,03
252.000	Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026	271.898	0,04
700.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	731.724	0,10
354.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5.750% 01-Apr-2025	362.319	0,05
270.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5.625% 01-May-2027	275.333	0,04
457.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029	475.349	0,07
110.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	114.292	0,02
870.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	890.593	0,12
187.000	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2025	190.740	0,03
240.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	234.258	0,03
160.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	155.906	0,02
95.000	DCP Midstream Operating LP 3.875% 15-Mar-2023	97.526	0,01
185.000	DCP Midstream Operating LP 5.125% 15-May-2029	209.312	0,03
235.000	DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-Jul-2025	257.010	0,04
170.000	DCP Midstream Operating LP 5.600% 01-Apr-2044	211.721	0,03
175.000	DCP Midstream Operating LP 5.625% 15-Jul-2027	197.925	0,03
74.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.450% 03-Nov-2036	96.944	0,01
200.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037	267.805	0,04
170.000	DCP Midstream Operating LP '144A' FRN 5.850% 21-May-2043	165.609	0,02
137.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	140.713	0,02
200.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	208.284	0,03
650.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	666.520	0,09
200.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	208.308	0,03
450.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	468.077	0,06
498.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	528.321	0,07
190.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2025	201.251	0,03
100.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	103.004	0,01
145.000	EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029	148.506	0,02
145.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	151.012	0,02
390.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	405.036	0,06
285.000	EnLink Midstream Partners LP 4.400% 01-Apr-2024	298.126	0,04
175.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	184.378	0,03
140.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	135.303	0,02
200.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	202.060	0,03
245.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	247.445	0,03
148.000	EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024	153.891	0,02
345.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	353.989	0,05
193.000	EQM Midstream Partners LP 4.750% 15-Jul-2023	200.924	0,03
485.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	530.549	0,07

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
365.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	443.988	0,06
530.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	551.982	0,08
300.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	317.726	0,04
220.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	239.496	0,03
410.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	459.717	0,06
66.000	EQT Corp 3.000% 01-Oct-2022	66.751	0,01
306.000	EQT Corp 3.900% 01-Oct-2027	328.950	0,05
315.000	EQT Corp 6.625% 01-Feb-2025	355.561	0,05
555.000	EQT Corp 7.500% 01-Feb-2030	714.044	0,10
150.000	Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp 8.125% 01-May-2025	139.656	0,02
160.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 5.625% 15-Jun-2024	158.687	0,02
133.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	129.813	0,02
204.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.500% 01-Oct-2025	201.662	0,03
307.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	309.737	0,04
475.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	490.048	0,07
295.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	309.330	0,04
205.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	212.892	0,03
230.000	Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026	251.227	0,03
300.000	Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026	298.059	0,04
330.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	353.569	0,05
300.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030	298.261	0,04
300.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	312.813	0,04
440.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	453.695	0,06
375.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	387.047	0,05
300.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	310.125	0,04
255.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	268.427	0,04
240.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	239.612	0,03
460.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	471.928	0,07
200.000	Independence Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026	208.017	0,03
155.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026	159.036	0,02
505.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	500.778	0,07
250.000	KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025	270.408	0,04
200.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	204.208	0,03
150.000	Laredo Petroleum Inc '144A' 7.750% 31-Jul-2029	146.461	0,02
75.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	76.971	0,01
150.000	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 28-Feb-2025	157.993	0,02
615.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	634.283	0,09
300.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	314.931	0,04
214.000	MEG Energy Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2025	218.049	0,03
760.000	MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027	810.487	0,11
300.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	280.812	0,04
250.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	250.562	0,03
350.000	Murphy Oil Corp 5.750% 15-Aug-2025	359.975	0,05
195.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027	201.405	0,03
110.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	117.080	0,02
432.000	Murphy Oil Corp 6.375% 01-Dec-2042	432.607	0,06
188.000	Murphy Oil Corp 6.875% 15-Aug-2024	192.189	0,03
90.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	99.126	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
190.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	174.941	0,02
100.000	Nabors Industries Inc '144A' 9.000% 01-Feb-2025	103.512	0,01
315.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026	291.703	0,04
400.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025	409.256	0,06
1.095.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	1.088.014	0,15
716.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	724.112	0,10
1.340.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	1.383.691	0,19
180.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025	154.087	0,02
229.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 01-Nov-2023	225.803	0,03
110.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026	94.439	0,01
580.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	612.724	0,08
290.000	Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	302.150	0,04
160.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	169.360	0,02
215.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	231.582	0,03
90.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	97.744	0,01
275.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	305.671	0,04
200.000	Oasis Midstream Partners LP / OMP Finance Corp '144A' 8.000% 01-Apr-2029	218.284	0,03
750.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	766.409	0,11
318.000	Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026	326.285	0,04
315.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Jun-2025	322.973	0,04
280.000	Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047	274.824	0,04
381.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	381.617	0,05
295.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	294.642	0,04
323.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	331.685	0,05
125.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049	126.752	0,02
280.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	288.824	0,04
300.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	311.704	0,04
300.000	Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025	332.925	0,05
439.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	489.213	0,07
260.000	Occidental Petroleum Corp 5.875% 01-Sep-2025	286.976	0,04
450.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	549.126	0,08
165.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	203.191	0,03
200.000	Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-Sep-2028	237.744	0,03
535.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	683.192	0,09
375.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	487.151	0,07
550.000	Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-Sep-2030	681.549	0,09
390.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	432.957	0,06
225.000	Occidental Petroleum Corp 7.150% 15-May-2028	264.229	0,04
135.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	414.868	0,06
205.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	273.958	0,04
100.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	132.140	0,02
445.000	Occidental Petroleum Corp 8.000% 15-Jul-2025	519.982	0,07
170.000	Occidental Petroleum Corp 8.500% 15-Jul-2027	212.245	0,03
250.000	Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030	337.930	0,05
545.000	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	548.352	0,08
85.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	83.633	0,01
85.000	Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034	109.664	0,02
233.000	Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7.750% 15-Dec-2025	236.403	0,03
481.000	Parkland Corp '144A' 4.500% 01-Oct-2029	482.169	0,07
250.000	Parkland Corp '144A' 5.875% 15-Jul-2027	264.040	0,04
185.000	Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029	187.979	0,03
361.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	232.468	0,03
760.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9.250% 15-May-2025	723.790	0,10
252.000	PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp 6.875% 15-May-2023	245.332	0,03
415.000	PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026	429.012	0,06
83.000	PDC Energy Inc 6.125% 15-Sep-2024	84.127	0,01
28.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	28.560	0,00

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
450.000	Puma International Financing SA '144A' 5.000% 24-Jan-2026	450.871	0,06
300.000	Puma International Financing SA '144A' 5.125% 06-Oct-2024	301.305	0,04
179.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	185.048	0,03
266.000	Range Resources Corp 5.000% 15-Mar-2023	272.267	0,04
200.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	223.349	0,03
255.000	Range Resources Corp 9.250% 01-Feb-2026	275.161	0,04
130.000	Rattler Midstream LP '144A' 5.625% 15-Jul-2025	135.330	0,02
200.000	Renewable Energy Group Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2028	205.781	0,03
390.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	402.349	0,06
295.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	304.161	0,04
515.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	537.668	0,07
595.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	635.293	0,09
145.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	164.093	0,02
95.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	107.502	0,01
267.152	Ruby Pipeline LLC '144A' 8.000% 01-Apr-2022	249.653	0,03
238.000	SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025	240.349	0,03
537.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	552.326	0,08
129.000	SM Energy Co '144A' 10.000% 15-Jan-2025	142.031	0,02
310.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	319.362	0,04
890.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	938.643	0,13
214.000	Southwestern Energy Co 4.950% 23-Jan-2025	235.439	0,03
250.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	264.729	0,04
245.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	262.944	0,04
100.000	Southwestern Energy Co 8.375% 15-Sep-2028	111.763	0,02
300.000	Strathcona Resources Ltd '144A' 6.875% 01-Aug-2026	295.188	0,04
200.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025	181.208	0,03
300.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	298.951	0,04
200.000	Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026	204.208	0,03
385.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	391.630	0,05
145.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	153.538	0,02
311.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027	324.653	0,04
400.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.500% 30-Apr-2030	410.572	0,06
320.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028	317.653	0,04
200.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	208.200	0,03
465.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030	466.674	0,06
810.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	805.950	0,11
175.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	189.615	0,03
190.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	199.223	0,03
225.000	Tap Rock Resources LLC '144A' 7.000% 01-Oct-2026	234.234	0,03
175.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.875% 01-Feb-2031	190.344	0,03
200.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.000% 15-Jan-2028	211.063	0,03
189.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 01-Feb-2027	195.008	0,03
579.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.500% 01-Mar-2030	633.530	0,09
800.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15-Apr-2026	835.784	0,12
270.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.500% 15-Jul-2027	289.732	0,04
595.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	666.495	0,09
400.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 4.000% 15-Jan-2032	418.692	0,06
200.000	TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026	214.204	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Energie Forts.</b>			
110.000	Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029	111.869	0,02
395.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.250% 31-Jan-2023	404.304	0,06
155.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	162.731	0,02
160.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	169.700	0,02
239.000	TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp 6.125% 15-Feb-2026	236.946	0,03
368.499	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15-Jan-2024	349.537	0,05
340.000	Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	262.154	0,04
287.500	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.750% 15-Oct-2024	291.085	0,04
224.450	Transocean Pontus Ltd '144A' 6.125% 01-Aug-2025	219.633	0,03
280.000	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	270.841	0,04
179.000	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.250% 01-Dec-2024	176.848	0,02
274.942	Transocean Sentry Ltd '144A' 5.375% 15-May-2023	265.304	0,04
280.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	291.507	0,04
320.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	338.336	0,05
190.000	Vantage Drilling International '144A' 9.250% 15-Nov-2023	179.540	0,02
305.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	316.945	0,04
800.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	841.392	0,12
375.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	398.149	0,05
390.000	Vine Energy Holdings LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	423.834	0,06
300.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	310.236	0,04
260.000	W&T Offshore Inc '144A' 9.750% 01-Nov-2023	248.570	0,03
830.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	863.038	0,12
85.000	Weatherford International Ltd '144A' 11.000% 01-Dec-2024	87.638	0,01
160.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	167.840	0,02
370.000	Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025	387.116	0,05
115.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	125.412	0,02
217.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	236.410	0,03
789.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030	870.271	0,12
298.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	359.524	0,05
174.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	208.177	0,03
150.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048	179.615	0,02
746.000	Western Midstream Operating LP 6.500% 01-Feb-2050	883.275	0,12
<b>Finanzwerte - 74.165.247</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 74.106.455)</b>		<b>74.165.247</b>	<b>10,21</b>
670.000	Acisure LLC / Acisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	652.590	0,09
300.000	Acisure LLC / Acisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	296.672	0,04
590.000	Acisure LLC / Acisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	590.658	0,08
170.000	Acisure LLC / Acisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	187.389	0,03
147.000	Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027	163.385	0,02
211.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	219.211	0,03
335.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	335.348	0,05
520.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	540.041	0,07

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
335.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	378.339	0,05
505.000	American Finance Trust Inc / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	509.482	0,07
400.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	404.686	0,06
450.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	436.032	0,06
380.000	Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048	434.625	0,06
300.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	292.253	0,04
280.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	282.391	0,04
265.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	277.122	0,04
390.000	BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029	383.723	0,05
801.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSi Selco LLC '144A' 4.500% 01-Apr-2027	786.802	0,11
408.000	CIT Group Inc 4.750% 16-Feb-2024	431.964	0,06
277.000	CIT Group Inc 5.250% 07-Mar-2025	305.471	0,04
155.000	CIT Group Inc 6.125% 09-Mar-2028	187.376	0,03
400.000	CIT Group Inc FRN 3.929% 19-Jun-2024	413.391	0,06
168.000	CNG Holdings Inc '144A' 12.500% 15-Jun-2024	159.247	0,02
200.000	Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029	197.781	0,03
925.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	865.643	0,12
410.000	Commerzbank AG '144A' 8.125% 19-Sep-2023	452.001	0,06
442.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	463.795	0,06
145.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	151.067	0,02
392.000	Credit Acceptance Corp '144A' 5.125% 31-Dec-2024	402.208	0,06
180.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028	183.858	0,03
630.000	CURO Finance LLC '144A' 7.500% 01-Aug-2028	633.938	0,09
400.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	402.848	0,06
200.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	214.285	0,03
535.000	Deutsche Bank AG 4.500% 01-Apr-2025	570.073	0,08
510.000	Deutsche Bank AG FRN 4.296% 24-May-2028	524.167	0,07
355.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 3.729% 14-Jan-2032	363.732	0,05
360.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 4.875% 01-Dec-2032	389.547	0,05
70.000	Diversified Healthcare Trust 4.375% 01-Mar-2031	67.331	0,01
70.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	68.702	0,01
315.000	Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025	341.213	0,05
290.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	410.927	0,06
267.000	Enact Holdings Inc '144A' 6.500% 15-Aug-2025	291.966	0,04
70.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 01-Sep-2024	71.674	0,01
150.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	154.845	0,02
326.000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15-Nov-2025	340.390	0,05
300.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027	293.562	0,04
300.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026	306.690	0,04
535.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.125% 15-Nov-2024	542.244	0,07
254.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.250% 15-Apr-2025	260.297	0,04
175.000	FS Energy and Power Fund '144A' 7.500% 15-Aug-2023	182.677	0,03
283.000	Genworth Holdings Inc 4.800% 15-Feb-2024	294.623	0,04
310.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	322.364	0,04
100.000	GEO Group Inc/The 5.125% 01-Apr-2023	95.357	0,01
253.000	GEO Group Inc/The 5.875% 15-Oct-2024	223.978	0,03
235.000	GEO Group Inc/The 6.000% 15-Apr-2026	189.842	0,03
943.681	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024	911.704	0,13
400.000	Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051	406.137	0,06
300.000	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027	293.431	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
72.000	goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	73.336	0,01
215.000	goeasy Ltd '144A' 5.375% 01-Dec-2024	221.135	0,03
300.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5.750% 01-Dec-2025	305.644	0,04
265.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	275.203	0,04
450.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	455.103	0,06
65.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025	67.665	0,01
100.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	102.861	0,01
300.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	278.575	0,04
190.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	192.809	0,03
670.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	677.692	0,09
365.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	389.258	0,05
800.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	823.020	0,11
400.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	390.606	0,05
415.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	431.108	0,06
1.117.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	1.149.175	0,16
600.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	625.683	0,09
400.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	407.432	0,06
675.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	723.864	0,10
809.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	895.982	0,12
300.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.198% 01-Jun-2032	303.235	0,04
300.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	309.496	0,04
590.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	597.375	0,08
764.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	793.406	0,11
535.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	554.581	0,08
350.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	360.152	0,05
540.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	562.529	0,08
750.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	791.712	0,11
235.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	251.836	0,04
200.000	iStar Inc 4.250% 01-Aug-2025	204.790	0,03
409.000	iStar Inc 4.750% 01-Oct-2024	424.845	0,06
165.000	iStar Inc 5.500% 15-Feb-2026	170.960	0,02
370.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	374.307	0,05
470.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	482.511	0,07
300.000	Jefferson Capital Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Aug-2026	304.059	0,04
125.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	128.002	0,02
300.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	304.566	0,04
620.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	639.533	0,09
266.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027	268.040	0,04
300.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	308.012	0,04
15.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	15.185	0,00
215.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	202.943	0,03
230.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025	227.169	0,03
205.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	193.011	0,03
40.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	55.529	0,01
300.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051	299.693	0,04
150.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029	153.812	0,02
305.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2027	316.113	0,04
500.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	525.708	0,07
143.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 01-Sep-2026	154.017	0,02
147.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 15-Jan-2028	159.161	0,02

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
425.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01-May-2024	454.744	0,06
340.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.750% 01-Feb-2027	384.601	0,05
465.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2029	488.917	0,07
330.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2025	352.501	0,05
775.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	809.263	0,11
575.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.500% 15-Mar-2031	582.354	0,08
364.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	384.650	0,05
537.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027	562.497	0,08
245.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030	242.290	0,03
449.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	458.658	0,06
200.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031	199.281	0,03
205.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	213.773	0,03
55.000	Navient Corp 4.875% 15-Mar-2028	54.945	0,01
135.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	137.732	0,02
200.000	Navient Corp 5.500% 25-Jan-2023	208.540	0,03
200.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	199.819	0,03
65.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	69.371	0,01
70.000	Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025	77.070	0,01
530.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	586.408	0,08
84.000	Navient Corp 7.250% 25-Sep-2023	90.594	0,01
250.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	238.476	0,03
262.000	Navient Corp 'MTN' 6.125% 25-Mar-2024	279.621	0,04
208.000	New Residential Investment Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	209.138	0,03
115.000	Newmark Group Inc 6.125% 15-Nov-2023	123.165	0,02
200.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	202.304	0,03
895.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	898.849	0,12
220.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	250.030	0,03
300.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	296.995	0,04
250.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	245.379	0,03
230.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	226.561	0,03
230.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	250.412	0,03
360.000	OneMain Finance Corp 5.625% 15-Mar-2023	376.427	0,05
510.000	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	541.329	0,07
315.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	353.249	0,05
655.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	729.516	0,10
582.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	664.338	0,09
140.000	OneMain Finance Corp 8.250% 01-Oct-2023	154.844	0,02
220.000	OneMain Finance Corp 8.875% 01-Jun-2025	235.661	0,03
555.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	568.331	0,08
350.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	364.516	0,05
340.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	359.045	0,05
435.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	418.868	0,06
300.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	308.589	0,04
445.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	450.075	0,06
145.000	PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026	150.068	0,02
160.000	PRA Group Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	160.642	0,02
192.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025	195.675	0,03
191.000	Radian Group Inc 4.500% 01-Oct-2024	200.274	0,03
170.000	Radian Group Inc 4.875% 15-Mar-2027	182.591	0,03
225.000	Radian Group Inc 6.625% 15-Mar-2025	248.892	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Finanzwerte Forts.</b>			
145.000	Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 4.875% 01-Jun-2023	148.960	0,02
175.000	Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	179.642	0,03
254.000	Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 7.625% 15-Jun-2025	269.494	0,04
260.000	Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 9.375% 01-Apr-2027	281.087	0,04
250.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	255.250	0,04
120.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029	120.182	0,02
250.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026	251.639	0,04
245.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	242.745	0,03
520.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	516.797	0,07
375.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	376.944	0,05
555.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	564.180	0,08
390.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033	395.464	0,05
730.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	752.867	0,10
735.000	SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029	706.732	0,10
270.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	247.547	0,03
425.000	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	416.961	0,06
660.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Jun-2023	660.568	0,09
245.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	239.141	0,03
240.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	237.260	0,03
148.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	144.091	0,02
184.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	178.678	0,02
170.000	Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027	174.713	0,02
220.000	Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025	238.627	0,03
225.000	SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025	235.362	0,03
181.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	188.431	0,03
140.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2023	145.041	0,02
65.000	Synovus Financial Corp FRN 5.900% 07-Feb-2029	69.521	0,01
740.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459% 30-Jun-2035	807.847	0,11
360.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	393.563	0,05
834.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	1.001.343	0,14
464.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	473.203	0,07
450.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	442.195	0,06
790.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	792.765	0,11
678.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	653.422	0,09
825.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7.875% 15-Feb-2025	862.084	0,12
160.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 4.750% 15-Apr-2028	158.919	0,02
550.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	548.944	0,08
315.000	USI Inc/NY '144A' 6.875% 01-May-2025	317.707	0,04
305.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2025	309.897	0,04
390.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2027	403.268	0,06
427.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2030	452.291	0,06
743.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.250% 01-Dec-2026	774.789	0,11
695.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029	740.835	0,10
260.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 10.500% 01-Jun-2024	278.470	0,04
235.000	WeWork Cos Inc '144A' 7.875% 01-May-2025	224.789	0,03
165.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	168.170	0,02
194.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	205.420	0,03

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Industrie - 64.216.541</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 74.770.832)</b>		<b>64.216.541</b>	<b>8,84</b>
186.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	192.846	0,03
220.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	239.925	0,03
320.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045	346.056	0,05
245.000	Altera Infrastructure LP/Teekay Offshore Finance Corp '144A' 8.500% 15-Jul-2023	134.750	0,02
150.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	154.402	0,02
332.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	345.612	0,05
535.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	543.148	0,07
465.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	479.434	0,07
270.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	267.357	0,04
550.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	544.789	0,07
299.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	306.101	0,04
200.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	206.707	0,03
285.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	287.102	0,04
565.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	569.167	0,08
405.000	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	428.915	0,06
160.000	Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031	164.230	0,02
975.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	947.437	0,13
410.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	405.476	0,06
490.000	Ball Corp 4.000% 15-Nov-2023	512.050	0,07
415.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	457.558	0,06
290.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	320.048	0,04
341.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	346.560	0,05
213.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	223.067	0,03
300.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	301.335	0,04
830.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	862.125	0,12
200.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	246.000	0,03
510.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Dec-2024	532.019	0,07
695.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 15-Mar-2025	708.890	0,10
816.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	846.584	0,12
440.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 8.500% 15-Jul-2025	440.081	0,06
160.000	Brightstar Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	171.766	0,02
400.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	416.724	0,06
235.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	252.372	0,03
218.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.750% 01-Jun-2027	230.225	0,03
170.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	172.794	0,02
200.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	202.787	0,03
109.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	111.114	0,02
150.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	144.211	0,02
150.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	156.443	0,02
300.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	307.949	0,04
100.000	Cellnex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041	95.784	0,01
100.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	103.100	0,01
246.000	Cleaver-Brooks Inc '144A' 7.875% 01-Mar-2023	241.208	0,03
120.000	Colfax Corp '144A' 6.375% 15-Feb-2026	124.173	0,02
65.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	66.441	0,01
155.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	154.443	0,02
350.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	374.036	0,05
400.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	410.526	0,06
250.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	255.105	0,04
400.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	390.986	0,05
392.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	400.930	0,06
10.000	EnerSys '144A' 5.000% 30-Apr-2023	10.337	0,00
345.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	361.148	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Industrie Forts.</b>			
345.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026	343.634	0,05
265.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 6.875% 15-Jan-2025	265.594	0,04
125.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	131.297	0,02
110.000	Forterra Finance LLC / FRTA Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jul-2025	116.855	0,02
760.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028	776.013	0,11
750.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	776.066	0,11
75.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	84.075	0,01
202.000	FXI Holdings Inc '144A' 7.875% 01-Nov-2024	206.028	0,03
472.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250% 15-Nov-2026	531.614	0,07
295.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026	304.911	0,04
270.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	266.389	0,04
200.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	202.248	0,03
115.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	112.895	0,02
225.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	231.750	0,03
380.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029	383.906	0,05
215.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	223.863	0,03
200.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029	205.295	0,03
270.000	GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028	274.532	0,04
300.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	310.950	0,04
94.000	Graphic Packaging International LLC 4.125% 15-Aug-2024	98.799	0,01
185.000	Graphic Packaging International LLC 4.875% 15-Nov-2022	188.432	0,03
400.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	399.574	0,05
175.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	173.939	0,02
200.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030	202.427	0,03
165.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029	170.198	0,02
180.000	Greif Inc '144A' 6.500% 01-Mar-2027	186.946	0,03
462.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	480.441	0,07
250.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	254.938	0,04
315.000	Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027	338.657	0,05
271.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	295.905	0,04
288.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	321.422	0,04
400.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	400.960	0,06
320.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	345.216	0,05
285.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	325.898	0,04
570.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	674.857	0,09
605.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	719.312	0,10
371.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	426.683	0,06
295.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	310.092	0,04
150.000	IEA Energy Services LLC '144A' 6.625% 15-Aug-2029	148.373	0,02
1.215.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	1.247.112	0,17
60.000	INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026	60.637	0,01
312.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028	321.360	0,04
170.000	Intertape Polymer Group Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2029	170.258	0,02
200.000	James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028	208.285	0,03
100.000	JPW Industries Holding Corp '144A' 9.000% 01-Oct-2024	104.771	0,01
169.000	Koppers Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2025	172.132	0,02
390.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	402.340	0,06
200.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	201.485	0,03
75.000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2040	88.130	0,01
105.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	105.417	0,01
500.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	500.765	0,07
230.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	242.346	0,03



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Industrie Forts.</b>			
303.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	318.200	0,04
300.000	MasTec Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	312.055	0,04
149.000	Matthews International Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2025	152.818	0,02
735.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	742.695	0,10
603.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	605.201	0,08
312.000	Maxar Space Robotics LLC '144A' 9.750% 31-Dec-2023	336.497	0,05
560.000	Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	566.404	0,08
250.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	253.876	0,03
100.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	107.141	0,01
180.000	OI European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	182.702	0,03
115.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2023	120.579	0,02
435.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Reynolds Gro '144A' 4.000% 15-Oct-2027	423.612	0,06
300.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	298.205	0,04
115.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	127.524	0,02
390.000	Pactiv LLC 8.375% 15-Apr-2027	434.721	0,06
368.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	357.512	0,05
100.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	99.151	0,01
180.000	Patrick Industries Inc '144A' 7.500% 15-Oct-2027	192.266	0,03
485.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	488.257	0,07
150.000	Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029	153.188	0,02
290.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	294.678	0,04
360.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750% 15-Oct-2027	398.484	0,05
142.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	148.186	0,02
240.000	Sealed Air Corp '144A' 5.125% 01-Dec-2024	257.316	0,04
154.000	Sealed Air Corp '144A' 5.250% 01-Apr-2023	159.742	0,02
495.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	548.089	0,08
270.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	343.621	0,05
250.000	Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029	252.851	0,03
340.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029	347.813	0,05
185.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	200.919	0,03
60.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.625% 01-Nov-2024	66.115	0,01
250.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	249.734	0,03
185.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	194.515	0,03
61.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	62.391	0,01
280.000	Spirit AeroSystems Inc 3.950% 15-Jun-2023	282.509	0,04
670.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	672.690	0,09
685.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	719.240	0,10
650.000	SRM Escrow Issuer LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	695.620	0,10
663.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	639.795	0,09
865.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	883.939	0,12
390.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	403.383	0,06
495.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	510.164	0,07
185.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	182.498	0,03
302.000	Stericycle Inc '144A' 5.375% 15-Jul-2024	308.353	0,04
239.000	Stevens Holding Co Inc '144A' 6.125% 01-Oct-2026	255.073	0,04
170.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	178.306	0,02
260.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	270.158	0,04
270.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	277.835	0,04
365.000	Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	421.104	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Industrie Forts.</b>			
235.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	238.769	0,03
960.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	1.010.429	0,14
201.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	202.796	0,03
700.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	698.943	0,10
240.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	241.393	0,03
1.525.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	1.573.457	0,22
573.000	TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026	589.385	0,08
660.000	TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027	690.360	0,09
1.968.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	2.047.980	0,28
650.000	TransDigm Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2025	686.572	0,09
270.000	TransDigm UK Holdings Plc 6.875% 15-May-2026	282.446	0,04
170.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	170.602	0,02
125.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 9.250% 01-Aug-2024	130.770	0,02
214.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	224.510	0,03
155.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	153.999	0,02
537.000	Triumph Group Inc '144A' 6.250% 15-Sep-2024	540.944	0,07
191.000	Triumph Group Inc '144A' 8.875% 01-Jun-2024	208.392	0,03
305.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.500% 15-Aug-2026	317.532	0,04
315.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	333.428	0,05
130.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	129.384	0,02
283.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	285.496	0,04
250.000	Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029	235.351	0,03
195.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	196.252	0,03
405.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	403.396	0,06
300.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	312.300	0,04
400.000	Weir Group Plc/The '144A' 2.200% 13-May-2026	395.025	0,05
20.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	20.972	0,00
660.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	700.442	0,10
450.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	494.073	0,07
129.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	158.596	0,02
472.000	XPO Logistics Inc '144A' 6.250% 01-May-2025	494.427	0,07
<b>Technologie - 29.366.293</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 32.911.183)</b>		<b>29.366.293</b>	<b>4,04</b>
115.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2026	120.004	0,02
346.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	366.040	0,05
520.000	ams AG '144A' 7.000% 31-Jul-2025	552.012	0,08
228.000	Austin BidCo Inc '144A' 7.125% 15-Dec-2028	235.734	0,03
540.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	540.124	0,07
350.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	356.627	0,05
200.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 4.000% 01-Jul-2029	206.787	0,03
120.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	125.981	0,02
80.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	82.886	0,01
260.000	CDK Global Inc 4.875% 01-Jun-2027	269.392	0,04
145.000	CDK Global Inc 5.000% 15-Oct-2024	158.275	0,02
320.000	CDK Global Inc '144A' 5.250% 15-May-2029	339.666	0,05
650.000	Change Healthcare Holdings LLC / Change Healthcare Finance Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2025	656.363	0,09
180.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028	181.263	0,02
375.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029	381.469	0,05
125.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029	123.386	0,02
520.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	541.421	0,07
300.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028	313.926	0,04
300.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	296.717	0,04
35.000	Diebold Nixdorf Inc 8.500% 15-Apr-2024	35.036	0,00
85.000	Diebold Nixdorf Inc '144A' 9.375% 15-Jul-2025	91.616	0,01

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Technologie Forts.</b>			
509.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 6.875% 15-Aug-2026	529.910	0,07
105.000	Elastic NV '144A' 4,125% 15-Jul-2029	104.057	0,01
530.000	Entegris Inc '144A' 3,625% 01-May-2029	532.086	0,07
113.000	Entegris Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2028	116.548	0,02
600.000	Exela Intermediate LLC / Exela Finance Inc '144A' 10,000% 15-Jul-2023	476.541	0,07
147.000	Fair Isaac Corp '144A' 4,000% 15-Jun-2028	151.304	0,02
300.000	MicroStrategy Inc '144A' 6,125% 15-Jun-2028	301.059	0,04
340.000	MSCI Inc '144A' 3,250% 15-Aug-2033	344.354	0,05
555.000	MSCI Inc '144A' 3,625% 01-Sep-2030	568.342	0,08
190.000	MSCI Inc '144A' 3,625% 01-Nov-2031	197.398	0,03
470.000	MSCI Inc '144A' 3,875% 15-Feb-2031	490.114	0,07
290.000	MSCI Inc '144A' 4,000% 15-Nov-2029	303.531	0,04
425.000	NCR Corp '144A' 5,000% 01-Oct-2028	438.396	0,06
430.000	NCR Corp '144A' 5,125% 15-Apr-2029	445.914	0,06
185.000	NCR Corp '144A' 5,250% 01-Oct-2030	190.364	0,03
414.000	NCR Corp '144A' 5,750% 01-Sep-2027	433.044	0,06
45.000	NCR Corp '144A' 6,125% 01-Sep-2029	48.277	0,01
145.000	Nuance Communications Inc 5,625% 15-Dec-2026	149.763	0,02
655.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3,875% 01-Sep-2028	672.315	0,09
760.000	Open Text Corp '144A' 3,875% 15-Feb-2028	775.800	0,11
500.000	Open Text Corp '144A' 3,875% 01-Dec-2029	507.080	0,07
650.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4,125% 15-Feb-2030	670.501	0,09
110.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6,875% 15-Mar-2027	112.860	0,02
460.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7,250% 15-Mar-2029	473.296	0,06
165.000	Playtika Holding Corp '144A' 4,250% 15-Mar-2029	161.950	0,02
254.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4,875% 01-Feb-2027	261.889	0,04
255.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8,250% 01-Feb-2028	271.936	0,04
280.000	PTC Inc '144A' 3,625% 15-Feb-2025	284.145	0,04
35.000	PTC Inc '144A' 4,000% 15-Feb-2028	35.669	0,00
400.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 3,500% 15-Feb-2028	381.394	0,05
425.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5,375% 01-Dec-2028	414.987	0,06
950.000	ROBLOX Corp '144A' 3,875% 01-May-2030	965.209	0,13
340.000	Rocket Software Inc '144A' 6,500% 15-Feb-2029	332.182	0,05
125.000	Science Applications International Corp '144A' 4,875% 01-Apr-2028	128.315	0,02
342.000	Seagate HDD Cayman 3,125% 15-Jul-2029	334.763	0,05
230.000	Seagate HDD Cayman 3,375% 15-Jul-2031	224.786	0,03
860.000	Seagate HDD Cayman 4,091% 01-Jun-2029	891.334	0,12
865.000	Seagate HDD Cayman 4,125% 15-Jan-2031	901.187	0,12
960.000	Seagate HDD Cayman 4,750% 01-Jun-2023	1.004.419	0,14
765.000	Seagate HDD Cayman 4,750% 01-Jan-2025	819.357	0,11
735.000	Seagate HDD Cayman 4,875% 01-Mar-2024	780.166	0,11
785.000	Seagate HDD Cayman 4,875% 01-Jun-2027	856.435	0,12
460.000	Seagate HDD Cayman 5,750% 01-Dec-2034	530.803	0,07
825.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5,500% 30-Sep-2027	863.119	0,12
250.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp '144A' 5,750% 01-Jun-2025	259.629	0,04
200.000	Twilio Inc 3,875% 15-Mar-2031	202.227	0,03
190.000	Unisys Corp '144A' 6,875% 01-Nov-2027	205.960	0,03
459.000	Vericast Corp '144A' 11,000% 15-Sep-2026	487.114	0,07
635.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7,500% 01-Sep-2025	658.054	0,09
315.000	Xerox Corp 4,375% 15-Mar-2023	325.789	0,04
135.000	Xerox Corp 4,800% 01-Mar-2035	136.515	0,02
175.000	Xerox Corp 6,750% 15-Dec-2039	195.412	0,03
330.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5,000% 15-Aug-2025	350.146	0,05
575.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5,500% 15-Aug-2028	606.901	0,08
300.000	Ziff Davis Inc '144A' 4,625% 15-Oct-2030	308.204	0,04
180.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3,875% 01-Feb-2029	178.718	0,02
<b>Versorger - 18.202.400</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 22.182.877)</b>		<b>18.202.400</b>	<b>2,51</b>
115.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,500% 20-May-2025	123.309	0,02
171.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,625% 20-May-2024	185.051	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Versorger Forts.</b>			
149.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,750% 20-May-2027	164.980	0,02
70.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,875% 20-Aug-2026	78.366	0,01
350.000	Calpine Corp '144A' 3,750% 01-Mar-2031	340.053	0,05
469.000	Calpine Corp '144A' 4,500% 15-Feb-2028	486.226	0,07
250.000	Calpine Corp '144A' 4,625% 01-Feb-2029	246.941	0,03
350.000	Calpine Corp '144A' 5,000% 01-Feb-2031	350.541	0,05
505.000	Calpine Corp '144A' 5,125% 15-Mar-2028	513.474	0,07
248.000	Calpine Corp '144A' 5,250% 01-Jun-2026	254.749	0,03
265.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3,750% 15-Feb-2031	264.746	0,04
243.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4,750% 15-Mar-2028	255.811	0,03
114.000	DPL Inc 4,350% 15-Apr-2029	121.289	0,02
300.000	Drax Finco Plc '144A' 6,625% 01-Nov-2025	310.105	0,04
210.000	EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA '144A' 5,375% 30-Dec-2030	191.927	0,03
55.000	FirstEnergy Corp 1,600% 15-Jan-2026	53.349	0,01
150.000	FirstEnergy Corp 2,050% 01-Mar-2025	149.287	0,02
430.000	FirstEnergy Corp 2,250% 01-Sep-2030	415.030	0,06
495.000	FirstEnergy Corp 2,650% 01-Mar-2030	490.050	0,07
520.000	FirstEnergy Corp 3,400% 01-Mar-2050	510.900	0,07
950.000	FirstEnergy Corp 4,400% 15-Jul-2027	1.024.446	0,14
600.000	FirstEnergy Corp 4,750% 15-Mar-2023	624.750	0,09
640.000	FirstEnergy Corp 5,350% 15-Jul-2047	763.649	0,10
680.000	FirstEnergy Corp 7,375% 15-Nov-2031	919.292	0,13
80.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 2,866% 15-Sep-2028	80.277	0,01
100.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4,350% 15-Jan-2025	106.428	0,01
310.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4,550% 01-Apr-2049	355.968	0,05
165.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5,450% 15-Jul-2044	209.269	0,03
265.000	InterGen NV '144A' 7,000% 30-Jun-2023	263.012	0,04
130.265	Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6,000% 15-Mar-2025	134.263	0,02
235.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3,875% 15-Oct-2026	249.492	0,03
359.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4,250% 15-Jul-2024	373.355	0,05
115.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4,500% 15-Sep-2027	124.315	0,02
288.000	NRG Energy Inc 5,750% 15-Jan-2028	304.883	0,04
367.000	NRG Energy Inc '144A' 3,375% 15-Feb-2029	360.150	0,05
430.000	NRG Energy Inc '144A' 3,625% 15-Feb-2031	419.985	0,06
600.000	NRG Energy Inc '144A' 3,875% 15-Feb-2032	588.951	0,08
211.000	NRG Energy Inc '144A' 5,250% 15-Jun-2029	226.361	0,03
344.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4,500% 15-Aug-2028	357.437	0,05
490.000	PG&E Corp 5,000% 01-Jul-2028	516.254	0,07
490.000	PG&E Corp 5,250% 01-Jul-2030	514.743	0,07
300.000	Pike Corp '144A' 5,500% 01-Sep-2028	301.110	0,04
215.000	Rockpoint Gas Storage Canada Ltd '144A' 7,000% 31-Mar-2023	215.738	0,03
330.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7,625% 01-Apr-2026	346.843	0,05
100.000	Talen Energy Supply LLC 6,500% 01-Jun-2025	39.896	0,00
500.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7,250% 15-May-2027	443.000	0,06
520.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7,625% 01-Jun-2028	463.588	0,06
115.000	Terraform Global Operating LLC '144A' 6,125% 01-Mar-2026	117.605	0,02
115.000	TransAlta Corp 4,500% 15-Nov-2022	116.868	0,02
6.000	TransAlta Corp 6,500% 15-Mar-2040	6.966	0,00
790.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4,375% 01-May-2029	792.880	0,11
542.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,000% 31-Jul-2027	563.170	0,08
337.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,500% 01-Sep-2026	348.453	0,05
410.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,625% 15-Feb-2027	422.819	0,06

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Versorger Forts.</b>			
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>699.100.009</b>	<b>96,21</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Energie - 3.934</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>3.934</b>	<b>0,00</b>
61	Chesapeake Energy Corp	3.934	0,00
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>3.934</b>	<b>0,00</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Energie - 3.742</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>3.742</b>	<b>0,00</b>
115	Chesapeake Energy Corp (WTS) 09-Feb-2026	3.742	0,00
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>3.742</b>	<b>0,00</b>
<b>Credit Default Swaps - 4.353.157</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.986.419)</b>			
(47.300.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 37 5.000% 20-Dec-2026	4.353.157	0,60
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>4.353.157</b>	<b>0,60</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 10.495.044 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 9.442.896)			
		10.495.044	1,44
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>713.955.886</b>	<b>98,25</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (4.088.433) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (333.500))			
		(4.088.433)	(0,56)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(4.088.433)</b>	<b>(0,56)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>16.744.250</b>	<b>2,31</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>726.611.703</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Goldman Sachs.

**Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,20
OTC-derivative Finanzinstrumente	2,02
Sonstiges Umlaufvermögen	2,78
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<b>Devisenterminkontrakte</b>							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	170.000	192.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.114	
Euro	US-Dollar	275.811	312.706	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.370	
Euro	US-Dollar	40.352.121	45.665.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	284.449	
						<b>USD</b>	<b>286.933</b>
						<b>EUR</b>	<b>252.027</b>
US-Dollar	Euro	192.426	170.000	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.119)	
						<b>USD</b>	<b>(1.119)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(983)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	93	105	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	14.151	16.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	100	
						<b>USD</b>	<b>100</b>
						<b>EUR</b>	<b>88</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	87	99	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	13.151	14.883	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	93	
						<b>USD</b>	<b>93</b>
						<b>EUR</b>	<b>82</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	87.645	99.241	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	564	
Euro	US-Dollar	1.873.927	2.121.634	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12.275	
Euro	US-Dollar	303.426	344.016	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.507	
Euro	US-Dollar	296.946	335.759	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.385	
Euro	US-Dollar	111.785	127.002	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	292	
Euro	US-Dollar	44.441.273	50.293.627	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	313.274	
Euro	US-Dollar	63.526	72.060	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	279	
Euro	US-Dollar	184.019	207.766	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.784	
Euro	US-Dollar	203.634	229.815	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.070	
Euro	US-Dollar	112.297	126.289	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.588	
Euro	US-Dollar	41.903	47.353	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	363	
Euro	US-Dollar	74.026	83.409	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	887	
Euro	US-Dollar	67.066	75.766	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	604	
Euro	US-Dollar	98.937	112.106	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	557	
						<b>USD</b>	<b>338.429</b>
						<b>EUR</b>	<b>297.258</b>
US-Dollar	Euro	2.121.129	1.873.927	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12.338)	
US-Dollar	Euro	98.220	87.645	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(566)	
US-Dollar	Euro	36.210	32.024	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(257)	
US-Dollar	Euro	2.350	2.068	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	441	390	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	122.844	108.737	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(980)
US-Dollar	Euro	10.875	9.597	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Euro	180.808	160.776	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.274)
US-Dollar	Euro	225.190	199.536	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.029)
US-Dollar	Euro	176.122	155.263	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(681)
US-Dollar	Euro	296.977	261.859	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.211)
					<b>USD</b>	<b>(20.398)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(17.917)</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	191.767	217.420	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	952
Euro	US-Dollar	28.653.544	32.426.853	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	201.984
Euro	US-Dollar	15.000	17.012	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69
Euro	US-Dollar	30.000	33.871	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	291
					<b>USD</b>	<b>203.296</b>
					<b>EUR</b>	<b>178.565</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse G (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	573	650	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	63.919	72.337	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	451
Euro	US-Dollar	30.000	34.023	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	139
Euro	US-Dollar	12.495	14.175	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	54
					<b>USD</b>	<b>647</b>
					<b>EUR</b>	<b>568</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	171.772.289	226.930.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.573.568
					<b>USD</b>	<b>5.573.568</b>
					<b>GBP</b>	<b>4.117.741</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	110.311.645	83.397.408	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.568.214)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.888.685	2.185.500	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(69.427)
					<b>USD</b>	<b>(2.637.641)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(1.948.684)</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	85	115	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	12.099	15.983	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	393
					<b>USD</b>	<b>393</b>
					<b>GBP</b>	<b>290</b>

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	156.928	212.072	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	332
Pfund Sterling	US-Dollar	22.592.717	29.846.586	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	733.054
					<b>USD</b>	<b>733.386</b>
					<b>GBP</b>	<b>541.824</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	51.087	38.602	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.162)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.406	4.793	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(82)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.850	45.966	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.366)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.169	45.140	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(929)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.692	45.744	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.223)
US-Dollar	Pfund Sterling	61.357	46.383	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.424)

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	100.582	135.926	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	213
Pfund Sterling	US-Dollar	14.876.113	19.652.403	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	482.677
					<b>USD</b>	<b>482.890</b>
					<b>GBP</b>	<b>356.758</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	670.659	503.142	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10.353)
					<b>USD</b>	<b>(10.353)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(7.649)</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	45.070.925	59.541.897	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.462.393
					<b>USD</b>	<b>1.462.393</b>
					<b>GBP</b>	<b>1.080.413</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	59.574.977	45.058.678	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.412.736)
					<b>USD</b>	<b>(1.412.736)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(1.043.727)</b>

**BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	280.698	376.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.457
Pfund Sterling	US-Dollar	10.000	13.238	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	297
Pfund Sterling	US-Dollar	45.058.678	59.578.552	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.409.162
					<b>USD</b>	<b>1.412.916</b>
					<b>GBP</b>	<b>1.043.860</b>

# BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Supranational - 28.749.161</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.896.733)</b>			
28.749.161	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	28.749.161	5,19
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>28.749.161</b>	<b>5,19</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Argentinien - 13.407.785</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.600.172)</b>			
1.508.000	Banco Macro SA 'REGS' FRN 6.750% 04-Nov-2026	1.258.879	0,23
2.000.000	Pampa Energia SA 'REGS' 7.500% 24-Jan-2027	1.727.100	0,31
3.400.000	YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10.000% 25-Jul-2026	2.989.348	0,54
10.657.000	YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029	7.432.458	1,34
<b>Brasilien - 40.166.059</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 32.075.758)</b>			
3.180.000	Azul Investments LLP 'REGS' 5.875% 26-Oct-2024	2.966.336	0,54
3.730.000	Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026	3.421.529	0,62
5.000.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 4.500% 10-Jan-2025	5.050.805	0,91
1.500.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 10-Jan-2028	1.605.090	0,29
2.000.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	2.334.310	0,42
2.300.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	2.532.817	0,46
2.000.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual) 4.625% 27-Feb-2025	1.875.530	0,34
4.760.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	4.559.509	0,82
2.600.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	2.514.291	0,45
2.800.000	Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	2.602.614	0,47
6.530.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	6.170.850	1,11
2.910.000	StoneCo Ltd 'REGS' 3.950% 16-Jun-2028	2.572.978	0,47
2.000.000	Suzano Austria GmbH 3.125% 15-Jan-2032	1.959.400	0,35
<b>Burkina Faso - 4.974.050</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.000.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	4.974.050	0,90
<b>Burundi - 5.226.034</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
5.250.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN' 4.125% 30-Jun-2028	5.226.034	0,94
<b>Chile - 31.419.918</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.182.537)</b>			
2.105.000	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par 'REGS' 4.050% 27-Apr-2026	2.098.895	0,38
3.000.000	Banco Santander Chile 'REGS' 3.177% 26-Oct-2031	3.076.695	0,56
3.040.000	CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031	2.869.000	0,52
2.000.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 06-Mar-2030	2.008.250	0,36
3.150.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	3.121.445	0,56
1.500.000	Embotelladora Andina SA 'REGS' 3.950% 21-Jan-2050	1.551.840	0,28
4.000.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado 'REGS' 3.068% 18-Aug-2050	3.426.680	0,62
2.940.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	2.893.357	0,52
3.580.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 4.700% 22-Jan-2028	3.510.315	0,63
5.400.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	5.239.053	0,95
1.500.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 4.250% 22-Jan-2050	1.624.388	0,29
<b>China - 18.487.192</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 34.920.906)</b>			
1.700.000	CDBL Funding 2 'EMTN' 2.000% 04-Mar-2026	1.689.597	0,30
7.400.000	Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026	7.942.251	1,43
1.000.000	Redsun Properties Group Ltd 7.300% 13-Jan-2025	423.350	0,08
2.800.000	Shimao Group Holdings Ltd 3.450% 11-Jan-2031	1.593.452	0,29

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>China Forts.</b>			
1.000.000	Sunac China Holdings Ltd 5.950% 26-Apr-2024	642.500	0,11
1.500.000	Sunac China Holdings Ltd 6.500% 26-Jan-2026	933.750	0,17
950.000	Sunac China Holdings Ltd 6.650% 03-Aug-2024	605.625	0,11
2.500.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.240% 03-Jun-2050	2.343.642	0,42
1.400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.000% 25-Oct-2023	437.850	0,08
1.400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 04-Feb-2023	472.850	0,08
1.600.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 26-Feb-2024	484.400	0,09
1.110.000	Zhenro Properties Group Ltd 7.350% 05-Feb-2025	713.175	0,13
300.000	Zhenro Properties Group Ltd 9.150% 06-May-2023	204.750	0,04
<b>Kolumbien - 26.068.974</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 17.462.384)</b>			
2.000.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033	1.937.810	0,35
2.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA 'REGS' 4.875% 21-Apr-2025	2.070.400	0,37
1.000.000	Banco de Bogota SA 'REGS' 4.375% 03-Aug-2027	1.027.260	0,19
2.000.000	Bancolombia SA FRN 4.625% 18-Dec-2029	2.003.030	0,36
7.300.000	Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045	7.002.853	1,26
1.640.000	Frontera Energy Corp 'REGS' 7.875% 21-Jun-2028	1.527.726	0,28
3.200.000	GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	3.211.328	0,58
3.658.000	Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027	3.574.232	0,64
2.400.000	Grupo Energia Bogota SA ESP 'REGS' 4.875% 15-May-2030	2.589.420	0,47
1.130.000	Oleoducto Central SA 'REGS' 4.000% 14-Jul-2027	1.124.915	0,20
<b>Zypern - 4.903.955</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
4.185.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	4.903.955	0,88
<b>Ägypten - 8.432.010</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.203.053)</b>			
1.000.000	African Export-Import Bank/The 'EMTN' 4.125% 20-Jun-2024	1.051.520	0,19
4.000.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031	4.085.440	0,74
3.300.000	Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	3.295.050	0,59
<b>Ghana - 3.288.800</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.395.264)</b>			
4.000.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025	3.288.800	0,59
<b>Guatemala - 1.935.396</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.800.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029	1.935.396	0,35
<b>Hongkong - 1.215.159</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.981.792)</b>			
1.200.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS' 2.500% 08-May-2030	1.215.159	0,22
<b>Indien - 27.028.566</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.141.388)</b>			
7.230.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 3.100% 02-Feb-2031	6.889.254	1,24
2.500.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS' 4.375% 10-Jun-2025	2.665.649	0,48
7.786.000	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.700% 25-Aug-2026	7.786.000	1,40
2.000.000	JSW Steel Ltd 'REGS' 5.050% 05-Apr-2032	1.970.901	0,36
8.000.000	UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	7.716.762	1,39
<b>Indonesien - 29.760.631</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 13.401.780)</b>			
1.500.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 'EMTN' 3.750% 30-Mar-2026	1.524.789	0,28
1.400.000	Indika Energy Capital IV Pte Ltd 'REGS' 8.250% 22-Oct-2025	1.457.764	0,26
7.000.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3.398% 09-Jun-2031	7.077.587	1,28

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Indonesien Forts.</b>			
6.400.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	6.349.829	1,15
1.100.000	Medco Platinum Road Pte Ltd 'REGS' 6.750% 30-Jan-2025	1.124.607	0,20
5.300.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 2.300% 09-Feb-2031	5.067.769	0,91
4.200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 4.150% 25-Feb-2060	4.232.940	0,76
2.900.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4.375% 05-Feb-2050	2.925.346	0,53
<b>Israel - 13.449.784</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.828.667)</b>			
1.800.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	1.943.837	0,35
7.000.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	6.965.000	1,26
1.457.627	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	1.570.895	0,28
2.000.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd '144A' FRN 3.077% 07-Apr-2031	1.992.500	0,36
800.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.000% 31-Jan-2025	977.552	0,17
<b>Jordanien - 1.234.140</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.337.600)</b>			
1.200.000	Hikma Finance USA LLC 3.250% 09-Jul-2025	1.234.140	0,22
<b>Kasachstan - 1.329.303</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 817.262)</b>			
350.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8.950% 04-May-2023	809.478	0,15
500.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 3.500% 14-Apr-2033	519.825	0,09
<b>Kuwait - 12.843.138</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.743.480)</b>			
5.000.000	Burgan Bank SAK FRN 2.750% 15-Dec-2031	4.546.500	0,82
8.500.000	NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027	8.296.638	1,50
<b>Litauen - 4.529.608</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
4.200.000	Akropolis Group Uab 2.875% 02-Jun-2026	4.529.608	0,82
<b>Luxemburg - 4.426.172</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.500.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	1.663.633	0,30
2.400.000	Outlinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	2.762.539	0,50
<b>Macau - 12.902.695</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.108.295)</b>			
2.500.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	2.459.787	0,45
5.350.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027	5.263.945	0,95
2.000.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 5.250% 18-Jun-2025	1.987.120	0,36
2.000.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	1.793.100	0,32
1.500.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026	1.398.743	0,25
<b>Malaysia - 4.324.533</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.529.273)</b>			
4.500.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd 'EMTN' 3.064% 19-Aug-2050	4.324.533	0,78
<b>Mexiko - 34.627.748</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 32.039.861)</b>			
3.760.000	Alpek SAB de CV 'REGS' 3.250% 25-Feb-2031	3.755.996	0,68
1.800.000	Alsea SAB de CV 'REGS' 7.750% 14-Dec-2026	1.865.115	0,34
2.000.000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/ Cayman Islands 'REGS' FRN 2.720% 11-Aug-2031	1.985.020	0,36
11.000.000	Beclé SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031	10.829.390	1,96
3.650.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	3.669.710	0,66
5.000.000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028	3.013.400	0,54
5.670.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	5.554.133	1,00
2.430.000	Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060	2.163.854	0,39

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Mexiko Forts.</b>			
1.000.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	962.225	0,17
1.000.000	Unifin Financiera SAB de CV 'REGS' 8.375% 27-Jan-2028	828.905	0,15
<b>Moldawien - 5.487.794</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.281.250)</b>			
5.335.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	5.487.794	0,99
<b>Marokko - 10.742.232</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.731.231)</b>			
4.600.000	OCF SA 'REGS' 3.750% 23-Jun-2031	4.480.538	0,81
5.500.000	OCF SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	5.212.944	0,94
1.000.000	Vivo Energy Investments BV 'REGS' 5.125% 24-Sep-2027	1.048.750	0,19
<b>Nigeria - 18.229.905</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.267.700)</b>			
4.800.000	Access Bank Plc 'REGS' 6.125% 21-Sep-2026	4.791.504	0,87
3.600.000	Access Bank Plc 'REGS' FRN (Perpetual) 9.125% 07-Oct-2026	3.527.676	0,64
3.900.000	Africa Finance Corp 3.750% 30-Oct-2029	4.056.975	0,73
4.000.000	EBN Finance Co BV 'REGS' 7.125% 16-Feb-2026	3.949.000	0,71
1.900.000	United Bank for Africa Plc 'REGS' 6.750% 19-Nov-2026	1.904.750	0,34
<b>Panama - 14.060.339</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.768.387)</b>			
1.300.000	AES Panama Generation Holdings SRL 'REGS' 4.375% 31-May-2030	1.367.470	0,25
4.500.000	Banco Nacional de Panama 'REGS' 2.500% 11-Aug-2030	4.230.045	0,76
8.016.000	Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027	8.154.356	1,47
300.000	Cable Onda SA 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030	308.468	0,06
<b>Peru - 21.724.781</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.779.742)</b>			
870.000	Campsol SA 'REGS' 6.000% 03-Feb-2027	902.073	0,16
2.070.000	Consorcio Transmataro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	2.277.404	0,41
3.500.000	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 2.400% 28-Sep-2027	3.421.757	0,62
1.000.000	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' FRN 5.250% 15-Jul-2029	1.034.555	0,19
2.300.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.125% 16-Aug-2027	2.373.600	0,43
3.800.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	3.971.684	0,72
5.770.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 5.625% 19-Jun-2047	5.713.108	1,03
2.080.000	Volcan Cia Minera SAA 'REGS' 4.375% 11-Feb-2026	2.030.600	0,36
<b>Philippinen - 5.972.267</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.825.496)</b>			
5.000.000	PLDT Inc 2.500% 23-Jan-2031	4.968.712	0,90
1.000.000	PLDT Inc 3.450% 23-Jun-2050	1.003.555	0,18
<b>Katar - 13.452.839</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.949.283)</b>			
2.000.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN' 1.875% 08-Sep-2025	1.985.746	0,36
800.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN' 3.125% 24-Sep-2024	828.580	0,15
2.000.000	Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026	2.015.100	0,36
6.620.000	Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	6.566.265	1,19
2.000.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 2.625% 12-May-2025	2.057.148	0,37
<b>Republik Korea - 8.041.048</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.097.510)</b>			
2.000.000	Kookmin Bank 'REGS' 2.500% 04-Nov-2030	1.967.107	0,36
500.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.000% 23-Apr-2029	552.321	0,10
2.000.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	2.062.133	0,37
3.500.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 2.875% 12-May-2026	3.459.487	0,62

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Russland - 33.981.500</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 22.957.940)</b>		<b>33.981.500</b>	<b>6,13</b>
7.900.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	7.482.896	1,35
4.500.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031	4.351.250	0,79
5.300.000	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	5.180.093	0,93
2.000.000	Lukoil Securities BV 'REGS' 3.875% 06-May-2030	2.040.060	0,37
5.000.000	MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 'REGS' 2.800% 27-Oct-2026	4.951.625	0,89
1.750.000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 'REGS' 1.450% 02-Jun-2026	1.965.269	0,35
5.000.000	Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	4.867.890	0,88
275.000.000	Russian Railways Via RZD Capital Plc 6.598% 02-Mar-2028	3.142.417	0,57
<b>Saudi-Arabien - 13.257.503</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.999.434)</b>		<b>13.257.503</b>	<b>2,39</b>
2.000.000	Arab National Bank FRN 3.326% 28-Oct-2030	2.046.598	0,37
4.000.000	Riyad Sukuk Ltd FRN 3.174% 25-Feb-2030	4.095.840	0,74
5.108.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 2.250% 24-Nov-2030	4.974.865	0,90
2.000.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029	2.140.200	0,38
<b>Serbien - 1.657.793</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.808.992)</b>		<b>1.657.793</b>	<b>0,30</b>
1.500.000	United Group BV 'REGS' 3.625% 15-Feb-2028	1.657.793	0,30
<b>Südafrika - 9.524.700</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.020.642)</b>		<b>9.524.700</b>	<b>1,72</b>
3.200.000	Absa Group Ltd FRN (Perpetual) 6.375% 27-May-2026	3.265.472	0,59
3.000.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	2.975.617	0,54
3.256.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.750% 01-Oct-2030	3.283.611	0,59
<b>Thailand - 6.337.115</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.596.591)</b>		<b>6.337.115</b>	<b>1,14</b>
3.950.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.980% 18-Mar-2031	3.999.748	0,72
1.000.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.587% 10-Jun-2027	1.020.443	0,18
1.500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.750% 18-Jun-2050	1.316.924	0,24
<b>Togo - 2.871.116</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>2.871.116</b>	<b>0,52</b>
2.900.000	Ecobank Transnational Inc 'REGS' FRN 8.750% 17-Jun-2031	2.871.116	0,52
<b>Türkei - 11.179.129</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 19.818.267)</b>		<b>11.179.129</b>	<b>2,02</b>
4.800.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	3.924.000	0,71
4.350.000	Limak Iskenderun Uluslararası Liman Isletmeciligi AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036	4.033.994	0,73
1.700.000	Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026	1.564.415	0,28
1.800.000	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS 'REGS' 5.875% 14-Jan-2026	1.656.720	0,30
<b>Ukraine - 7.574.597</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 13.055.307)</b>		<b>7.574.597</b>	<b>1,37</b>
3.500.000	Metinvest BV 'REGS' 7.750% 17-Oct-2029	3.463.110	0,63
1.700.000	NPC Ukrenergo 'REGS' 6.875% 09-Nov-2026	1.489.413	0,27
2.800.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026	2.622.074	0,47
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 12.169.842</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 26.106.882)</b>		<b>12.169.842</b>	<b>2,19</b>
1.300.000	DAE Sukuk Dife Ltd 'REGS' 3.750% 15-Feb-2026	1.344.688	0,24
2.000.000	DIB Sukuk Ltd 2.950% 20-Feb-2025	2.066.350	0,37
1.500.000	EI Sukuk Co Ltd 1.827% 23-Sep-2025	1.500.075	0,27
1.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC FRN (Perpetual) 4.500% 05-Apr-2026	1.049.210	0,19

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Arabische Emirate Forts.</b>			
2.000.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.160% 31-Mar-2034	1.965.679	0,35
2.277.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040	2.269.600	0,41
2.000.000	National Central Cooling Co PJSC 2.500% 21-Oct-2027	1.974.240	0,36
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>502.246.150</b>	<b>90,61</b>
<b>Offene Terminkontrakte - 76.471</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
(259)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(31.314.719)	76,471
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>		<b>76.471</b>	<b>0,01</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.201.624 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.413.093)			
		1.201.624	0,21
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>532.273.406</b>	<b>96,02</b>
<b>Zugrunde liegendes Engagement USD</b>			
<b>Credit Default Swaps - (82.256)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 161.211)</b>			
10.000.000	CDS United Mexican States 1.000% 20-Jun-2026	(82.256)	(0,01)
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>(82.256)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Offene Terminkontrakte - (247.063)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
(241)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(31.427.906)	(247,063)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>		<b>(247.063)</b>	<b>(0,04)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (10.371) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.598.114))			
		(10.371)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(339.690)</b>	<b>(0,05)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>22.332.475</b>	<b>4,03</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>554.266.191</b>	<b>100,00</b>
Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist JPMorgan Chase Bank. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.			
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,66	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,01	
Derivative OTC-Finanzinstrumente		0,22	
Sonstiges Umlaufvermögen		4,11	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>								
US-Dollar	Russischer Rubel	207.459	15.000.000	9. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited		8.455	
Euro	US-Dollar	2.675.000	3.006.865	14. Feb. 22	Morgan Stanley		23.330	
US-Dollar	Euro	36.205.584	31.907.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley		61.882	
							<b>USD</b>	<b>93.667</b>
Euro	US-Dollar	1.570.000	1.778.876	14. Feb. 22	BNP Paribas		(407)	
Euro	US-Dollar	640.000	727.322	14. Feb. 22	Morgan Stanley		(2.341)	
							<b>USD</b>	<b>(2.748)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)</b>								
Schweizer Franken	US-Dollar	70.151	76.418	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		418	
Schweizer Franken	US-Dollar	18.186	19.876	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		43	
Schweizer Franken	US-Dollar	38.890.888	42.058.210	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		549.775	
Schweizer Franken	US-Dollar	550	598	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		4	
Schweizer Franken	US-Dollar	12.057	13.084	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		125	
Schweizer Franken	US-Dollar	5.655	6.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		77	
Schweizer Franken	US-Dollar	5.632	6.101	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		70	
Schweizer Franken	US-Dollar	2.813.108	3.045.652	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		36.325	
							<b>USD</b>	<b>586.837</b>
							<b>CHF</b>	<b>535.782</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	19.877	18.186	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(48)	
US-Dollar	Schweizer Franken	76.420	70.151	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(436)	
US-Dollar	Schweizer Franken	7.386	6.792	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(55)	
US-Dollar	Schweizer Franken	487	449	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(5)	
US-Dollar	Schweizer Franken	8.266	7.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(92)	
US-Dollar	Schweizer Franken	57.328	52.983	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(719)	
US-Dollar	Schweizer Franken	6.516	5.982	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(38)	
US-Dollar	Schweizer Franken	35.086	32.407	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(418)	
							<b>USD</b>	<b>(1.811)</b>
							<b>CHF</b>	<b>(1.653)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)</b>								
Schweizer Franken	US-Dollar	6.942.507	7.507.913	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		98.142	
							<b>USD</b>	<b>98.142</b>
							<b>CHF</b>	<b>89.604</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	10.504	11.876	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		15	
Euro	US-Dollar	10.999.961	12.429.763	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		23.101	
Euro	US-Dollar	14.988	16.917	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		50	
US-Dollar	Euro	18.158	16.020	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		22	
US-Dollar	Euro	230.866	203.785	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		165	
							<b>USD</b>	<b>23.353</b>
							<b>EUR</b>	<b>20.633</b>
US-Dollar	Euro	11.872	10.504	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(16)	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.</b>								
US-Dollar	Euro	15.739	13.938	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(40)	
US-Dollar	Euro	113.273	100.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(385)	
US-Dollar	Euro	43.569	38.600	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(130)	
							<b>USD</b>	<b>(571)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(504)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	15.330.278	17.322.946	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		32.196	
							<b>USD</b>	<b>32.196</b>
							<b>EUR</b>	<b>28.445</b>
US-Dollar	Euro	64.060	56.648	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(71)	
							<b>USD</b>	<b>(71)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(63)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	9.002	10.175	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		14	
US-Dollar	Euro	91.316	80.626	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		57	
Euro	US-Dollar	2.028.511	2.293.502	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.940	
Euro	US-Dollar	90.705.125	102.495.203	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		190.493	
Euro	US-Dollar	5.500	6.220	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		6	
Euro	US-Dollar	65.872	74.381	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		191	
Euro	US-Dollar	5.000	5.639	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		21	
Euro	US-Dollar	49.437	55.905	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		62	
Euro	US-Dollar	8.277	9.338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		32	
Euro	US-Dollar	35.091	39.608	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		118	
Euro	US-Dollar	531.762	599.939	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.060	
							<b>USD</b>	<b>195.994</b>
							<b>EUR</b>	<b>173.162</b>
US-Dollar	Euro	2.292.814	2.028.511	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(3.158)	
Euro	US-Dollar	80.626	91.336	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(61)	
Euro	US-Dollar	1.028.810	1.165.492	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(794)	
Euro	US-Dollar	18.208	18.362	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(13)	
Euro	US-Dollar	12.521	14.187	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(13)	
Euro	US-Dollar	66.190	74.994	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(61)	
US-Dollar	Euro	10.178	9.002	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(13)	
US-Dollar	Euro	31.569	27.914	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(32)	
US-Dollar	Euro	70.062	62.047	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(180)	
US-Dollar	Euro	24.878	22.058	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(94)	
US-Dollar	Euro	80.288	70.998	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(88)	
US-Dollar	Euro	39.929	35.390	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(136)	
US-Dollar	Euro	22.380	19.828	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(67)	



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**
**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
------	---------	---------------	---------------	-----------------------	------------	---

**BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	15.025	13.318	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(52)	
						<b>USD</b>	<b>(4.762)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(4.207)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	19.527.235	22.065.433	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	41.010	
						<b>USD</b>	<b>41.010</b>
						<b>EUR</b>	<b>36.233</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

US-Dollar	Pfund Sterling	32	24	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	24	32	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	4.005	5.383	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	14	
Pfund Sterling	US-Dollar	150	201	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Pfund Sterling	US-Dollar	4.614.128	6.087.497	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	130.359	
Pfund Sterling	US-Dollar	109	146	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Pfund Sterling	US-Dollar	345	457	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8	
Pfund Sterling	US-Dollar	1.556	2.064	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	32	
Pfund Sterling	US-Dollar	329	435	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9	
US-Dollar	Pfund Sterling	21	16	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>USD</b>	<b>130.425</b>
						<b>GBP</b>	<b>96.783</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	5.382	4.005	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)	
US-Dollar	Pfund Sterling	9.152	6.824	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(44)	
US-Dollar	Pfund Sterling	839	625	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Pfund Sterling	301	227	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Pfund Sterling	543	412	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)	
US-Dollar	Pfund Sterling	13.697	10.268	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(139)	
US-Dollar	Pfund Sterling	12.223	9.212	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(190)	
US-Dollar	Pfund Sterling	90	68	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
						<b>USD</b>	<b>(408)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(303)</b>

# BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen Forts.</b>			
	<b>Angola - 201.465</b>				<b>Costa Rica - 405.000</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 192.385)</b>	<b>201.465</b>	<b>0,61</b>		<b>(31. Dezember 2020: -)</b>	<b>405.000</b>	<b>1,22</b>
200.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.250% 09-May-2028	201.465	0,61	400.000	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6.125% 19-Feb-2031	405.000	1,22
	<b>Argentinien - 541.083</b>				<b>Elfenbeinküste - 883.998</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 607.338)</b>	<b>541.083</b>	<b>1,63</b>		<b>(31. Dezember 2020: 682.045)</b>	<b>883.998</b>	<b>2,67</b>
6.590	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	2.405	0,01	325.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033	343.132	1,04
37.037	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	13.519	0,04	250.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048	283.306	0,85
208.928	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	73.649	0,22	255.729	Ivory Coast Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.750% 31-Dec-2032	257.560	0,78
54.800	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	19.318	0,06		<b>Dominikanische Republik - 529.094</b>		
100.399	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035	32.254	0,10		<b>(31. Dezember 2020: 1.012.984)</b>	<b>529.094</b>	<b>1,60</b>
693.171	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035	222.688	0,67	325.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	331.094	1,00
500.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 2.500% 09-Jul-2041	177.250	0,53	200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041	198.000	0,60
	<b>Bahrain - 627.724</b>				<b>Ecuador - 790.572</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 1.158.382)</b>	<b>627.724</b>	<b>1,90</b>		<b>(31. Dezember 2020: 704.488)</b>	<b>790.572</b>	<b>2,39</b>
200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 5.450% 16-Sep-2032	194.675	0,59	64.164	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	36.413	0,11
200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 7.000% 12-Oct-2028	217.394	0,66	213.930	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040	125.818	0,38
200.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS' 6.250% 14-Nov-2024	215.655	0,65	670.065	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035	443.080	1,34
	<b>Brasilien - 1.282.748</b>			222.870	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.000% 31-Jul-2030	185.261	0,56
	<b>(31. Dezember 2020: 2.119.532)</b>	<b>1.282.748</b>	<b>3,87</b>		<b>Ägypten - 1.070.723</b>		
500.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	507.132	1,53		<b>(31. Dezember 2020: 899.045)</b>	<b>1.070.723</b>	<b>3,23</b>
200.000	Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4.875% 22-Jan-2030	194.542	0,59	300.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031	266.676	0,80
200.000	Hidrovias International Finance SAREL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	182.942	0,55	300.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	245.725	0,74
225.000	Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	209.132	0,63	400.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.625% 29-May-2032	380.038	1,15
200.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	189.000	0,57	200.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049	178.284	0,54
	<b>Burkina Faso - 198.888</b>				<b>El Salvador - 66.879</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: -)</b>	<b>198.888</b>	<b>0,60</b>		<b>(31. Dezember 2020: 105.312)</b>	<b>66.879</b>	<b>0,20</b>
200.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	198.888	0,60	111.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Jan-2027	66.879	0,20
	<b>Chile - 620.125</b>				<b>Georgien - 199.450</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 244.853)</b>	<b>620.125</b>	<b>1,87</b>		<b>(31. Dezember 2020: 550.258)</b>	<b>199.450</b>	<b>0,60</b>
200.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	197.116	0,59	200.000	Georgia Government International Bond 'REGS' 2.750% 22-Apr-2026	199.450	0,60
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4.375% 05-Feb-2049	228.970	0,69		<b>Ghana - 736.275</b>		
200.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	194.039	0,59		<b>(31. Dezember 2020: 895.258)</b>	<b>736.275</b>	<b>2,22</b>
	<b>China - 1.396.258</b>				<b>(31. Dezember 2020: 895.258)</b>	<b>736.275</b>	<b>2,22</b>
	<b>(31. Dezember 2020: 1.333.848)</b>	<b>1.396.258</b>	<b>4,21</b>		<b>(31. Dezember 2020: 895.258)</b>	<b>736.275</b>	<b>2,22</b>
200.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 3.421% 02-Nov-2030	202.014	0,61	450.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	376.436	1,14
475.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031	468.536	1,41	200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	157.500	0,47
440.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	479.263	1,45	200.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	202.339	0,61
250.000	Yili Holding Investment Ltd 1.625% 19-Nov-2025	246.445	0,74		<b>Indien - 351.796</b>		
	<b>Kolumbien - 1.001.271</b>				<b>(31. Dezember 2020: 369.910)</b>	<b>351.796</b>	<b>1,06</b>
	<b>(31. Dezember 2020: 1.470.942)</b>	<b>1.001.271</b>	<b>3,02</b>		<b>(31. Dezember 2020: 369.910)</b>	<b>351.796</b>	<b>1,06</b>
275.000	Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	247.357	0,75	345.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	351.796	1,06
200.000	Colombia Government International Bond 4.125% 15-May-2051	163.000	0,49		<b>Indonesien - 2.081.891</b>		
200.000	Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045	181.250	0,55		<b>(31. Dezember 2020: 2.272.102)</b>	<b>2.081.891</b>	<b>6,28</b>
406.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	409.664	1,23	200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 'REGS' 6.757% 15-Nov-2048	256.292	0,77
				200.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	198.534	0,60
				200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 4.175% 21-Jan-2050	206.356	0,62
				200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 6.500% 27-May-2041	259.426	0,78

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Indonesien Forts.</b>				
225.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030	232.222	0,70	
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.875% 17-Jul-2029	212.002	0,64	
250.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4.875% 17-Jul-2049	268.189	0,81	
400.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042	448.870	1,36	
<b>Israel - 653.112</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 240.750)</b>				
225.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	223.875	0,68	
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	196.924	0,59	
225.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023	232.313	0,70	
<b>Kasachstan - 854.988</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 485.785)</b>				
200.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 2.950% 06-May-2031	198.816	0,60	
200.000	Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS' 2.000% 28-Oct-2026	197.271	0,60	
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	233.625	0,70	
225.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030	225.276	0,68	
<b>Kenia - 270.188</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 714.343)</b>				
275.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	270.188	0,82	
<b>Kuwait - 726.820</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 540.559)</b>				
200.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	200.750	0,61	
260.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 4.250% 03-Nov-2026	283.195	0,85	
200.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.875% 18-May-2030	242.875	0,73	
<b>Macau - 182.000</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 204.605)</b>				
200.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	182.000	0,55	
<b>Mexiko - 4.055.998</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 4.525.054)</b>				
415.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024	428.710	1,29	
325.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	319.238	0,96	
255.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	251.000	0,76	
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 5.750% 14-Feb-2042	219.500	0,66	
200.000	Mexico Government International Bond 2.659% 24-May-2031	195.602	0,59	
225.000	Mexico Government International Bond 3.771% 24-May-2061	208.919	0,63	
222.000	Mexico Government International Bond 4.500% 31-Jan-2050	235.875	0,71	
405.000	Mexico Government International Bond 'MTN' 4.750% 08-Mar-2044	442.687	1,34	
575.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	559.878	1,69	
325.000	Petroleos Mexicanos 6.490% 23-Jan-2027	347.069	1,05	
250.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	259.801	0,78	
325.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	314.267	0,95	
250.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.875% 16-Oct-2025	273.452	0,83	
<b>Marokko - 233.174</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 262.640)</b>				
200.000	OCP SA 'REGS' 6.875% 25-Apr-2044	233.174	0,70	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Niederlande - 195.562</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
200.000	VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027	195.562	0,59	
<b>Nigeria - 866.420</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 724.132)</b>				
475.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	475.354	1,44	
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.625% 28-Nov-2047	179.566	0,54	
225.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	211.500	0,64	
<b>Oman - 840.668</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 671.445)</b>				
200.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6.250% 25-Jan-2031	219.033	0,66	
400.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	407.885	1,23	
200.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS' 4.875% 15-Jun-2030	213.750	0,65	
<b>Pakistan - 202.304</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 418.972)</b>				
200.000	Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027	202.304	0,61	
<b>Panama - 754.565</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 258.500)</b>				
350.000	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	332.763	1,00	
200.000	Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060	200.750	0,61	
200.000	Panama Government International Bond 4.500% 01-Apr-2056	221.052	0,67	
<b>Paraguay - 229.250</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
200.000	Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.400% 30-Mar-2050	229.250	0,69	
<b>Peru - 199.700</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 924.647)</b>				
200.000	Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	199.700	0,60	
<b>Katar - 298.954</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 279.091)</b>				
300.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	298.954	0,90	
<b>Republik Serbien - 130.496</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
125.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	130.496	0,39	
<b>Rumänien - 118.323</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 256.500)</b>				
100.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 5.125% 15-Jun-2048	118.323	0,36	
<b>Russland - 1.418.527</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.697.702)</b>				
200.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	189.450	0,57	
200.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031	193.637	0,58	
400.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.599% 26-Oct-2025	409.063	1,24	
200.000	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	195.187	0,59	
200.000	Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	194.940	0,59	
200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 5.100% 28-Mar-2035	236.250	0,71	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
	<b>Saudi-Arabien - 617.224</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 737.850)</b>	<b>617.224</b>	<b>1,86</b>
400.000	SA Global Sukuk Ltd 'REGS' 2.694% 17-Jun-2031	403.091	1,22
200.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029	214.133	0,64
	<b>Senegal - 393.360</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 943.783)</b>	<b>393.360</b>	<b>1,19</b>
400.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.750% 13-Mar-2048	393.360	1,19
	<b>Südafrika - 409.842</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 1.068.393)</b>	<b>409.842</b>	<b>1,24</b>
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.750% 30-Sep-2049	192.850	0,58
200.000	Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028	216.992	0,66
	<b>Supranational - 821.367</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 852.614)</b>	<b>821.367</b>	<b>2,48</b>
200.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026	201.290	0,61
560.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	620.077	1,87
	<b>Tansania - 616.527</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: -)</b>	<b>616.527</b>	<b>1,86</b>
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	198.327	0,60
400.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	418.200	1,26
	<b>Türkei - 1.187.828</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 1.936.635)</b>	<b>1.187.828</b>	<b>3,59</b>
400.000	Turk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	406.756	1,23
200.000	Turkey Government International Bond 5.750% 11-May-2047	162.119	0,49
375.000	Turkey Government International Bond 5.950% 15-Jan-2031	336.521	1,02
300.000	Turkey Government International Bond 6.875% 17-Mar-2036	282.432	0,85
	<b>Ukraine - 804.057</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 1.439.225)</b>	<b>804.057</b>	<b>2,43</b>
400.000	Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026	417.952	1,26
200.000	MHP Lux SA 'REGS' 6.250% 19-Sep-2029	189.600	0,57
215.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 1.258% 31-May-2040	196.505	0,60
	<b>Vereinigte Arabische Emirate - 1.845.311</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 2.049.557)</b>	<b>1.845.311</b>	<b>5,57</b>
200.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	203.000	0,61
275.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 4.700% 30-Sep-2049	300.482	0,91
280.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037	369.465	1,11
400.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	433.437	1,31
350.000	Emirate of Dubai Government International Bonds 'EMTN' 3.900% 09-Sep-2050	336.437	1,02
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3.234% 23-Oct-2029	202.490	0,61
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>31.911.805</b>	<b>96,31</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
	<b>Offene Terminkontrakte - 27.476</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 4.093)</b>			
(1)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(235.374)	12.454	0,04
4	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	641.750	5.758	0,01

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
	<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>			
8	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.577.000	9.264	0,03
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>27.476</b>	<b>0,08</b>
	Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 9.510 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 17.292)		9.510	0,03
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>31.948.791</b>	<b>96,42</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
	<b>Offene Terminkontrakte - (40.411)</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: (31.711))</b>			
(7)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(913.281)	(1.479)	(0,00)
(22)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(3.221.625)	(38.542)	(0,12)
7	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.527.203	(390)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(40.411)</b>	<b>(0,12)</b>
	Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (5.140) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.722))		(5.140)	(0,02)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(45.551)</b>	<b>(0,14)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>1.231.660</b>	<b>3,72</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>33.134.900</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,82
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,08
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,03
Sonstiges Umlaufvermögen	5,07
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

<b>Devisenterminkontrakte</b>							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>							
US-Dollar	Euro	443.437	391.604	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank		(2.790)
						<b>USD</b>	<b>(2.790)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	348.625	394.614	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.295
Euro	US-Dollar	1.023.450	1.158.226	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		7.215
						<b>USD</b>	<b>9.510</b>
						<b>EUR</b>	<b>8.353</b>
US-Dollar	Euro	6.951	6.162	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(66)
US-Dollar	Euro	394.708	348.625	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(2.284)
						<b>USD</b>	<b>(2.350)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(2.064)</b>

# BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Brasilien - 5.621.646</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.356.784)</b>			
11.200.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	1.982.432	1,75
9.500.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	1.673.422	1,47
7.800.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	1.362.441	1,20
3.500.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	603.351	0,53
<b>Chile - 6.559.098</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.082.334)</b>			
1.810.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 5,000% 01-Mar-2035	1.984.127	1,75
1.370.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 2,800% 01-Oct-2033	1.208.746	1,07
1.790.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 4,700% 01-Sep-2030	1.966.774	1,73
1.225.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 5,000% 01-Oct-2028	1.399.451	1,23
<b>China - 18.025.181</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 21.808.769)</b>			
33.700.000	China Government Bond 3,120% 05-Dec-2026	5.407.196	4,76
10.400.000	China Government Bond 3,250% 06-Jun-2026	1.676.016	1,48
67.830.000	China Government Bond 3,290% 23-May-2029	10.941.969	9,63
<b>Kolumbien - 9.692.355</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.173.937)</b>			
2.736.000.000	Colombian TES 7,000% 30-Jun-2032	614.504	0,54
2.175.000.000	Colombian TES 7,250% 26-Oct-2050	460.866	0,41
11.057.000.000	Colombian TES 7,750% 18-Sep-2030	2.654.996	2,34
5.100.000.000	Empresas Publicas de Medellín ESP 'REGS' 7,625% 10-Sep-2024	1.234.998	1,09
20.757.000.000	Empresas Publicas de Medellín ESP 'REGS' 8,375% 08-Nov-2027	4.726.991	4,16
<b>Tschechische Republik - 2.825.037</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 234.438)</b>			
8.800.000	Czech Republic Government Bond 0,950% 15-May-2030	343.977	0,31
34.900.000	Czech Republic Government Bond 1,500% 24-Apr-2040	1.309.148	1,15
26.100.000	Czech Republic Government Bond 2,750% 23-Jul-2029	1.171.912	1,03
<b>Ungarn - 1.892.062</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.440.558)</b>			
265.000.000	Hungary Government Bond 2,250% 20-Apr-2033	658.995	0,58
44.000.000	Hungary Government Bond 3,000% 27-Oct-2027	125.770	0,11
105.000.000	Hungary Government Bond 3,000% 21-Aug-2030	289.324	0,26
328.000.000	Hungary Government Bond 3,000% 27-Oct-2038	817.973	0,72
<b>Indonesien - 8.055.303</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.700.868)</b>			
48.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15-May-2028	3.431.788	3,02
34.704.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000% 15-May-2027	2.615.043	2,30
1.400.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,500% 15-Jun-2035	103.066	0,09
12.700.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250% 15-Jun-2032	998.491	0,88
11.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15-Mar-2034	906.915	0,80
<b>Malaysia - 4.213.292</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.895.724)</b>			
4.150.000	Malaysia Government Bond 3,502% 31-May-2027	1.009.969	0,89
5.350.000	Malaysia Government Bond 3,828% 05-Jul-2034	1.278.899	1,13
7.350.000	Malaysia Government Bond 4,921% 06-Jul-2048	1.924.424	1,69
<b>Mexiko - 12.778.997</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 27.111.323)</b>			
108.275.000	Mexican Bonos 7,500% 03-Jun-2027	5.306.644	4,67
40.200.000	Mexican Bonos 7,750% 13-Nov-2042	1.907.210	1,68
107.600.000	Mexican Bonos 8,500% 31-May-2029	5.565.143	4,90

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Peru - 1.640.323</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.612.977)</b>			
4.100.000	Peru Government Bond 5,700% 12-Aug-2024	1.062.735	0,93
2.250.000	Peru Government Bond 5,940% 12-Feb-2029	577.588	0,51
<b>Rumänien - 560.719</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.901.867)</b>			
550.000	Romania Government Bond 4,750% 24-Feb-2025	127.168	0,11
1.800.000	Romania Government Bond 5,800% 26-Jul-2027	433.551	0,38
<b>Rusland - 13.666.415</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 20.484.938)</b>			
394.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,050% 19-Jan-2028	4.937.859	4,35
265.381.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,700% 23-Mar-2033	3.404.843	3,00
401.500.000	Russian Federal Bond - OFZ 8,150% 03-Feb-2027	5.323.713	4,68
<b>Südafrika - 13.471.984</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 20.850.830)</b>			
122.000.000	Republic of South Africa Government Bond 7,000% 28-Feb-2031	6.457.729	5,69
54.000.000	Republic of South Africa Government Bond 8,000% 31-Jan-2030	3.128.509	2,75
38.200.000	Republic of South Africa Government Bond 8,750% 28-Feb-2048	1.994.636	1,76
27.221.735	Republic of South Africa Government Bond 10,500% 21-Dec-2026	1.891.110	1,66
<b>Thailand - 4.074.333</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.114.098)</b>			
26.700.000	Thailand Government Bond 2,875% 17-Jun-2046	809.795	0,71
77.000.000	Thailand Government Bond 3,400% 17-Jun-2036	2.574.021	2,27
20.000.000	Thailand Government Bond 3,650% 20-Jun-2031	690.517	0,61
<b>Uruguay - 118.994</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 626.062)</b>			
5.500.000	Uruguay Government International Bond 8,250% 21-May-2031	118.994	0,11
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>103.195.739</b>	<b>90,87</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 910.828 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.165.896)		910.828	0,80
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>104.106.567</b>	<b>91,67</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (481.453) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (939.928))		(481.453)	(0,42)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(481.453)</b>	<b>(0,42)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>9.934.616</b>	<b>8,75</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>113.559.730</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		89,51	
Derivative OTC-Finanzinstrumente		0,79	
Sonstiges Umlaufvermögen		9,70	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>						
Ungarischer Forint	US-Dollar	218.608.040	670.546	3. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	3.209
Brasilianischer Real	US-Dollar	21.135.000	3.748.736	4. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	45.698
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.080.000	187.614	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	6.282
Brasilianischer Real	US-Dollar	21.375.000	3.830.302	4. Jan. 22	Goldman Sachs	7.220
Brasilianischer Real	US-Dollar	840.000	150.524	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	284
Euro	US-Dollar	130.000	147.503	5. Jan. 22	HSBC Bank plc	502
US-Dollar	Hongkong-Dollar	11.931.327	92.500.000	10. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	68.493
Taiwan-Dollar	US-Dollar	2.300.000	83.003	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	127
Taiwan-Dollar	US-Dollar	2.720.000	98.018	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	291
US-Dollar	Taiwan-Dollar	2.643.624	72.860.000	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	17.462
Brasilianischer Real	US-Dollar	21.375.000	3.736.627	3. Mrz. 22	Goldman Sachs	48.817
Chinesischer Yuan	US-Dollar	3.120.000	485.656	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	2.858
Tschechische Krone	US-Dollar	16.840.000	746.421	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	19.096
Ungarischer Forint	US-Dollar	371.760.000	1.125.663	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	11.942
Ungarischer Forint	US-Dollar	870.120.000	2.654.626	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	7.987
Indische Rupie	US-Dollar	127.930.000	1.677.375	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	25.363
Indonesische Rupiah	US-Dollar	5.523.340.000	380.605	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	4.775
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	22.910.000	5.402.028	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	91.320
Mexikanischer Peso	US-Dollar	6.757.492	320.483	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	5.451
Mexikanischer Peso	US-Dollar	122.500.000	5.755.295	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	153.237
Polnischer Zloty	US-Dollar	28.720.000	7.017.321	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	73.000
Polnischer Zloty	US-Dollar	16.790.000	4.105.837	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	39.236
Rumanischer Leu	US-Dollar	2.110.000	479.306	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	2.857
Rumanischer Leu	US-Dollar	510.000	114.877	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	1.664
Thailändischer Baht	US-Dollar	117.200.000	3.501.068	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	6.401
Thailändischer Baht	US-Dollar	37.460.000	1.111.853	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	9.220
Thailändischer Baht	US-Dollar	93.830.000	2.801.899	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	6.171
Türkische Lira	US-Dollar	10.500.000	724.263	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	22.573
US-Dollar	Chilenischer Peso	2.165.492	1.855.870.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	10.779
US-Dollar	Chinesischer Yuan	4.137.776	26.420.000	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	1.063
US-Dollar	Chinesischer Yuan	3.296.266	21.050.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	361
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	3.043.001	12.088.320.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	93.402
US-Dollar	Russischer Rubel	2.702.337	203.540.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	22.975
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	4.047.479	64.480.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	41.373
<b>USD</b>						<b>851.489</b>
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.787.295	21.135.000	4. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(7139)
US-Dollar	Brasilianischer Real	193.531	1.080.000	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	(365)
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.789.558	21.375.000	4. Jan. 22	Goldman Sachs	(47965)
US-Dollar	Brasilianischer Real	147.201	840.000	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	(3.607)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	20.920.000	2.685.149	10. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.225)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	1.520.000	195.248	10. Jan. 22	HSBC Bank plc	(312)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	19.900.000	2.561.002	10. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	(8.890)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	23.700.000	3.045.521	10. Jan. 22	HSBC Bank plc	(6.070)
Taiwan-Dollar	US-Dollar	2.510.000	91.273	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(653)
Taiwan-Dollar	US-Dollar	2.500.000	91.508	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(1.150)
Philippinischer Peso	US-Dollar	7.980.000	157.558	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.174)
US-Dollar	Ungarischer Forint	665.611	218.610.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.347)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	8.745.714	188.767.492	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	(359.092)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	391.727	1.610.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(10.128)
US-Dollar	Polnischer Zloty	1.165.124	4.820.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(24.826)
<b>USD</b>						<b>(478.843)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	15.962	18.068	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	105
Euro	US-Dollar	32.799	3.7116	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	233
Euro	US-Dollar	4.122.463	4.665.339	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	29.060
<b>USD</b>						<b>29.398</b>
<b>EUR</b>						<b>25.822</b>
US-Dollar	Euro	18.072	15.962	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(105)
US-Dollar	Euro	24.033	21.191	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(98)
US-Dollar	Euro	15.747	13.947	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(135)
US-Dollar	Euro	20.341	18.087	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(256)
US-Dollar	Euro	44.943	39.887	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(478)
US-Dollar	Euro	45.687	40.533	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(469)
<b>USD</b>						<b>(1.541)</b>
<b>EUR</b>						<b>(1.354)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	2.794	3.162	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18
Euro	US-Dollar	3.243.229	3.670.321	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22.862
Euro	US-Dollar	1.553	1.762	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	27.376	30.980	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	195
Euro	US-Dollar	143.634	162.169	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.393
<b>USD</b>						<b>24.475</b>
<b>EUR</b>						<b>21.498</b>
US-Dollar	Euro	3.163	2.794	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Euro	4.129	3.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(35)
US-Dollar	Euro	35.642	31.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(366)
<b>USD</b>						<b>(419)</b>
<b>EUR</b>						<b>(368)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	656.018	742.407	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.624
Euro	US-Dollar	5.073	5.741	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36
<b>USD</b>						<b>4.660</b>
<b>EUR</b>						<b>4.093</b>
US-Dollar	Euro	66.258	58.685	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(569)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
------	---------	---------------	---------------	-----------------------	------------	---

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	7.167	6.358	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(74)
					<b>USD</b>	<b>(643)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(565)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	9.443	10.687	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	67
Euro	US-Dollar	78	88	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
					<b>USD</b>	<b>68</b>
					<b>EUR</b>	<b>60</b>
US-Dollar	Euro	103	92	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
					<b>USD</b>	<b>(1)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(1)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling J (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	4.783	6.319	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	155
Pfund Sterling	US-Dollar	40	53	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
					<b>USD</b>	<b>155</b>
					<b>GBP</b>	<b>115</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	62	47	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
					<b>USD</b>	<b>(1)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(1)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	8.000	10.582	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	246
Pfund Sterling	US-Dollar	10.335	13.654	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	335
Pfund Sterling	US-Dollar	154	207	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
					<b>USD</b>	<b>583</b>
					<b>GBP</b>	<b>431</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	216	163	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)
					<b>USD</b>	<b>(5)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(4)</b>



# BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Argentinien - 201.706</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 281.901)</b>			
21.880	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	7.987	0,03
349.200	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035	112.184	0,40
230.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 2.500% 09-Jul-2041	81.535	0,29
<b>Bahrain - 215.797</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 451.451)</b>			
200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 6.750% 20-Sep-2029	215.797	0,78
<b>Brasilien - 1.484.114</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.951.740)</b>			
1.450.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	256.654	0,92
1.250.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	220.187	0,79
1.450.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	253.274	0,91
300.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	51.716	0,18
200.000	Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	182.942	0,66
175.000	Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	162.658	0,58
172.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030	167.683	0,60
200.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	189.000	0,68
<b>Burkina Faso - 198.888</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
200.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	198.888	0,71
<b>Chile - 1.332.556</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.216.161)</b>			
455.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	498.772	1,79
240.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.800% 01-Oct-2033	211.751	0,76
275.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	302.158	1,08
280.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	319.875	1,15
<b>China - 1.967.394</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.528.170)</b>			
1.600.000	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	256.721	0,92
8.050.000	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	1.298.583	4,66
2.450.000	China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	412.090	1,48
<b>Kolumbien - 1.297.225</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.361.287)</b>			
300.000	Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	269.844	0,97
150.000.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	31.784	0,11
346.100.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	83.105	0,30
1.520.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	368.078	1,32
1.530.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	348.427	1,25
180.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	195.987	0,70
<b>Elfenbeinküste - 445.664</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 270.877)</b>			
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031	234.506	0,84
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033	211.158	0,76

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Tschechische Republik - 287.058</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.250.000	Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030	48.860	0,18
6.350.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	238.198	0,85
<b>Dominikanische Republik - 173.250</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 249.752)</b>			
175.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041	173.250	0,62
<b>Ecuador - 341.135</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 281.083)</b>			
34.728	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	19.708	0,07
118.040	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040	69.423	0,25
257.556	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035	170.309	0,61
98.280	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.000% 31-Jul-2030	81.695	0,29
<b>Ägypten - 512.402</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 444.845)</b>			
300.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031	266.676	0,96
300.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	245.726	0,88
<b>El Salvador - 16.870</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 26.565)</b>			
28.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Jan-2027	16.870	0,06
<b>Ghana - 359.839</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 419.545)</b>			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	157.500	0,56
200.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	202.339	0,73
<b>Ungarn - 268.721</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 184.654)</b>			
45.000.000	Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033	111.905	0,40
37.000.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	101.952	0,36
22.000.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	54.864	0,20
<b>Indien - 203.940</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 214.441)</b>			
200.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	203.940	0,73
<b>Indonesien - 1.824.239</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.573.522)</b>			
250.000	Adaro Indonesia PT 'REGS' 4.250% 31-Oct-2024	255.937	0,92
2.294.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	164.011	0,59
5.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	414.440	1,48
1.100.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036	85.843	0,31
2.230.000.000	Indonesia Treasury Bond 9.000% 15-Mar-2029	181.255	0,65
200.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	198.535	0,71
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.000% 30-Jun-2030	198.787	0,71
290.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042	325.431	1,17
<b>Israel - 676.862</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 494.050)</b>			
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	196.924	0,71
280.000	ICL Group Ltd '144A' 6.375% 31-May-2038	361.200	1,29
115.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023	118.738	0,43

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Kasachstan - 433.870</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	233.625	0,84
200.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030	200.245	0,72
<b>Malaysia - 389.269</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 279.727)</b>			
350.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	83.666	0,30
450.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	110.337	0,40
415.000	Malaysia Government Bond 4.893% 08-Jun-2038	108.863	0,39
330.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	86.403	0,31
<b>Mexiko - 3.201.286</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.630.123)</b>			
178.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024	183.880	0,66
400.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	392.908	1,41
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	196.863	0,71
200.000	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV 'REGS' 4.875% 14-Jan-2048	202.374	0,72
3.500.000	Mexican Bonos 5.500% 04-Mar-2027	156.940	0,56
9.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	444.662	1,59
9.500.000	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	450.709	1,62
10.500.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	543.067	1,95
65.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	67.548	0,24
2.725.000	Petroleos Mexicanos 7.470% 12-Nov-2026	121.036	0,43
195.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	188.560	0,68
250.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.700% 16-Feb-2032	252.739	0,91
<b>Marokko - 189.453</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
200.000	OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	189.453	0,68
<b>Nigeria - 585.799</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 216.005)</b>			
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	200.149	0,72
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.875% 16-Feb-2032	197.650	0,71
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	188.000	0,67
<b>Oman - 215.745</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 206.930)</b>			
200.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6.000% 01-Aug-2029	215.745	0,77
<b>Peru - 445.694</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 616.987)</b>			
850.000	Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	220.323	0,79
100.000	Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	25.671	0,09
200.000	Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	199.700	0,72
<b>Katar - 297.930</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 202.975)</b>			
300.000	Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	297.930	1,07
<b>Republik Serbien - 104.397</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
100.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	104.397	0,38
<b>Rumänien - 24.086</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 54.423)</b>			
100.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	24.086	0,09
<b>Russland - 2.878.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.063.148)</b>			
200.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	189.450	0,68

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Russland Forts.</b>			
200.000	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	195.187	0,70
200.000	Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	194.940	0,70
16.100.000	Russian Federal Bond - OFZ 6.000% 06-Oct-2027	192.089	0,69
94.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	1.178.068	4,22
8.400.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030	108.019	0,39
44.473.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033	570.589	2,05
19.700.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 16-Mar-2039	249.658	0,89
<b>Senegal - 407.543</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 444.555)</b>			
395.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.250% 23-May-2033	407.543	1,46
<b>Südafrika - 2.080.836</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.619.200)</b>			
16.700.000	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	883.968	3,17
10.850.000	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	628.598	2,25
6.150.000	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	321.126	1,15
650.000	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	45.156	0,16
200.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	201.988	0,73
<b>Supranational - 505.743</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 721.857)</b>			
230.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.994% 21-Sep-2029	237.939	0,85
245.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4.700% 22-Oct-2031	267.804	0,96
<b>Tansania - 407.427</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	198.327	0,71
200.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	209.100	0,75
<b>Thailand - 736.008</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 980.268)</b>			
7.250.000	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	242.359	0,87
6.000.000	Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	207.155	0,74
7.900.000	Thailand Government Bond 4.875% 22-Jun-2029	286.494	1,03
<b>Türkei - 398.348</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 671.353)</b>			
200.000	Anadolu Efes Biraçılık Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028	194.970	0,70
200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	203.378	0,73
<b>Ukraine - 485.683</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 668.585)</b>			
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032	179.026	0,64
115.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 1.258% 31-May-2040	105.107	0,38
200.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6.200% 11-Feb-2025	201.550	0,72
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 897.272</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 493.043)</b>			
200.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	203.000	0,73
200.000	DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029	213.650	0,76
200.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037	263.904	0,95
200.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	216.718	0,78

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
	<b>Uruguay - 39.754</b>		
	<b>(31. Dezember 2020: 90.923)</b>	<b>39.754</b>	<b>0,14</b>
600.000	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	12.981	0,05
1.195.000	Uruguay Government International Bond 'REGS' 8.500% 15-Mar-2028	26.773	0,09
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>26.531.803</b>	<b>95,15</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 3.494</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(1)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(195.105)	3.494	0,01
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>3.494</b>	<b>0,01</b>

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 96.068 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 69.009)

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt** **26.631.365** **95,50**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (1.441)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (550))</b>				
(13)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.696.094)	(1.441)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(1.441)</b>	<b>(0,00)</b>

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (81.789) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (89.046))

**Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt** **(83.230)** **(0,29)**

**Nettoumlaufvermögen** **1.335.153** **4,79**

**Summe Nettovermögen** **27.883.288** **100,00**

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

**Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,44
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,01
OTC-Derivate	0,34
Sonstiges Umlaufvermögen	5,21
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>						
Ungarischer Forint	US-Dollar	24.910.000	78.378	3. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	395
Ungarischer Forint	US-Dollar	12.212.120	37.459	3. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	179
Brasilianischer Real	US-Dollar	90.000	16.128	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	30
Brasilianischer Real	US-Dollar	290.000	51.967	4. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	98
Brasilianischer Real	US-Dollar	2.230.000	395.537	4. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	4.822
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.850.000	331.512	4. Jan. 22	Goldman Sachs	625
US-Dollar	Hongkong-Dollar	988.043	7.660.000	10. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	5.672
Taiwan-Dollar	US-Dollar	1.840.000	66.402	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	101
US-Dollar	Taiwan-Dollar	45.754	1.250.000	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	575
US-Dollar	Taiwan-Dollar	557.759	15.330.000	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	3.684
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.850.000	323.404	3. Mrz. 22	Goldman Sachs	4.225
Chinesischer Yuan	US-Dollar	50.000	7.783	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	46
Ungarischer Forint	US-Dollar	24.910.000	75.997	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	229
Ungarischer Forint	US-Dollar	86.090.000	260.675	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	2.765
Ungarischer Forint	US-Dollar	86.360.000	263.228	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	1.038
Indische Rupie	US-Dollar	28.950.000	379.583	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	5.740
Indische Rupie	US-Dollar	2.720.000	35.714	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	489
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	2.920.000	688.517	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	11.639
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	390.000	92.340	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	1.174
Mexikanischer Peso	US-Dollar	1.030.000	48.862	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	818
Mexikanischer Peso	US-Dollar	14.500.000	681.239	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	18.138
Mexikanischer Peso	US-Dollar	330.000	15.839	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	78
Polnischer Zloty	US-Dollar	310.000	75.318	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	1.214
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.600.000	635.806	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	6.076
Polnischer Zloty	US-Dollar	3.880.000	948.022	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	9.862
Thailändischer Baht	US-Dollar	18.010.000	538.005	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	984
Thailändischer Baht	US-Dollar	2.140.000	63.359	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	685
Thailändischer Baht	US-Dollar	5.670.000	169.314	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	373
Türkische Lira	US-Dollar	330.000	22.763	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	709
US-Dollar	Chilianischer Peso	300.355	257.410.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	1.495
US-Dollar	Chinesischer Yuan	416.597	2.660.000	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	107
US-Dollar	Russischer Rubel	390.600	29.420.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	3.321
US-Dollar	Russischer Rubel	252.988	19.050.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	2.217
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	414.289	6.600.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	4.235
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	129.183	2.060.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	1.196
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	216.002	3.460.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	1.034
						<b>USD</b>
						<b>96.068</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

## Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Chilenischer Peso	195.561	170.860.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	(2.811)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	191.825	1.230.000	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	(762)
US-Dollar	Tschechische Krone	52.273	1.190.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.822)
US-Dollar	Ungarischer Forint	75.825	24.910.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	(401)
US-Dollar	Ungarischer Forint	371.76	12.210.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(187)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	206.317	2.994.070.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.688)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	46.956	990.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(795)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.024.370	22.110.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	(42.060)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	231.144	950.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(5.976)
US-Dollar	Polnischer Zloty	246.561	1.020.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(5.254)
US-Dollar	Rumänischer Leu	150.917	670.000	16. Mrz. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.187)
<b>USD</b>						<b>(81.789)</b>

# BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Irland - 4.014.000</b>				
	(31. Dezember 2020: 5.770.066)	4.014.000	3,19	
4.014.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	4.014.000	3,19	
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>4.014.000</b>	<b>3,19</b>	
<b>Anleihen</b>				
<b>Angola - 687.358</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.784.840)	687.358	0,55	
700.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 9.375% 08-May-2048	687.358	0,55	
<b>Argentinien - 2.633.357</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.669.204)	2.633.357	2,10	
800.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	282.008	0,22	
5.148.240	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035	1.653.924	1,32	
1.000.000	YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029	697.425	0,56	
<b>Bahamas - 1.247.076</b>				
	(31. Dezember 2020: 2.785.875)	1.247.076	0,99	
1.350.000	Bahamas Government International Bond 'REGS' 8.950% 15-Oct-2032	1.247.076	0,99	
<b>Belarus - 956.280</b>				
	(31. Dezember 2020: -)	956.280	0,76	
1.200.000	Republic of Belarus International Bond 'REGS' 6.200% 28-Feb-2030	956.280	0,76	
<b>Brasilien - 8.908.041</b>				
	(31. Dezember 2020: 15.398.092)	8.908.041	7,09	
1.010.000	Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026	926.463	0,74	
300.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	346.171	0,27	
35.000.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	6.195.099	4,93	
500.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	476.408	0,38	
1.020.000	Rumo Luxemburg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	963.900	0,77	
<b>Burkina Faso - 596.664</b>				
	(31. Dezember 2020: -)	596.664	0,47	
600.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	596.664	0,47	
<b>Chile - 7.701.352</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.554.201)	7.701.352	6,13	
1.200.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos 4.500% 01-Mar-2026	1.362.266	1,08	
1.100.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos '144A' 2.300% 01-Oct-2028	1.065.722	0,85	
1.350.000.000	Bonos de la Tesorería de la República en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	1.536.823	1,22	
540.000	CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031	509.625	0,41	
1.550.000	Chile Government International Bond 3.100% 22-Jan-2061	1.441.283	1,15	
730.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	718.419	0,57	
1.100.000	Sociedad Química y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	1.067.214	0,85	
<b>China - 5.475.441</b>				
	(31. Dezember 2020: 5.121.681)	5.475.441	4,36	
8.700.000	China Government Bond 3.020% 27-May-2031	1.387.289	1,10	
4.200.000	China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	699.540	0,56	
1.900.000	Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026	2.048.634	1,63	
650.000	Redsun Properties Group Ltd 7.300% 13-Jan-2025	275.178	0,22	
700.000	Shimao Group Holdings Ltd 3.450% 11-Jan-2031	419.300	0,33	
400.000	Sunac China Holdings Ltd 6.500% 26-Jan-2026	250.000	0,20	
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.000% 25-Oct-2023	125.000	0,10	
400.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 04-Feb-2023	134.000	0,11	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>China Forts.</b>				
200.000	Zhenro Properties Group Ltd 9.150% 06-May-2023	136.500	0,11	
<b>Kolumbien - 7.096.707</b>				
	(31. Dezember 2020: 7.649.530)	7.096.707	5,65	
1.092.000	Colombia Government International Bond 4.125% 22-Feb-2042	914.550	0,73	
1.600.000	Colombia Government International Bond 4.125% 15-May-2051	1.304.000	1,04	
8.035.100.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	1.787.575	1,42	
4.191.200.000	Colombian TES 7.250% 18-Oct-2034	945.449	0,75	
4.800.000.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	1.152.571	0,92	
400.000	GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	401.416	0,32	
605.000	Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027	591.146	0,47	
<b>Elfenbeinküste - 2.906.380</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.778.518)	2.906.380	2,31	
660.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	725.070	0,58	
1.250.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031	1.465.663	1,16	
600.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.875% 17-Oct-2040	715.647	0,57	
<b>Tschechische Republik - 431.381</b>				
	(31. Dezember 2020: -)	431.381	0,34	
11.500.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	431.381	0,34	
<b>Dominikanische Republik - 1.324.375</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.330.761)	1.324.375	1,05	
1.300.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	1.324.375	1,05	
<b>Ecuador - 1.492.114</b>				
	(31. Dezember 2020: 1.711.790)	1.492.114	1,19	
231.321	Ecuador Government International Bond '144A' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	131.275	0,11	
1.637.100	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 5.000% 31-Jul-2030	1.360.839	1,08	
<b>Ägypten - 8.998.338</b>				
	(31. Dezember 2020: 8.171.849)	8.998.338	7,16	
700.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033	646.506	0,52	
850.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	696.222	0,55	
700.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8.750% 30-Sep-2051	627.956	0,50	
2.500.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8.875% 29-May-2050	2.277.000	1,81	
26.000.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2022	1.649.698	1,31	
26.000.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 01-Mar-2022	1.630.300	1,30	
25.000.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 06-Sep-2022	1.470.656	1,17	
<b>El Salvador - 224.504</b>				
	(31. Dezember 2020: -)	224.504	0,18	
400.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.625% 01-Feb-2041	224.504	0,18	
<b>Ghana - 3.738.840</b>				
	(31. Dezember 2020: 2.156.396)	3.738.840	2,98	
800.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 6.375% 11-Feb-2027	677.156	0,54	
1.350.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.750% 07-Apr-2029	1.134.333	0,90	
700.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.125% 18-Jan-2026	648.375	0,52	
820.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034	668.903	0,53	
750.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.875% 07-May-2042	610.073	0,49	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Ungarn - 623.455</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
250.000.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	623.455	0,50
<b>Indien - 1.500.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.500.000	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.700% 25-Aug-2026	1.500.000	1,19
<b>Indonesien - 3.519.028</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.365.608)</b>			
1.200.000	Indonesia Government International Bond 3.050% 12-Mar-2051	1.187.412	0,95
10.148.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-May-2038	743.339	0,59
1.600.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	1.588.277	1,26
<b>Kasachstan - 485.905</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 490.753)</b>			
210.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8.950% 04-May-2023	485.905	0,39
<b>Libanon - 188.676</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 250.496)</b>			
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.200% 17-May-2033	41.360	0,03
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034	41.416	0,03
600.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.000% 20-Mar-2028	63.420	0,05
400.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.150% 20-Nov-2031	42.480	0,04
<b>Macau - 694.124</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.926.828)</b>			
700.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027	694.124	0,55
<b>Malaysia - 1.638.184</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.032.922)</b>			
4.075.000	Malaysia Government Bond 2.632% 15-Apr-2031	904.353	0,72
3.200.000	Malaysia Government Bond 3.757% 22-May-2040	733.831	0,58
<b>Mexiko - 10.054.509</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.434.381)</b>			
590.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	593.180	0,47
1.000.000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028	601.430	0,48
138.307.300	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	6.372.951	5,07
20.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	988.137	0,79
1.550.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	1.498.811	1,19
<b>Moldawien - 1.440.096</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.421.875)</b>			
1.400.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	1.440.096	1,15
<b>Nigeria - 2.016.084</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.767.533)</b>			
700.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	700.522	0,56
1.250.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.747% 21-Jan-2031	1.315.562	1,04
<b>Pakistan - 348.381</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
350.000	Pakistan Government International Bond 'REGS' 7.375% 08-Apr-2031	348.381	0,28
<b>Panama - 1.986.469</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.182.623)</b>			
1.300.000	Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027	1.324.063	1,05
600.000	Panama Government International Bond 4.500% 16-Apr-2050	662.406	0,53

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Peru - 3.146.775</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 791.154)</b>			
1.003.000	Peruvian Government International Bond 1.950% 17-Nov-2036	1.128.151	0,90
3.400.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031	914.353	0,73
700.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 5.625% 19-Jun-2047	694.246	0,55
420.000	Volcan Cia Minera SAA 'REGS' 4.375% 11-Feb-2026	410.025	0,32
<b>Republik Serbien - 1.148.368</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.100.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	1.148.368	0,91
<b>Rumänien - 3.790.474</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.540.818)</b>			
590.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	628.050	0,50
1.900.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.750% 14-Apr-2041	1.935.664	1,54
1.200.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.875% 13-Apr-2042	1.226.760	0,98
<b>Rusland - 9.855.452</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.244.824)</b>			
1.450.000	Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	1.373.513	1,09
2.550.000	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	2.488.634	1,98
610.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 6.100% 18-Jul-2035	671.491	0,53
213.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026	2.783.626	2,22
193.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026	2.538.188	2,02
<b>Südafrika - 7.379.219</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.382.084)</b>			
17.300.000	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	1.002.282	0,80
24.000.000	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	1.352.476	1,07
72.325.032	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	5.024.461	4,00
<b>Thailand - 1.349.658</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.953.530)</b>			
44.500.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	1.349.658	1,07
<b>Tunesien - 1.200.763</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.634.874)</b>			
1.350.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 5.625% 17-Feb-2024	1.200.763	0,96
<b>Türkei - 2.993.019</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.556.262)</b>			
900.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	736.713	0,59
1.000.000	Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 6.375% 09-Dec-2025	911.750	0,72
1.450.000	Limak Iskenderun Uluslararası Liman Isletmeciligi AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036	1.344.556	1,07
<b>Ukraine - 5.205.081</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.395.457)</b>			
900.000	NPC Ukrenergo 'REGS' 6.875% 09-Nov-2026	790.939	0,63
618.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.253% 15-Mar-2033	547.554	0,44
900.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032	805.617	0,64
600.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2022	596.106	0,47
1.900.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2027	1.808.321	1,44
700.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026	656.544	0,52
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>114.981.928</b>	<b>91,49</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 120.229</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 39.729)</b>				
(12)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.824.484)	120.213	0,10
(57)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(6.895.664)	16	0,00
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>120.229</b>	<b>0,10</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.094.578 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 3.960.505)				
			2.094.578	1,67
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>121.210.735</b>	<b>96,45</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps - (35.277)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
4.300.000	CDS United Mexican States 1.000% 20-Jun-2026		(35.277)	(0,03)
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>			<b>(35.277)</b>	<b>(0,03)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (70.322)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(59)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(7.697.656)	(64.172)	(0,05)
(3)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(591.375)	(6.150)	(0,01)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(70.322)</b>	<b>(0,06)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (388.669) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.854.632))				
			(388.669)	(0,31)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(494.268)</b>	<b>(0,40)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>4.960.858</b>	<b>3,95</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>125.677.325</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.  
Der Kontrahent für Total Return Swaps ist die Bank of America Merrill Lynch.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,17
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,10
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,66
Sonstiges Umlaufvermögen	4,07
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>							
US-Dollar	Chilenischer Peso	1.691.420	1.430.000.000	12. Jan. 22	BNP Paribas	14.907	
US-Dollar	Chilenischer Peso	1.525.228	1.213.700.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	102.302	
US-Dollar	Brasilianischer Real	2.200.000	386.068	2. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	6.122	
US-Dollar	Brasilianischer Real	4.300.000	753.846	2. Feb. 22	UBS AG	12.707	
US-Dollar	Indonesische Rupie	38.000.000	500.625	9. Feb. 22	BNP Paribas	7.459	
US-Dollar	Indonesische Rupie	103.500.000	1.378.401	9. Feb. 22	Morgan Stanley	5.459	
US-Dollar	Indonesische Rupie	18.154.263.000	1.262.115	9. Feb. 22	Morgan Stanley	12.260	
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	7.950.000	1.904.785	9. Feb. 22	Morgan Stanley	4.048	
US-Dollar	Russischer Rubel	28.000.000	370.847	9. Feb. 22	UBS AG	627	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	2.343.631	9.143.675.000	9. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	104.518	
US-Dollar	Russischer Rubel	553.984	40.055.000	9. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	22.578	
US-Dollar	Russischer Rubel	1.281.862	95.800.000	9. Feb. 22	UBS AG	10.891	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	18.400.000	2.866.463	14. Feb. 22	Morgan Stanley	19.793	
US-Dollar	Tschechische Krone	98.000	4.426	14. Feb. 22	BNP Paribas	42	
US-Dollar	Euro	600.000	674.437	14. Feb. 22	Morgan Stanley	9.228	
US-Dollar	Euro	400.000	453.140	14. Feb. 22	HSBC Bank plc	2.637	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	8.342.000	388.215	14. Feb. 22	BNP Paribas	16.321	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	14.044.000	662.626	14. Feb. 22	Morgan Stanley	18.423	
US-Dollar	Polnischer Zloty	20.120.000	4.943.891	14. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	35.206	
US-Dollar	Thailändischer Baht	21.000.000	619.317	14. Feb. 22	Morgan Stanley	9.179	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.439.526	22.800.000	14. Feb. 22	UBS AG	17.042	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.060.362	16.347.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	40.478	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.735.961	26.664.000	14. Feb. 22	Barclays Bank PLC	72.403	
						<b>USD</b>	<b>544.630</b>
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.975.678	22.588.612	2. Feb. 22	HSBC Bank plc	(51.152)	
US-Dollar	Russischer Rubel	28.000.000	374.327	9. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(2.853)	
US-Dollar	Indonesische Rupie	391.936	5.650.000.000	9. Feb. 22	HSBC Bank plc	(4.677)	
US-Dollar	Ungarischer Forint	553.823.000	1.723.914	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(23.702)	
US-Dollar	Ungarischer Forint	410.000.000	1.261.693	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(3.011)	
US-Dollar	Rumänischer Leu	6.236.000	1.432.250	14. Feb. 22	Goldman Sachs	(2.877)	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	3.797.000	237.054	14. Feb. 22	UBS AG	(161)	
US-Dollar	Thailändischer Baht	150.143.000	4.590.266	14. Feb. 22	Goldman Sachs	(96.725)	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	937.898	6.000.000	14. Feb. 22	BNP Paribas	(3.273)	
US-Dollar	Tschechische Krone	428.946	9.651.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(11.053)	
US-Dollar	Euro	13.081.079	11.528.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(54.412)	
US-Dollar	Ungarischer Forint	639.241	209.493.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(3.893)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	3.149.590	65.629.000	14. Feb. 22	BNP Paribas	(33.019)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	955.082	20.612.000	14. Feb. 22	BNP Paribas	(44.475)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	611.494	2.500.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(7.181)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	1.265.408	5.200.000	14. Feb. 22	Morgan Stanley	(21.436)	
US-Dollar	Thailändischer Baht	772.109	26.000.000	14. Feb. 22	Goldman Sachs	(6.029)	
						<b>USD</b>	<b>(369.929)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	70	80	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	13.602	15.393	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	96	
						<b>USD</b>	<b>96</b>
						<b>EUR</b>	<b>84</b>
US-Dollar	Euro	102	90	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
------	---------	---------------	---------------	-----------------------	------------	---

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	84	75	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
					<b>USD</b>	<b>(2)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(2)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	37	41	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	6.907	7.817	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	49
US-Dollar	Euro	51	45	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	42	38	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
					<b>USD</b>	<b>49</b>
					<b>EUR</b>	<b>43</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	266.207	359.752	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	564
Pfund Sterling	US-Dollar	47.505.706	62.758.416	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.541.393
					<b>USD</b>	<b>1.541.957</b>
					<b>GBP</b>	<b>1.139.195</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	468	350	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Pfund Sterling	413.298	312.055	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9.074)
US-Dollar	Pfund Sterling	46.884	35.173	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(724)
US-Dollar	Pfund Sterling	335.048	253.323	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7.829)
US-Dollar	Pfund Sterling	50.858	38.306	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(990)
					<b>USD</b>	<b>(18.623)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(13.759)</b>

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	286	384	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	1.329	1.796	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	241.592	319.160	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.839
Pfund Sterling	US-Dollar	5	7	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	13	17	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	34	25	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
					<b>USD</b>	<b>7.846</b>
					<b>GBP</b>	<b>5.797</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	384	286	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.101	1.587	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(46)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.703	1.287	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(40)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.325	998	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(26)
					<b>USD</b>	<b>(115)</b>
					<b>GBP</b>	<b>(85)</b>



# BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Irland - 2.426.564</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.230.642)</b>			
2.759.885	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund ^	2.426.564	0,88
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>2.426.564</b>	<b>0,88</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Österreich - 9.753.280</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
7.150.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0,000% 20-Feb-2031	7.103.704	2,57
2.575.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0,750% 20-Mar-2051	2.649.576	0,96
<b>Belgien - 26.211.157</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.523.029)</b>			
4.000.000	Communaute Francaise de Belgique 'EMTN' 0,000% 22-Jun-2029	3.958.316	1,43
3.300.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,000% 22-Oct-2031	3.241.425	1,18
1.500.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,400% 22-Jun-2040	1.426.545	0,52
16.550.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1,000% 22-Jun-2026	17.584.871	6,37
<b>Brasilien - 1.172.615</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 772.106)</b>			
475.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5,875% 31-Jan-2050	481.427	0,17
550.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3,950% 29-Jan-2031	462.140	0,17
225.000	Vale Overseas Ltd 6,250% 10-Aug-2026	229.048	0,08
<b>Chile - 326.591</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 392.886)</b>			
364.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125% 15-Jan-2028	326.591	0,12
<b>China - 4.302.060</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.965.184)</b>			
27.800.000	China Government Bond 3,810% 14-Sep-2050	4.107.121	1,49
225.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2,300% 08-Jan-2031	194.939	0,07
<b>Kolumbien - 736.758</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 221.268)</b>			
625.000	Ecopetrol SA 5,875% 02-Nov-2051	515.189	0,19
250.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4,500% 27-Apr-2031	221.569	0,08
<b>Elfenbeinküste - 482.472</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.132.596)</b>			
500.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4,875% 30-Jan-2032	482.472	0,17
<b>Ägypten - 352.883</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.111.352)</b>			
435.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,300% 30-Sep-2033	352.883	0,13
<b>Estland - 1.502.350</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.546.751)</b>			
1.500.000	Estonia Government International Bond 0,125% 10-Jun-2030	1.502.350	0,54
<b>Frankreich - 41.575.704</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 62.219.065)</b>			
9.000.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0,000% 28-Oct-2027	9.033.519	3,27
900.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375% 09-Jun-2040	1.011.489	0,37
1.210.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 08-Oct-2025	1.349.052	0,49
1.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,000% 25-Nov-2030	1.367.260	0,50
600.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,750% 05-Mar-2029	646.074	0,23

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Frankreich Forts.</b>			
1.400.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2,625% 01-Dec-2027	1.414.000	0,51
1.300.000	Engie SA 'EMTN' 1,750% 27-Mar-2028	1.404.127	0,51
6.950.000	French Republic Government Bond OAT 0,000% 25-Nov-2031	6.813.380	2,47
1.965.000	French Republic Government Bond OAT 1,000% 25-May-2027	2.102.015	0,76
2.625.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 0,500% 25-May-2040	2.567.705	0,93
2.175.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 1,500% 25-May-2050	2.522.625	0,91
1.750.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 2,000% 25-May-2048	2.250.140	0,82
800.000	Orange SA 'EMTN' 0,000% 04-Sep-2026	792.732	0,29
300.000	Orano SA 'EMTN' 2,750% 08-Mar-2028	313.125	0,11
200.000	Orano SA 'EMTN' 4,875% 23-Sep-2024	221.830	0,08
800.000	Sanofi 'EMTN' 1,000% 01-Apr-2025	827.123	0,30
700.000	Sanofi 'EMTN' 1,500% 01-Apr-2030	762.534	0,28
4.600.000	Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN' 1,700% 25-May-2050	5.332.688	1,93
800.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 1,250% 15-Apr-2028	844.286	0,31
<b>Deutschland - 24.310.467</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 114.823.425)</b>			
1.200.000	Allianz SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 4,750% 24-Oct-2023	1.296.729	0,47
6.200.000	Bundesobligation 0,000% 09-Oct-2026	6.336.772	2,30
5.250.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,000% 15-May-2036	5.242.755	1,90
2.025.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,750% 04-Jul-2028	2.722.046	0,99
3.700.000	Bundesschatzanweisungen 0,000% 15-Dec-2023	3.744.844	1,36
1.350.000	Daimler AG 'EMTN' 1,000% 15-Nov-2027	1.413.738	0,51
1.870.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0,375% 23-Apr-2030	1.921.785	0,70
1.200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0,250% 20-Feb-2029	1.202.274	0,43
400.000	Volkswagen International Finance NV 1,875% 30-Mar-2027	429.524	0,15
<b>Ungarn - 514.742</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.008.296)</b>			
490.000	Hungary Government International Bond 1,625% 28-Apr-2032	514.742	0,19
<b>Indonesien - 767.344</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.347.064)</b>			
800.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 1,875% 05-Nov-2031	767.344	0,28
<b>Irland - 11.809.854</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.278.724)</b>			
1.530.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3,000% 29-Oct-2028	1.365.090	0,49
5.675.000	Ireland Government Bond 0,200% 18-Oct-2030	5.712.171	2,07
3.955.000	Ireland Government Bond 2,400% 15-May-2030	4.732.593	1,72
<b>Italien - 35.165.976</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 36.027.994)</b>			
750.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN 5,500% 27-Oct-2047	913.102	0,33
1.225.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0,375% 17-Jun-2027	1.221.290	0,44
8.850.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000% 01-Aug-2026	8.682.580	3,14
5.450.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950% 15-Mar-2023	5.538.331	2,01
7.030.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0,950% 01-Dec-2031	6.891.087	2,50
6.275.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,650% 01-Dec-2030	6.601.436	2,39
1.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,800% 01-Mar-2067	2.151.218	0,78

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Italien Forts.</b>			
2.375.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4,000% 01-Feb-2037	3.166.932	1,15
<b>Japan - 417.261</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 438.583)</b>		<b>417.261</b>	<b>0,15</b>
385.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,000% 09-Jul-2040	417.261	0,15
<b>Kasachstan - 315.069</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 301.682)</b>		<b>315.069</b>	<b>0,11</b>
350.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 4,125% 10-Dec-2022	315.069	0,11
<b>Kuwait - 462.862</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>462.862</b>	<b>0,17</b>
525.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 2,625% 28-Apr-2028	462.862	0,17
<b>Luxemburg - 1.399.391</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.036.585)</b>		<b>1.399.391</b>	<b>0,51</b>
875.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1,750% 15-Mar-2028	940.174	0,34
458.443	Silver Arrow SA '2020-1FR A' FRN 0,107% 20-Nov-2030	459.217	0,17
<b>Mexiko - 7.714.238</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.276.674)</b>		<b>7.714.238</b>	<b>2,80</b>
1.675.000	Alsea SAB de CV 'REGS' 7,750% 14-Dec-2026	1.527.044	0,55
300.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6,990% 20-Feb-2032	264.925	0,10
116.000.000	Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031	5.033.984	1,83
975.000	Petroleos Mexicanos 6,840% 23-Jan-2030	888.285	0,32
<b>Niederlande - 19.608.049</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 24.340.590)</b>		<b>19.608.049</b>	<b>7,11</b>
800.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 2,875% 18-Jan-2028	822.531	0,30
700.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 3,000% 11-Apr-2028	725.485	0,26
600.000	ING Groep NV FRN 2,000% 22-Mar-2030	625.284	0,23
4.530.000	Netherlands Government Bond '144A' 0,000% 15-Jul-2031	4.544.541	1,65
2.425.000	Netherlands Government Bond '144A' 0,750% 15-Jul-2027	2.576.077	0,93
9.675.000	Netherlands Government Bond '144A' 2,000% 15-Jul-2024	10.314.131	3,74
<b>Norwegen - 17.817.072</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 410.134)</b>		<b>17.817.072</b>	<b>6,46</b>
450.000	Equinor ASA 3,250% 18-Nov-2049	421.363	0,15
175.000.000	Norway Government Bond '144A' 1,500% 19-Feb-2026	17.395.709	6,31
<b>Katar - 1.046.744</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>1.046.744</b>	<b>0,38</b>
1.200.000	Qatar Energy 'REGS' 2,250% 12-Jul-2031	1.046.744	0,38
<b>Republik Serbien - 962.819</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.860.674)</b>		<b>962.819</b>	<b>0,35</b>
1.050.000	Serbia International Bond 'REGS' 2,050% 23-Sep-2036	962.819	0,35
<b>Rumänien - 1.022.439</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.857.843)</b>		<b>1.022.439</b>	<b>0,37</b>
475.000	Romanian Government International Bond 'EMTN' 2,875% 11-Mar-2029	505.999	0,18
475.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3,624% 26-May-2030	516.440	0,19
<b>Russland - 1.480.784</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.299.048)</b>		<b>1.480.784</b>	<b>0,54</b>
131.100.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,650% 10-Apr-2030	1.480.784	0,54
<b>Spanien - 14.827.911</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 24.634.995)</b>		<b>14.827.911</b>	<b>5,37</b>
400.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0,550% 30-Apr-2030	403.254	0,15

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Spanien Forts.</b>			
1.300.000	Banco Santander SA 'EMTN' 2,500% 18-Mar-2025	1.383.819	0,50
900.000	Iberdrola International BV 'EMTN' 3,000% 31-Jan-2022	902.151	0,33
1.000.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4,000% 18-Sep-2027	1.018.989	0,37
1.200.000	Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625% 15-Apr-2030	1.392.711	0,50
3.800.000	Spain Government Bond '144A' 0,500% 31-Oct-2031	3.777.189	1,37
2.550.000	Spain Government Bond '144A' 1,200% 31-Oct-2040	2.574.148	0,93
2.500.000	Spain Government Bond '144A' 2,900% 31-Oct-2046	3.375.650	1,22
<b>Supranational - 2.778.557</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.223.728)</b>		<b>2.778.557</b>	<b>1,01</b>
725.000	Africa Finance Corp 'REGS' 2,875% 28-Apr-2028	633.141	0,23
475.000	African Export-Import Bank/The 'EMTN' 5,250% 11-Oct-2023	443.788	0,16
500.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2,750% 22-Jan-2033	527.307	0,19
470.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5,000% 27-Jul-2027	457.111	0,17
750.000	European Union 0,000% 04-Jul-2035	717.210	0,26
<b>Schweiz - 688.720</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 50.446)</b>		<b>688.720</b>	<b>0,25</b>
700.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0,250% 05-Nov-2028	688.720	0,25
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 480.644</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 693.404)</b>		<b>480.644</b>	<b>0,17</b>
505.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000% 01-Oct-2025	480.644	0,17
<b>Vereinigtes Königreich - 6.405.974</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.719.657)</b>		<b>6.405.974</b>	<b>2,32</b>
685.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 2,000% 07-Feb-2028	697.684	0,25
800.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN' 1,231% 08-May-2031	828.782	0,30
550.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3,625% 22-Mar-2029	592.500	0,21
460.198	Brass No 10 Plc FRN 0,669% 16-Apr-2069	402.387	0,15
725.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3,000% 27-Sep-2026	711.413	0,26
675.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1,125% 17-Oct-2028	685.720	0,25
1.450.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1,750% 03-Jun-2027	1.428.148	0,52
960.000	Unilever Finance Netherlands BV 1,750% 25-Mar-2030	1.059.340	0,38
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 30.849.394</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 43.535.537)</b>		<b>30.849.394</b>	<b>11,18</b>
675.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0,500% 05-May-2028	682.564	0,25
525.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0,800% 05-May-2032	529.642	0,19
925.000	Ally Financial Inc 5,750% 20-Nov-2025	917.581	0,33
415.000	AT&T Inc 1,800% 14-Sep-2039	417.733	0,15
1.095.000	Berkshire Hathaway Inc 0,000% 12-Mar-2025	1.093.956	0,40
750.000	Berry Global Inc 1,570% 15-Jan-2026	645.355	0,23
955.000	Capital One Financial Corp FRN 2,359% 29-Jul-2032	795.937	0,29
500.000	Carrier Global Corp 2,722% 15-Feb-2030	449.424	0,16
430.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS' 4,500% 15-Aug-2030	387.221	0,14
400.000	Centene Corp 3,375% 15-Feb-2030	359.025	0,13
130.000	Centene Corp 3,375% 15-Feb-2030	116.683	0,04
545.000	CGDB Commercial Mortgage Trust 2019-MOB '2019-MOBX A' FRN 1,060% 15-Nov-2036	478.004	0,17
475.000	Cheniere Energy Inc 4,625% 15-Oct-2028	441.883	0,16
1.025.000	Cheniere Energy Partners LP 4,000% 01-Mar-2031	946.614	0,34
475.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4,750% 01-Feb-2026	428.194	0,16

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
400.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 1.450% 22-Jan-2027	409.274	0,15
325.000	Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030	372.641	0,13
425.000	DaVita Inc 'REGS' 3.750% 15-Feb-2031	363.499	0,13
675.000	Digital Dutch Finco BV 1.500% 15-Mar-2030	701.674	0,25
350.000	Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028	357.034	0,13
725.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	663.476	0,24
975.000	EQT Corp 'REGS' 3.125% 15-May-2026	880.167	0,32
570.000	Equinix Inc 1.000% 15-Sep-2025	486.275	0,18
650.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	680.339	0,25
530.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	477.628	0,17
455.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026	445.556	0,16
371.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	345.053	0,13
460.000	Healthcare Trust of America Holdings LP 3.500% 01-Aug-2026	431.467	0,16
575.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2032	503.234	0,18
650.000	JBS Finance Luxembourg Sarl 'REGS' 3.625% 15-Jan-2032	574.061	0,21
660.000	JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 5.000% 01-Aug-2024	596.014	0,22
465.000	Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027	463.215	0,17
1.050.000	Level 3 Financing Inc 'REGS' 4.250% 01-Jul-2028	914.537	0,33
395.000	Marsh & McLennan Cos Inc 1.979% 21-Mar-2030	432.673	0,16
525.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032	526.094	0,19
499.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 'REGS' 3.875% 15-Feb-2029	460.839	0,17
1.400.000	Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033	1.402.249	0,51
1.400.000	Mozart Debt Merger Sub Inc 'REGS' 3.875% 01-Apr-2029	1.227.806	0,44
625.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026	621.159	0,23
425.000	Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030	504.594	0,18
1.000.000	PepsiCo Inc 1.050% 09-Oct-2050	979.526	0,35
535.000	Pioneer Natural Resources Co 1.900% 15-Aug-2030	445.952	0,16
540.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc 'REGS' 3.625% 01-Mar-2029	476.767	0,17
350.000	SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025	321.580	0,12
700.000	Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081	680.050	0,25
264.063	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20-Mar-2025	242.959	0,09
725.000	Stellantis Finance US Inc 'REGS' 2.691% 15-Sep-2031	627.628	0,23
1.025.000	Taylor Morrison Communities Inc 'REGS' 5.125% 01-Aug-2030	991.463	0,36
100.000	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	92.598	0,03
400.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	361.505	0,13
536.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 3.500% 15-Feb-2025	478.353	0,17
370.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030	358.464	0,13
1.350.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	1.262.175	0,46
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>267.262.181</b>	<b>96,86</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 411.469 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 596.945)		411.469	0,15
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>270.100.214</b>	<b>97,89</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (261.581)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 342.675)</b>				
39	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022	5.196.360	(38.653)	(0,01)
3	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	514.110	(9.063)	(0,00)
11	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.274.140	(113.532)	(0,04)
25	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.800.750	(4.402)	(0,00)
(232)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(26.586.496)	(79.990)	(0,03)
(16)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.254.719)	(15.941)	(0,01)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(261.581)</b>	<b>(0,09)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (267.752) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (633.155))			(267.752)	(0,10)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(529.333)</b>	<b>(0,19)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>6.351.292</b>	<b>2,30</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>275.922.173</b>	<b>100,00</b>
^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.				
<b>Portfolioanalyse</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			95,94	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,15	
Sonstiges Umlaufvermögen			3,91	
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

<b>Devisenterminkontrakte</b>						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>						
Euro	US-Dollar	10.000.000	11.323.600	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	62.527
Euro	US-Dollar	33.019.534	37.390.000	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	206.460
Ungarischer Forint	US-Dollar	261.560.000	797.901	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	2.180
Indische Rupie	US-Dollar	95.540.000	1.253.296	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	16.080
Mexikanischer Peso	Euro	2.516.466	105.799	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	656
US-Dollar	Chinesischer Yuan	2.035.699	13.000.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	196
US-Dollar	Chinesischer Yuan	2.624.873	16.760.000	16. Mrz. 22	HSBC Bank plc	592
US-Dollar	Russischer Rubel	1.792.353	135.000.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	13.365
US-Dollar	Taiwan-Dollar	1.303.463	35.870.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	6.098
<b>EUR</b>						<b>308.154</b>
Euro	Norwegische Krone	182.454	1.840.000	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(762)
Euro	Norwegische Krone	17.505.210	176.540.000	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(73.576)
Euro	Pfund Sterling	142.115	120.000	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(407)
Euro	Schwedische Krone	697.256	7.180.000	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(292)
Euro	Mexikanischer Peso	5.082.366	123.976.466	16. Mrz. 22	Goldman Sachs	(162.310)
US-Dollar	Ungarischer Forint	797.439	261.560.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	(2.586)
US-Dollar	Indische Rupie	1.732.649	132.513.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited	(27.266)
<b>EUR</b>						<b>(267.199)</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Hedged)</b>						
Euro	Schweizer Franken	24.869	25.756	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40
Schweizer Franken	Euro	17.517	16.833	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	54
Schweizer Franken	Euro	3.482.079	3.330.539	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	26.189
<b>EUR</b>						<b>26.283</b>
<b>CHF</b>						<b>27.266</b>
Euro	Schweizer Franken	14.721	15.334	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(61)
Euro	Schweizer Franken	23.877	24.900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(126)
<b>EUR</b>						<b>(187)</b>
<b>CHF</b>						<b>(194)</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Hedged)</b>						
Euro	Schweizer Franken	72.153	74.727	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	115
Schweizer Franken	Euro	52.042	50.009	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	160
Schweizer Franken	Euro	10.205.743	9.761.590	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	76.757
<b>EUR</b>						<b>77.032</b>
<b>CHF</b>						<b>79.913</b>
Euro	Schweizer Franken	69.055	72.013	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(366)
<b>EUR</b>						<b>(366)</b>
<b>CHF</b>						<b>(380)</b>

# BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Irland - 1.473.494</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.007.896)</b>			
2.562	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund ^	432.807	1,06
919.805	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund ^	1.040.687	2,56
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>1.473.494</b>	<b>3,62</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 401.020</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 709.814)</b>			
200.000	Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.250% 01-Mar-2033	191.675	0,47
200.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028	209.345	0,51
<b>Österreich - 201.127</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
100.000	JAB Holdings BV 1.000% 14-Jul-2031	97.137	0,24
100.000	JAB Holdings BV 2.250% 19-Dec-2039	103.990	0,25
<b>Bermudas - 103.425</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 216.720)</b>			
100.000	PartnerRe Ireland Finance DAC 1.250% 15-Sep-2026	103.425	0,25
<b>Zypern - 175.999</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
170.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	175.999	0,43
<b>Finnland - 238.887</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 411.427)</b>			
228.000	Sampo Oyj 'EMTN' FRN 2.500% 03-Sep-2052	238.887	0,59
<b>Frankreich - 5.466.921</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.649.987)</b>			
200.000	Aeroports de Paris 1.000% 05-Jan-2029	205.633	0,50
100.000	Aeroports de Paris 1.500% 02-Jul-2032	105.264	0,26
100.000	Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040	112.388	0,28
100.000	APRR SA 'EMTN' 1.250% 18-Jan-2028	105.728	0,26
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.100% 08-Oct-2027	98.318	0,24
500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.250% 13-Apr-2037	494.641	1,21
200.000	BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	199.756	0,49
200.000	BPCE SA 0.250% 14-Jan-2031	191.246	0,47
200.000	BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042	198.820	0,49
200.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.375% 20-Apr-2028	196.979	0,48
100.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.875% 20-Dec-2026	107.563	0,26
300.000	Dassault Systemes SE 0.125% 16-Sep-2026	299.820	0,74
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2033	99.272	0,24
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049	106.476	0,26
200.000	Engie SA 'EMTN' 0.500% 24-Oct-2030	198.171	0,49
100.000	Iliad SA 1.875% 11-Feb-2028	95.344	0,23
200.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Aug-2032	193.755	0,48
100.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031	98.895	0,24
200.000	MMS USA Holdings Inc 0.625% 13-Jun-2025	202.332	0,50
100.000	Orange SA 1.200% 11-Jul-2034	103.211	0,25
100.000	Orange SA 'EMTN' 0.625% 16-Dec-2033	97.418	0,24
200.000	RCI Banque SA 'EMTN' 2.000% 11-Jul-2024	208.237	0,51
200.000	Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027	199.500	0,49
100.000	TDF Infrastructure SASU 2.500% 07-Apr-2026	106.365	0,26
200.000	Thales SA 'EMTN' 0.000% 26-Mar-2026	197.664	0,49
200.000	Thales SA 'EMTN' 0.750% 23-Jan-2025	203.742	0,50
110.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.369% 06-Oct-2026	120.018	0,29
122.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 18-May-2022	123.781	0,30

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Frankreich Forts.</b>			
362.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030	357.565	0,88
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	100.488	0,25
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.750% 25-Oct-2028	100.131	0,25
230.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.125% 28-Apr-2027	238.400	0,59
<b>Deutschland - 3.992.547</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.653.376)</b>			
300.000	Bayer AG 0.375% 06-Jul-2024	303.072	0,74
96.000	Daimler AG 'EMTN' 1.125% 06-Nov-2031	100.676	0,25
300.000	Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032	299.685	0,73
300.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 0.500% 05-Jul-2027	305.361	0,75
128.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31-Mar-2028	131.952	0,32
200.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2026	210.728	0,52
200.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029	213.251	0,52
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032	109.123	0,27
100.000	Mahle GmbH 'EMTN' 2.375% 14-May-2028	97.234	0,24
200.000	Merck KGaA FRN 2.875% 25-Jun-2079	216.144	0,53
292.000	Roadster Finance DAC 'EMTN' 1.625% 09-Dec-2024	299.992	0,74
86.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 1.750% 28-Feb-2039	99.307	0,24
400.000	Vantage Towers AG 'EMTN' 0.000% 31-Mar-2025	396.074	0,97
248.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0.125% 12-Feb-2027	242.785	0,60
100.000	Volkswagen International Finance NV 4.125% 16-Nov-2038	138.810	0,34
100.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 14-Jun-2027	108.870	0,27
100.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029	109.250	0,27
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.625% 07-Oct-2027	100.158	0,25
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.750% 22-Mar-2038	115.595	0,28
100.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	96.855	0,24
200.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	194.820	0,48
100.000	Wintershall Dea Finance BV 1.823% 25-Sep-2031	102.805	0,25
<b>Hongkong - 100.856</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
102.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	100.856	0,25
<b>Irland - 1.669.132</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 875.262)</b>			
200.000	AIB Group Plc 'EMTN' 1.250% 28-May-2024	205.640	0,51
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031	105.555	0,26
200.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	197.840	0,49
200.000	Dell Bank International DAC 1.625% 24-Jun-2024	207.010	0,51
238.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	236.841	0,58
406.569	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058	404.385	0,99
100.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	101.663	0,25
110.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	111.900	0,27
100.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029	98.298	0,24
<b>Italien - 1.611.111</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.249.790)</b>			
100.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN 5.000% 08-Jun-2048	119.943	0,29
140.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025	155.820	0,38
129.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	128.529	0,32
130.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024	129.791	0,32

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Italien Forts.</b>			
230.000	Iccrea Banca SpA FRN 2.125% 17-Jan-2027	228.110	0,56
150.000	Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13-Sep-2023	165.288	0,41
200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024	203.374	0,50
162.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	161.860	0,40
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026	103.273	0,25
100.000	UniCredit SpA 'EMTN' 6.950% 31-Oct-2022	106.003	0,26
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024	109.120	0,27
<b>Japan - 517.799</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 589.822)</b>		<b>517.799</b>	<b>1,27</b>
200.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.541% 23-Oct-2028	199.496	0,49
192.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032	199.517	0,49
100.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	118.786	0,29
<b>Luxemburg - 841.784</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.867.202)</b>		<b>841.784</b>	<b>2,07</b>
306.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2023	307.715	0,75
255.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.750% 12-Mar-2029	259.723	0,64
168.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	173.965	0,43
100.000	SES SA 'EMTN' 0.875% 04-Nov-2027	100.381	0,25
<b>Niederlande - 1.766.238</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 715.328)</b>		<b>1.766.238</b>	<b>4,34</b>
235.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	234.882	0,58
100.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032	100.325	0,25
159.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	157.718	0,39
406.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.125% 13-Sep-2023	407.297	1,00
146.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	144.974	0,36
290.000	Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 9.000% 29-Aug-2042	307.110	0,75
100.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	99.836	0,24
163.000	Viterra Finance BV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2025	161.948	0,40
150.000	WP/AP Telecom Holdings IV BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	152.148	0,37
<b>Neuseeland - 172.215</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>172.215</b>	<b>0,42</b>
174.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London 'EMTN' 0.200% 23-Sep-2027	172.215	0,42
<b>Polen - 98.352</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>98.352</b>	<b>0,24</b>
100.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	98.352	0,24
<b>Portugal - 214.956</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>214.956</b>	<b>0,53</b>
200.000	Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031	214.956	0,53
<b>Slowakei - 119.214</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 124.583)</b>		<b>119.214</b>	<b>0,29</b>
113.000	Zapadoslovenska Energetika AS 1.750% 02-Mar-2028	119.214	0,29
<b>Südafrika - 353.435</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>353.435</b>	<b>0,87</b>
190.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 18-Sep-2025	198.058	0,49
150.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026	155.377	0,38
<b>Spanien - 2.910.545</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.172.696)</b>		<b>2.910.545</b>	<b>7,14</b>
200.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	196.484	0,48
100.000	Abertis Infraestructuras SA 'EMTN' 3.000% 27-Mar-2031	114.832	0,28

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Spanien Forts.</b>			
100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 0.435% 09-Sep-2023	101.501	0,25
300.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.125% 27-Mar-2025	302.458	0,74
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	96.583	0,24
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 05-Jan-2026	103.932	0,26
500.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	502.915	1,23
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	206.640	0,51
119.000	FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027	130.551	0,32
100.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 2.250% 28-Jan-2029	102.180	0,25
200.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025	209.804	0,51
200.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	198.498	0,49
400.000	Santander Consumer Finance SA 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2024	403.292	0,99
139.409	Silverback Finance DAC 3.126% 25-Feb-2037	145.535	0,36
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	95.340	0,23
<b>Schweden - 603.520</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 683.693)</b>		<b>603.520</b>	<b>1,48</b>
192.000	Akelius Residential Property AB 'EMTN' 1.750% 07-Feb-2025	200.648	0,49
123.000	Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 1.000% 13-Apr-2028	122.606	0,30
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	97.295	0,24
189.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029	182.971	0,45
<b>Schweiz - 1.587.650</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.128.012)</b>		<b>1.587.650</b>	<b>3,90</b>
100.000	Adecco International Financial Services BV 'EMTN' 0.500% 21-Sep-2031	96.478	0,24
150.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	148.741	0,36
565.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	615.095	1,51
100.000	Givaudan Finance Europe BV 1.000% 22-Apr-2027	104.206	0,25
100.000	Givaudan Finance Europe BV 1.625% 22-Apr-2032	108.554	0,27
104.000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.500% 23-Apr-2031	98.870	0,24
130.000	Holcim Finance Luxembourg SA 'EMTN' 0.500% 03-Sep-2030	125.105	0,31
190.000	Novartis Finance SA 0.000% 23-Sep-2028	186.291	0,46
100.000	Richemont International Holding SA 1.125% 26-May-2032	104.310	0,26
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 106.215</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 104.718)</b>		<b>106.215</b>	<b>0,26</b>
100.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 2.375% 25-Sep-2026	106.215	0,26
<b>Vereinigtes Königreich - 6.344.247</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.078.462)</b>		<b>6.344.247</b>	<b>15,57</b>
270.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 0.750% 09-Jun-2025	274.057	0,67
188.000	Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029	184.026	0,45
110.000	Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032	109.198	0,27
100.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 1.250% 13-Mar-2027	101.820	0,25
100.000	BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032	118.257	0,29
300.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN' 2.213% 25-Sep-2026	328.226	0,80
165.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.250% 22-Mar-2026	174.908	0,43
334.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	327.741	0,80
100.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.125% 12-Sep-2029	101.503	0,25
115.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.500% 23-Jun-2027	118.660	0,29
100.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.125% 17-Oct-2028	101.574	0,25
302.000	CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024	301.606	0,74

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>				
210.000	CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.750% 12-Sep-2025	219.954	0,54	
316.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	311.282	0,76	
248.000	Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025	257.276	0,63	
100.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 14-Mar-2034	104.408	0,26	
340.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029	338.198	0,83	
110.000	Imperial Brands Finance Netherlands BV 'EMTN' 1.750% 18-Mar-2033	107.422	0,26	
150.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027	157.633	0,39	
340.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027	361.090	0,89	
210.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 1.043% 14-Sep-2032	206.881	0,51	
185.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 2.750% 02-Apr-2025	200.718	0,49	
230.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 4.375% 24-Jan-2029	267.231	0,66	
400.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	399.152	0,98	
130.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	125.076	0,31	
100.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.875% 29-May-2026	101.841	0,25	
345.000	Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	365.835	0,90	
150.000	Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079	155.041	0,38	
206.000	Yorkshire Building Society 0.625% 21-Sep-2025	209.315	0,51	
216.000	Yorkshire Building Society 'EMTN' 0.500% 01-Jul-2028	214.318	0,53	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 8.486.174 (31. Dezember 2020: 7.104.767)</b>				
100.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0.500% 05-May-2028	101.086	0,25	
100.000	American International Group Inc 1.875% 21-Jun-2027	106.322	0,26	
190.000	American Tower Corp 1.375% 04-Apr-2025	196.531	0,48	
100.000	AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036	119.189	0,29	
100.000	AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032	123.496	0,30	
137.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.654% 26-Oct-2031	133.649	0,33	
149.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.662% 25-Apr-2028	157.473	0,39	
100.000	Becton Dickinson and Co 0.034% 13-Aug-2025	99.394	0,24	
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	98.344	0,24	
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.336% 13-Aug-2041	95.413	0,23	
110.000	Berry Global Inc 'REGS' 1.000% 15-Jan-2025	111.030	0,27	
110.000	Berry Global Inc 'REGS' 1.500% 15-Jan-2027	112.267	0,28	
290.000	Celanese US Holdings LLC 1.250% 11-Feb-2025	297.417	0,73	
200.000	Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024	201.419	0,49	
100.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029	101.752	0,25	
100.000	Chubb INA Holdings Inc 2.500% 15-Mar-2038	117.642	0,29	
337.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	332.691	0,82	
111.000	Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032	110.625	0,27	
140.000	Dow Chemical Co/The 0.500% 15-Mar-2027	139.626	0,34	
100.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	125.295	0,31	
120.000	Eaton Capital Unlimited Co 0.577% 08-Mar-2030	119.182	0,29	
100.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	91.514	0,22	
120.000	Exxon Mobil Corp 1.408% 26-Jun-2039	115.662	0,28	
260.000	FedEx Corp 0.950% 04-May-2033	251.137	0,62	
100.000	FedEx Corp 1.300% 05-Aug-2031	103.174	0,25	
123.000	Fidelity National Information Services Inc 0.625% 03-Dec-2025	124.711	0,31	
100.000	Fidelity National Information Services Inc 2.000% 21-May-2030	108.700	0,27	
245.000	General Motors Financial Co Inc 0.600% 20-May-2027	242.910	0,60	
330.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN' 1.694% 26-Mar-2025	343.784	0,84	
423.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	412.681	1,01	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
213.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	206.140	0,51	
80.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028	86.483	0,21	
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039	103.324	0,25	
400.000	Molson Coors Beverage Co 1.250% 15-Jul-2024	409.858	1,01	
400.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 1.342% 23-Oct-2026	415.442	1,02	
153.000	Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033	153.237	0,38	
194.000	Netflix Inc 3.625% 15-May-2027	222.862	0,55	
110.000	Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030	131.050	0,32	
200.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031	173.954	0,43	
191.000	Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033	186.485	0,46	
100.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041	101.913	0,25	
135.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032	154.889	0,38	
130.000	Upjohn Finance BV 1.908% 23-Jun-2032	136.349	0,33	
200.000	Utah Acquisition Sub Inc 2.250% 22-Nov-2024	211.392	0,52	
200.000	Verizon Communications Inc 1.125% 19-Sep-2035	195.073	0,48	
100.000	Verizon Communications Inc 2.625% 01-Dec-2031	116.863	0,29	
275.000	Westlake Chemical Corp 1.625% 17-Jul-2029	285.160	0,70	
370.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026	401.584	0,99	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>38.083.369</b>	<b>93,48</b>	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Offene Terminkontrakte - 37.238 (31. Dezember 2020: 4.113)</b>					
(3)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(399.720)	2.234	0,01	
(3)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(514.110)	8.607	0,02	
(3)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(620.220)	26.397	0,06	
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>37.238</b>	<b>0,09</b>	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.141 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 87.379)			3.141	0,01	
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>39.597.242</b>	<b>97,20</b>	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Credit Default Swaps - (111.371) (31. Dezember 2020: (112.022))</b>				
4.300.000	CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026	(111.371)	(0,27)	
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>			<b>(111.371)</b>	<b>(0,27)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Offene Terminkontrakte - (6.997) (31. Dezember 2020: (4.300))</b>					
5	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022	560.150	(945)	(0,00)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
	<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>			
(4)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(516.577)	(6.052)	(0,02)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(6.997)</b>	<b>(0,02)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (29.711) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (8.081))			(29.711)	(0,08)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(148.079)</b>	<b>(0,37)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>1.289.046</b>	<b>3,17</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>40.738.209</b>	<b>100,00</b>

^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.  
Der Kontrahent für die Credit Default Swaps ist Morgan Stanley.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,28
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,09
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,01
Sonstiges Umlaufvermögen	4,62
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>							
US-Dollar	Euro	79.000	69.541	21. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	231	
Pfund Sterling	Euro	162.000	189.877	25. Jan. 22	Morgan Stanley	2.910	
						<b>EUR</b>	<b>3.141</b>
Euro	US-Dollar	115.499	131.000	21. Jan. 22	Morgan Stanley	(200)	
Euro	US-Dollar	275.628	321.000	21. Jan. 22	Morgan Stanley	(7.880)	
Euro	US-Dollar	485.720	567.000	28. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(14.983)	
Euro	US-Dollar	499.282	573.000	4. Feb. 22	Bank of America Merrill Lynch	(6.648)	
						<b>EUR</b>	<b>(29.711)</b>



# BNY MELLON FUTURE EARTH FUND\*

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Dänemark - 125.441</b>			
881	Novozymes A/S	72.298	3,34
273	Ørsted AS '144A'	34.714	1,60
605	Vestas Wind Systems A/S	18.429	0,85
<b>Frankreich - 98.965</b>			
852	Legrand SA	98.965	4,57
<b>Deutschland - 59.067</b>			
1.283	Infineon Technologies AG	59.067	2,73
<b>Hongkong - 14.230</b>			
7.037	Vitasoy International Holdings Ltd	14.230	0,66
<b>Irland - 59.033</b>			
1.075	Smurfit Kappa Group Plc	59.033	2,73
<b>Japan - 431.602</b>			
300	Daikin Industries Ltd	68.029	3,14
1.200	Ebara Corp	66.609	3,08
100	FANUC Corp	21.204	0,98
3.000	Kubota Corp	66.596	3,08
700	Kurita Water Industries Ltd	33.200	1,53
500	Nidec Corp	58.765	2,72
200	Shimano Inc	53.301	2,46
800	Toyota Industries Corp	63.898	2,95
<b>Niederlande - 52.692</b>			
235	Koninklijke DSM NV	52.692	2,43
<b>Norwegen - 111.333</b>			
3.136	Mowi ASA	74.146	3,42
520	TOMRA Systems ASA	37.187	1,72
<b>Republik Korea - 65.619</b>			
119	Samsung SDI Co Ltd	65.619	3,03
<b>Vereinigtes Königreich - 246.623</b>			
260	Ashtead Group Plc	20.889	0,96
6.991	Genuit Group Plc	55.537	2,57
1.175	Johnson Matthey Plc	32.381	1,50
5.765	National Grid Plc	82.786	3,82
1.039	Unilever Plc	55.030	2,54
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 788.252</b>			
255	Acuity Brands Inc	53.931	2,49
251	Albemarle Corp	58.856	2,72
116	Beyond Meat Inc	7.817	0,36
248	Deere & Co	84.832	3,92
314	Ecolab Inc	73.490	3,39
960	Eversource Energy	87.490	4,04
156	Hubbell Inc - Class B	32.350	1,49
170	Microsoft Corp	57.689	2,66
474	TE Connectivity Ltd	76.141	3,52
250	Texas Instruments Inc	47.347	2,19
221	Trane Technologies Plc	44.383	2,05
611	Trimble Inc	53.444	2,47
2.080	Weyerhaeuser Co (REIT)	85.228	3,94
212	Xylem Inc/NY	25.254	1,17
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>2.052.857</b>	<b>94,82</b>

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Vereinigtes Königreich - 45.419</b>			
23.971	Greencoat UK Wind Plc/Funds	45.419	2,10
<b>Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>		<b>45.419</b>	<b>2,10</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 687 (siehe unten)		687	0,03
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>2.098.963</b>	<b>96,95</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (58) (siehe unten)		(58)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(58)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>66.032</b>	<b>3,05</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>2.164.937</b>	<b>100,00</b>

\*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,34
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,03
Sonstiges Umlaufvermögen	3,63
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

## Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
<b>BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro H (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	1.646	1.864	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	644	728	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	107.779	121.788	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	227
US-Dollar	Euro	686	606	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD 228</b>
						<b>EUR 201</b>
Euro	US-Dollar	1.543	1.750	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	1.537	1.741	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	1.243	1.102	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.009	895	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	2.113	1.870	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	1.252	1.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
						<b>USD (19)</b>
						<b>EUR (17)</b>

## BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro I (Acc) (Hedged)

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
<b>BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro I (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	1.664	1.884	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	658	744	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	108.713	122.844	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	228
US-Dollar	Euro	689	608	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD 229</b>
						<b>EUR 202</b>
Euro	US-Dollar	1.573	1.785	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	1.559	1.766	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	2.123	1.878	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	1.260	1.116	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.251	1.108	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.015	900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
						<b>USD (19)</b>
						<b>EUR (17)</b>

## BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro W (Acc) (Hedged)

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
<b>BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro W (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	1.667	1.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	661	747	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	108.914	123.071	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	229
US-Dollar	Euro	690	609	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD 230</b>
						<b>EUR 203</b>
Euro	US-Dollar	1.580	1.792	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
Euro	US-Dollar	1.564	1.772	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	2.125	1.880	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)

## Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Euro W (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	1.262	1.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.252	1.110	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.016	901	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
						<b>USD (20)</b>
						<b>EUR (18)</b>

# BNY MELLON FUTURE FOOD FUND\*

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Kanada - 122.961</b>			
1.241	Nutrien Ltd	92.634	3,35
4.437	SunOpta Inc	30.327	1,09
<b>China - 52.382</b>			
7.346	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	11.408	0,41
1.417	Meituan '144A'	40.974	1,48
<b>Dänemark - 133.245</b>			
528	Chr Hansen Holding A/S	41.417	1,50
1.119	Novozymes A/S	91.828	3,32
<b>Frankreich - 64.321</b>			
1.043	Danone SA	64.321	2,32
<b>Deutschland - 100.043</b>			
896	Bayer AG	47.725	1,73
354	Symrise AG - Class A	52.318	1,89
<b>Hongkong - 14.791</b>			
7.314	Vitasoy International Holdings Ltd	14.791	0,53
<b>Irland - 84.940</b>			
658	Kerry Group Plc	84.940	3,07
<b>Japan - 166.994</b>			
3.000	Kubota Corp	66.596	2,41
1.500	Suntory Beverage & Food Ltd	54.269	1,96
3.200	Topcon Corp	46.129	1,67
<b>Mexiko - 74.634</b>			
20.000	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	74.634	2,70
<b>Niederlande - 165.943</b>			
2.573	Koninklijke Ahold Delhaize NV	88.139	3,19
347	Koninklijke DSM NV	77.804	2,81
<b>Neuseeland - 18.572</b>			
4.683	a2 Milk Co Ltd/The	18.572	0,67
<b>Norwegen - 146.573</b>			
2.604	Grieg Seafood ASA	24.484	0,89
2.983	Mowi ASA	70.528	2,55
721	TOMRA Systems ASA	51.561	1,86
<b>Saudi-Arabien - 33.444</b>			
302	Delivery Hero SE '144A'	33.444	1,21
<b>Schweiz - 246.628</b>			
134	Bucher Industries AG	66.207	2,39
12	Givaudan SA	63.003	2,28
841	Nestle SA	117.418	4,24
<b>Vereinigtes Königreich - 273.665</b>			
4.097	CNH Industrial NV	79.168	2,86
818	Genus Plc	54.301	1,96
2.842	Nomad Foods Ltd	72.031	2,60
1.287	Unilever Plc	68.165	2,47
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 998.136</b>			
766	AGCO Corp	87.929	3,18
67	Beyond Meat Inc	4.515	0,16
2.949	Brixmor Property Group Inc (REIT)	74.654	2,70
1.729	Corteva Inc	81.479	2,95
163	Costco Wholesale Corp	91.930	3,32
271	Deere & Co	92.700	3,35
339	Ecolab Inc	79.341	2,87
654	Ingredion Inc	63.111	2,28

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
442	International Flavors & Fragrances Inc	65.666	2,37
1.776	Mosaic Co/The	69.628	2,52
483	PepsiCo Inc	83.405	3,01
2.790	Sprouts Farmers Market Inc	83.379	3,01
1.030	Trimble Inc	90.094	3,26
351	Tyson Foods Inc - Class A	30.305	1,10
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>2.697.272</b>	<b>97,49</b>
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>2.697.272</b>	<b>97,49</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>69.553</b>	<b>2,51</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>2.766.825</b>	<b>100,00</b>

\*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,93
Sonstiges Umlaufvermögen	3,07
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# BNY MELLON FUTURE LIFE FUND\*

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 33.081</b>			
211	Cochlear Ltd	33.081	1,41
<b>China - 28.814</b>			
4.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	28.814	1,22
<b>Dänemark - 113.744</b>			
1.012	Novo Nordisk A/S	113.744	4,84
<b>Frankreich - 74.182</b>			
200	EssilorLuxottica SA	42.402	1,80
67	L'Oreal SA	31.780	1,35
<b>Deutschland - 68.615</b>			
357	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	23.141	0,99
608	Siemens Healthineers AG '144A'	45.474	1,93
<b>Hongkong - 72.592</b>			
7.200	AIA Group Ltd	72.592	3,09
<b>Italien - 38.553</b>			
718	Amplifon SpA	38.553	1,64
<b>Japan - 85.302</b>			
400	M3 Inc	20.144	0,86
600	Sugi Holdings Co Ltd	36.327	1,54
2.000	Topcon Corp	28.831	1,23
<b>Südafrika - 22.032</b>			
2.458	Discovery Ltd	22.032	0,94
<b>Schweiz - 327.018</b>			
513	Alcon Inc	45.372	1,93
45	Lonza Group AG	37.543	1,60
462	Novartis AG	40.629	1,73
264	Roche Holding AG	109.641	4,66
25	Straumann Holding AG	53.032	2,25
93	Zurich Insurance Group AG	40.801	1,73
<b>Vereinigtes Königreich - 231.348</b>			
621	AstraZeneca Plc	72.117	3,07
3.220	GlaxoSmithKline Plc	69.611	2,96
3.833	Prudential Plc	65.574	2,79
1.387	Smith & Nephew Plc	24.046	1,02
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 1.203.182</b>			
1.148	Abbott Laboratories	161.874	6,88
523	Acushnet Holdings Corp	27.784	1,18
11	Booking Holdings Inc	26.367	1,12
154	Cooper Cos Inc/The	65.325	2,78
223	Danaher Corp	73.283	3,12
275	HCA Healthcare Inc	71.015	3,02
1.008	Healthpeak Properties Inc (REIT)	36.283	1,54
177	Home Depot Inc/The	72.571	3,09
144	Intuitive Surgical Inc	52.334	2,23
451	Jackson Financial Inc	18.804	0,80
521	Johnson & Johnson	89.823	3,82
175	Lowe's Cos Inc	44.873	1,91
948	Medtronic Plc	99.061	4,21
626	Merck & Co Inc	48.293	2,05
1.102	Principal Financial Group Inc	79.465	3,38
174	Sherwin-Williams Co/The	60.970	2,59
63	Thermo Fisher Scientific Inc	41.939	1,78
221	UnitedHealth Group Inc	111.562	4,74

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
251	Welltower Inc (REIT)	21.556	0,92
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>2.298.463</b>	<b>97,4</b>
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>2.298.463</b>	<b>97,4</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>53.113</b>	<b>2,26</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>2.351.576</b>	<b>100,00</b>

\*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,18
Sonstiges Umlaufvermögen	2,82
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>US-Dollar - 22.509.231</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.427.021)</b>			
4.512.179	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	22.509.231	5,18
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>22.509.231</b>	<b>5,18</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australischer Dollar - 15.223.765</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 39.662.148)</b>			
4.110.000	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	2.589.055	0,59
4.120.000	Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025	4.463.477	1,03
6.700.000	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	4.877.940	1,12
4.760.000	Treasury Corp of Victoria 2.000% 17-Sep-2035	3.293.293	0,76
<b>Kanadischer Dollar - 19.879.967</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 22.974.671)</b>			
11.295.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	9.057.327	2,08
3.800.000	Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	2.985.634	0,69
6.832.679	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	7.837.006	1,80
<b>Kolumbianischer Peso - 6.038.346</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.270.743)</b>			
8.959.500.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	1.995.954	0,46
17.841.300.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	4.042.392	0,93
<b>Tschechische Krone - 9.951.584</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.745.774)</b>			
123.780.000	Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	5.320.729	1,22
104.130.000	Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029	4.630.855	1,07
<b>Dänische Krone - 5.760.251</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.821.549)</b>			
36.020.000	Denmark Government Bond '144A' 0.500% 15-Nov-2029	5.760.251	1,33
<b>Euro - 101.384.306</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 138.407.895)</b>			
1.645.000	European Union 0.000% 04-Jul-2031	1.849.512	0,43
4.900.000	FMS Wertmanagement 'EMTN' 0.375% 29-Apr-2030	5.642.263	1,30
11.516.974	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	13.946.021	3,21
2.310.000	French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-May-2045	4.035.469	0,93
1.790.000	Indonesia Government International Bond 1.750% 24-Apr-2025	2.107.620	0,48
3.530.000	Ireland Government Bond 1.000% 15-May-2026	4.232.601	0,97
4.010.000	Ireland Government Bond 1.100% 15-May-2029	4.905.267	1,13
1.651.200	Ireland Government Bond 1.500% 15-May-2050	2.153.360	0,50
9.530.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.850% 01-Jul-2025	11.408.981	2,62
3.730.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	4.655.465	1,07
3.757.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	6.049.867	1,39
3.730.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 31-Jul-2035	4.799.344	1,10
5.120.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	5.995.410	1,38
3.700.000	SNCF Reseau 'EMTN' 1.125% 25-May-2030	4.490.272	1,03
5.920.000	Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032	10.301.566	2,37
4.430.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	6.724.857	1,55
1.030.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2044	2.098.229	0,48

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Euro Forts.</b>			
4.140.000	Spain Government Bond '144A' 5.900% 30-Jul-2026	5.988.202	1,38
<b>Indische Rupie - 2.219.627</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
160.700.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	2.219.627	0,51
<b>Indonesische Rupiah - 6.287.191</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.869.377)</b>			
30.625.900.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022	2.187.777	0,51
55.190.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	4.099.414	0,94
<b>Japanischer Yen - 32.154.861</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 53.863.976)</b>			
544.250.000	Japan Government Ten Year Bond 0.100% 20-Dec-2029	4.777.931	1,10
1.722.750.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	14.698.521	3,38
381.700.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Mar-2040	3.301.065	0,76
515.650.000	Japan Government Twenty Year Bond 1.000% 20-Dec-2035	4.937.398	1,14
493.758.657	Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	4.439.946	1,02
<b>Malaysischer Ringgit - 4.323.281</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.432.273)</b>			
18.150.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	4.323.281	1,00
<b>Mexikanischer neuer Peso - 6.876.991</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.917.537)</b>			
62.750.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	3.105.684	0,71
72.800.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	3.771.307	0,87
<b>Neuseeländischer Dollar - 15.385.929</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.644.966)</b>			
3.780.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	2.650.237	0,61
3.170.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2037	2.202.898	0,51
5.610.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	5.364.038	1,23
3.440.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.000% 15-Apr-2037	1.996.656	0,46
4.640.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	3.172.100	0,73
<b>Pfund Sterling - 15.219.250</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 31.726.584)</b>			
1.940.000	Affordable Housing Finance Plc 'EMTN' 3.800% 20-May-2042	3.704.135	0,85
3.800.000	United Kingdom Gilt 1.500% 31-Jul-2053	5.661.239	1,30
1.230.000	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Jun-2032	2.191.006	0,51
1.930.000	United Kingdom Gilt 4.500% 07-Sep-2034	3.662.870	0,84
<b>Schwedische Krone - 4.140.511</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.263.461)</b>			
36.610.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 12-May-2025	4.140.511	0,95
<b>US-Dollar - 156.754.802</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 208.191.197)</b>			
5.400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026	5.269.212	1,21
3.257.000	Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	3.214.965	0,74
3.350.000	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	3.413.482	0,79

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>				<b>Offene Terminkontrakte - 231.888</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				<b>(31. Dezember 2020: (13.115))</b>				
1.920.000	Colombia Government International Bond 8.125% 21-May-2024	2.185.258	0,50	(82)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(15.905.146)	231.888	0,05
5.610.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.164% 11-May-2022	5.610.126	1,29	<b>Offene Terminkontrakte insgesamt 231.888 0,05</b>				
5.300.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	5.306.891	1,22	Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.640.448 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.166.598) 3.640.448 0,84				
4.940.000	European Investment Bank 0.375% 24-Jul-2024	4.876.217	1,12	<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 428.178.417 98,51</b>				
3.841.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' 3.875% 28-Oct-2041	4.886.883	1,12	Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (1.982.261) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (3.033.181)) (1.982.261) (0,46)				
3.948.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.250% 10-Feb-2026	3.955.376	0,91	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (1.982.261) (0,46)</b>				
4.244.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	4.246.651	0,98	<b>Nettoumlaufvermögen 8.486.205 1,95</b>				
4.430.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.340% 22-Nov-2028	4.436.131	1,02	<b>Summe Nettovermögen 434.682.361 100,00</b>				
4.630.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027	4.682.432	1,08	Der Kontrahent der Optionen auf Futures und Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.				
3.328.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	3.280.310	0,75	<b>Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens</b>				
2.722.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026	2.817.190	0,65	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente 96,54				
4.590.000	Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024	4.519.703	1,04	An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente 0,10				
8.610.000	Province of British Columbia Canada 2.250% 02-Jun-2026	8.964.942	2,06	Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) 0,83				
1.495.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025	1.587.899	0,37	Sonstiges Umlaufvermögen 2,53				
3.929.000	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	3.886.222	0,89	<b>Gesamtvermögen 100,00</b>				
2.998.000	Republic of Italy Government International Bond 1.250% 17-Feb-2026	2.919.467	0,67					
4.106.126	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.616.259	1,06					
3.892.149	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	4.151.797	0,96					
4.263.633	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	4.460.908	1,03					
3.466.435	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	5.355.973	1,23					
5.860.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	5.927.756	1,36					
7.510.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	7.548.137	1,74					
4.300.000	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	4.355.933	1,00					
14.540.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	15.505.546	3,57					
6.741.100	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	7.809.670	1,80					
11.494.400	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	13.768.584	3,17					
4.900.000	United States Treasury Strip Principal (Zero Coupon) 0.000% 15-May-2043	3.194.882	0,73					
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>401.600.662</b>	<b>92,39</b>					
<b>Optionen auf Futures - 196.188</b>								
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>								
289	U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000	85.797	0,02					
157	U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000	110.391	0,03					
<b>Optionen auf Futures insgesamt</b>		<b>196.188</b>	<b>0,05</b>					

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>						
Australischer Dollar	US-Dollar	5.920.715	4.223.598	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	69.441
Australischer Dollar	US-Dollar	2.462.054	1.754.883	18. Feb. 22	State Street Bank	30.323
Tschechische Krone	US-Dollar	11.260.000	507.882	18. Feb. 22	UBS AG	2.594
Euro	US-Dollar	5.240.000	5.886.978	18. Feb. 22	State Street Bank	49.254
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	4.911.729	1.161.495	18. Feb. 22	State Street Bank	17.465
Mexikanischer Peso	US-Dollar	5.586.938	263.027	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	8.175
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	9.377.618	6.344.765	18. Feb. 22	State Street Bank	57.382
Polnischer Zloty	US-Dollar	18.030.000	4.370.115	18. Feb. 22	State Street Bank	57.812
Pfund Sterling	US-Dollar	6.829.658	9.179.743	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	22.394
Pfund Sterling	US-Dollar	702.979	944.874	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	2.305
US-Dollar	Australischer Dollar	4.822.857	6.531.364	18. Feb. 22	State Street Bank	87.044
US-Dollar	Australischer Dollar	8.874.779	12.046.535	18. Feb. 22	State Street Bank	139.983
US-Dollar	Kanadischer Dollar	8.048.947	10.034.175	18. Feb. 22	State Street Bank	171.561
US-Dollar	Kanadischer Dollar	2.984.197	3.800.000	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	986
US-Dollar	Dänische Krone	4.049.150	26.038.321	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	82.546
US-Dollar	Euro	314.028	271.705	18. Feb. 22	State Street Bank	6.222
US-Dollar	Euro	256.471	226.185	18. Feb. 22	State Street Bank	234
US-Dollar	Euro	18.884.160	16.335.044	18. Feb. 22	State Street Bank	378.702
US-Dollar	Euro	519.247	448.220	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	11.473
US-Dollar	Euro	539.070	464.491	18. Feb. 22	State Street Bank	12.863
US-Dollar	Japanischer Yen	793.896	89.900.000	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	12.697
US-Dollar	Japanischer Yen	2.968.519	337.506.073	18. Feb. 22	State Street Bank	35.712
US-Dollar	Japanischer Yen	5.804.090	660.332.633	18. Feb. 22	State Street Bank	66.035
US-Dollar	Koreanischer Won	4.303.704	5.096.790.000	18. Feb. 22	State Street Bank	18.511
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	1.014.598	1.438.061	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	32.827
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	573.842	812.048	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	19.453
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	939.057	1.343.005	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	22.181
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	21.675.418	30.631.265	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	763.299
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	496.596	708.795	18. Feb. 22	UBS AG	12.699
US-Dollar	Philippinischer Peso	6.513.040	330.458.639	18. Feb. 22	State Street Bank	98.282
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	6.259.674	96.936.760	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	220.388
US-Dollar	Schwedische Krone	14.003.066	120.079.650	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	746.129
<b>USD</b>						<b>3.256.972</b>
Euro	US-Dollar	5.669.068	6.423.536	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(1.227)
Euro	US-Dollar	4.276.075	4.907.934	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(63.703)
Ungarischer Forint	US-Dollar	2.179.489.980	6.955.430	18. Feb. 22	State Street Bank	(313.981)
Japanischer Yen	US-Dollar	6.601.943.658	58.029.332	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(660.798)
Japanischer Yen	US-Dollar	743.760.563	6.597.330	18. Feb. 22	State Street Bank	(134.316)
Koreanischer Won	US-Dollar	5.096.794.000	4.289.870	18. Feb. 22	State Street Bank	(4.674)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	12.597.746	8.897.032	18. Feb. 22	State Street Bank	(296.487)
Schwedische Krone	US-Dollar	34.835.299	4.061.867	18. Feb. 22	UBS AG	(216.008)
Schwedische Krone	US-Dollar	57.059.002	6.369.778	18. Feb. 22	State Street Bank	(70.395)
US-Dollar	Tschechische Krone	10.625.686	234.923.923	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(24.686)
US-Dollar	Euro	429.775	379.434	18. Feb. 22	State Street Bank	(74)
US-Dollar	Euro	6.378.087	5.850.315	18. Feb. 22	State Street Bank	(22.977)
US-Dollar	Euro	5.631.603	4.992.348	18. Feb. 22	State Street Bank	(24.071)
US-Dollar	Euro	267.827	236.660	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	(278)
US-Dollar	Euro	517.946	457.496	18. Feb. 22	State Street Bank	(337)
US-Dollar	Indische Rupie	2.259.746	169.627.865	18. Feb. 22	State Street Bank	(10.781)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	6.504.596	93.834.650.000	18. Feb. 22	State Street Bank	(75.840)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	5.521.515	23.146.189	18. Feb. 22	State Street Bank	(34.255)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.351.750	28.302.644	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(22.120)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	484.294	7.790.000	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(1.033)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	799.522	594.964	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(2.120)
						<b>USD</b>
						<b>(1.980.161)</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged)</b>						
Australischer Dollar	US-Dollar	12.868	9.197	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	132
US-Dollar	Australischer Dollar	50	70	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD</b>
						<b>132</b>
						<b>AUD</b>
						<b>182</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	1.732.003	1.957.133	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.637
						<b>USD</b>
						<b>3.637</b>
						<b>EUR</b>
						<b>3.213</b>
US-Dollar	Euro	11.616	10.264	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
						<b>USD</b>
						<b>(4)</b>
						<b>EUR</b>
						<b>(4)</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	677.181	765.203	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.422
						<b>USD</b>
						<b>1.422</b>
						<b>EUR</b>
						<b>1.256</b>
US-Dollar	Euro	4.385	3.875	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
						<b>USD</b>
						<b>(2)</b>
						<b>EUR</b>
						<b>(2)</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	18.862	25.349	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69
Pfund Sterling	US-Dollar	2.216	2.946	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	41
Pfund Sterling	US-Dollar	5.673	7.568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	77
Pfund Sterling	US-Dollar	9.398	12.469	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	196
Pfund Sterling	US-Dollar	1.518	2.013	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33
Pfund Sterling	US-Dollar	1.775	2.355	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	37
Pfund Sterling	US-Dollar	6.740	8.901	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	181
Pfund Sterling	US-Dollar	1.389	1.863	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Pfund Sterling	US-Dollar	2.595	3.423	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	74
Pfund Sterling	US-Dollar	2.464.946	3.252.046	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69.640
Pfund Sterling	US-Dollar	3.107	4.174	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12
Pfund Sterling	US-Dollar	5.516	7.347	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	87
Pfund Sterling	US-Dollar	1.430	1.894	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	32
Pfund Sterling	US-Dollar	528	697	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	14
US-Dollar	Pfund Sterling	2.868	2.127	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	114	84	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD 70.504</b>
						<b>GBP 52.318</b>
Pfund Sterling	US-Dollar	2.127	2.868	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.566	13.843	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(88)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.928	13.380	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(103)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.327	2.522	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(72)
US-Dollar	Pfund Sterling	25.354	18.862	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Pfund Sterling	75	56	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	52	40	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	236	179	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.243	935	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Pfund Sterling	50	38	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	222	167	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	159	120	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	346	261	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	110	83	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
						<b>USD (366)</b>
						<b>GBP (273)</b>

**BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	43.703	58.733	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	161
Pfund Sterling	US-Dollar	14.945	20.088	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	50
Pfund Sterling	US-Dollar	10.618.534	14.009.213	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	299.996
Pfund Sterling	US-Dollar	54.933	73.812	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	214
Pfund Sterling	US-Dollar	6.583	8.768	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	104
Pfund Sterling	US-Dollar	23.317	30.891	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	530
Pfund Sterling	US-Dollar	117.440	155.064	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.194
Pfund Sterling	US-Dollar	34.600	45.991	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	635
Pfund Sterling	US-Dollar	97.656	130.276	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.322
Pfund Sterling	US-Dollar	24.589	32.623	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	512
Pfund Sterling	US-Dollar	9.978	13.228	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	218
Pfund Sterling	US-Dollar	12.024	15.955	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	248
Pfund Sterling	US-Dollar	22.171	29.280	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	597
US-Dollar	Pfund Sterling	42	31	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	6	4	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>USD 307.781</b>
						<b>GBP 228.392</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	20.084	14.945	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(55)
US-Dollar	Pfund Sterling	58.745	43.703	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(148)
US-Dollar	Pfund Sterling	78.424	58.530	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(448)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.851	2.872	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Pfund Sterling	44.630	33.215	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(129)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	32	24	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	24.380	18.465	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(502)
US-Dollar	Pfund Sterling	25.792	19.455	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(424)
						<b>USD (1.726)</b>
						<b>GBP (1.281)</b>



# BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Supranational - 850.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.546.122)</b>		<b>850.000</b>	<b>0,19</b>
850.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	850.000	0,19
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>850.000</b>	<b>0,19</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 14.575.803</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 25.999.739)</b>		<b>14.575.803</b>	<b>3,29</b>
200.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' FRN 3.610% 12-Sep-2034	209.510	0,05
2.063.153	Liberty Series 2018-3 '2018-3 A2' FRN 1.910% 25-Oct-2050	1.509.571	0,34
1.739.000	Liberty Series 2020-3 '2020-3 B' FRN 2.110% 25-Dec-2051	1.280.488	0,29
1.480.000	Metro Finance 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 1.565% 20-Jun-2027	1.078.449	0,24
1.500.000	Pepper I-Prime 2020-1 Trust '2020-1 B' FRN 2.215% 18-Mar-2052	1.109.975	0,25
1.300.000	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 2.062% 22-Jan-2053	964.469	0,22
81.871	Pepper Residential Securities Trust NO 18 FRN 2.115% 12-Aug-2058	59.767	0,01
1.300.000	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 1.815% 15-Jan-2063	945.152	0,21
1.600.000	Pepper SPARKZ Trust No.3 'SPK-3 C' FRN 1.915% 17-Aug-2028	1.171.907	0,27
1.035.000	RESIMAC Premier Series 2020-1 '2020-1X C' FRN 2.909% 07-Feb-2052	781.028	0,18
1.357.000	Ruby Bond Trust '2021-1 B' FRN 1.515% 12-Mar-2053	988.209	0,22
2.846.000	Santos Finance Ltd 'EMTN' 5.250% 13-Mar-2029	3.184.955	0,72
1.770.000	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 2.015% 15-Jun-2052	1.292.323	0,29
<b>Belgien - 6.609.026</b>		<b>6.609.026</b>	<b>1,49</b>
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
2.161.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2030	2.620.386	0,59
900.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.875% 02-Apr-2032	1.223.655	0,28
2.100.000	Ethias SA 5.000% 14-Jan-2026	2.764.985	0,62
<b>Bermudas - 632.604</b>		<b>632.604</b>	<b>0,14</b>
<b>(31. Dezember 2020: 825.109)</b>			
537.000	PartnerRe Ireland Finance DAC 1.250% 15-Sep-2026	632.604	0,14
<b>Brasilien - 4.049.820</b>		<b>4.049.820</b>	<b>0,91</b>
<b>(31. Dezember 2020: 6.513.458)</b>			
898.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030	956.576	0,21
1.098.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	1.266.988	0,29
3.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	501.519	0,11
1.143.000	Suzano Austria GmbH 6.000% 15-Jan-2029	1.324.737	0,30
<b>Kanada - 5.884.941</b>		<b>5.884.941</b>	<b>1,33</b>
<b>(31. Dezember 2020: 3.743.615)</b>			
86.280	Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 3.600% 15-Mar-2027	87.134	0,02
2.261.581	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030	2.288.300	0,52
333.107	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust '144A' 5.250% 01-Apr-2029	363.361	0,08
100.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4.300% 29-Jul-2049	122.130	0,03
20.000	Canadian Government Bond 2.000% 01-Dec-2051	17.028	0,00
1.478.000	Canadian Pacific Railway Co 3.100% 02-Dec-2051	1.516.375	0,34
1.487.000	Parkland Corp '144A' 4.500% 01-Oct-2029	1.490.613	0,34
<b>China - 435.404</b>		<b>435.404</b>	<b>0,10</b>
<b>(31. Dezember 2020: 3.775.658)</b>			
464.000	Prosus NV 'REGS' 3.832% 08-Feb-2051	435.404	0,10

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Kolumbien - 3.500.435</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.384.618)</b>		<b>3.500.435</b>	<b>0,79</b>
805.000	Colombia Government International Bond 5.200% 15-May-2049	742.403	0,17
2.614.000	Ecopetrol SA 5.375% 26-Jun-2026	2.758.032	0,62
<b>Elfenbeinküste - 1.178.788</b>		<b>1.178.788</b>	<b>0,27</b>
<b>(31. Dezember 2020: 1.786.726)</b>			
1.073.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	1.178.788	0,27
<b>Dänemark - 7.891.720</b>		<b>7.891.720</b>	<b>1,78</b>
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
2.643.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 2.500% 28-May-2024	3.173.575	0,72
4.139.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 0.010% 10-Nov-2024	4.718.145	1,06
<b>Ägypten - 600.327</b>		<b>600.327</b>	<b>0,14</b>
<b>(31. Dezember 2020: 3.273.922)</b>			
650.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033	600.327	0,14
<b>Frankreich - 15.012.873</b>		<b>15.012.873</b>	<b>3,39</b>
<b>(31. Dezember 2020: 59.428.253)</b>			
2.646.000	Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040	3.385.648	0,77
200.000	Danone SA 'EMTN' 1.125% 14-Jan-2025	234.978	0,05
1.100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049	1.338.965	0,30
200.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.875% 15-Dec-2026	234.032	0,05
3.100.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	3.683.762	0,83
100.000	Orano SA 'EMTN' 3.375% 23-Apr-2026	122.274	0,03
179.000	PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033	296.185	0,07
3.100.000	Thales SA 'EMTN' 0.875% 19-Apr-2024	3.599.305	0,81
1.966.000	WEA Finance LLC '144A' 4.625% 20-Sep-2048	2.117.724	0,48
<b>Deutschland - 22.950.045</b>		<b>22.950.045</b>	<b>5,18</b>
<b>(31. Dezember 2020: 84.335.975)</b>			
419.324	Bundessobligation 0.000% 10-Oct-2025	487.311	0,11
4.225.054	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030	4.919.709	1,11
160.000	Daimler AG 'EMTN' 1.875% 08-Jul-2024	191.436	0,04
3.208.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.250% 06-Nov-2023	3.680.029	0,83
3.900.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.250% 25-Apr-2023	3.885.103	0,88
3.703.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.000% 19-Jul-2024	4.206.172	0,95
3.200.000	Vonovia Finance BV 0.750% 15-Jan-2024	3.701.169	0,84
400.000	Vonovia SE 1.000% 16-Jun-2033	446.493	0,10
1.300.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	1.432.623	0,32
<b>Ghana - 1.323.960</b>		<b>1.323.960</b>	<b>0,30</b>
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.100.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.125% 18-Jan-2026	1.018.875	0,23
374.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034	305.085	0,07
<b>Ungarn - 144.040</b>		<b>144.040</b>	<b>0,03</b>
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
130.000	Hungary Government International Bond 'REGS' 0.125% 21-Sep-2028	144.040	0,03
<b>Indonesien - 4.001.053</b>		<b>4.001.053</b>	<b>0,90</b>
<b>(31. Dezember 2020: 3.560.498)</b>			
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3.541% 27-Apr-2032	201.864	0,05
1.172.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4.745% 09-Jun-2051	1.207.162	0,27
2.018.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 5.250% 08-Jan-2047	2.592.027	0,58

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Irland - 15.193.452</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 21.971.025)</b>		<b>15.193.452</b>	<b>3,43</b>
295.816	Arrow CMBS 2018 DAC '2018-1 C' FRN 2.050% 22-May-2030	337.184	0,08
642.733	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 1.728% 02-May-2030	869.847	0,20
526.024	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 2.478% 02-May-2030	710.284	0,16
1.024.554	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058	1.160.226	0,26
275.942	Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 1.600% 17-Aug-2031	315.822	0,07
100.000	Portman Square 2021-NPL1 DAC '2021-NPL1X A' FRN 1.433% 25-Oct-2061	112.825	0,03
438.816	Retiro Mortgage Securities DAC FRN 1.444% 30-Jul-2075	497.627	0,11
838.000	Richmond Park CLO 1 DAC FRN 1.500% 14-Jul-2031	951.557	0,21
3.198.000	Shamrock Residential 2021-1 DAC '2021-1 B' FRN 0.757% 24-Dec-2059	3.661.058	0,83
325.608	Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 1.700% 17-May-2031	440.866	0,10
605.000	Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 1.800% 22-Dec-2030	687.960	0,15
1.640.419	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 1.800% 17-Aug-2031	2.208.524	0,50
348.000	Toro European CLO 4 DAC FRN 2.100% 15-Jul-2030	395.725	0,09
2.101.000	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 1.251% 22-Jul-2029	2.843.947	0,64
<b>Italien - 9.305.892</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.681.226)</b>		<b>9.305.892</b>	<b>2,10</b>
4.019.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2024	4.617.546	1,04
4.124.000	Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024	4.688.346	1,06
<b>Japan - 15.378.474</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 17.645.532)</b>		<b>15.378.474</b>	<b>3,47</b>
3.916.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.010% 19-Apr-2024	4.462.627	1,01
63.250.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040	545.327	0,12
4.200.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.696% 16-Jul-2024	4.340.713	0,98
1.810.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.175% 09-Jul-2050	1.836.654	0,41
3.961.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 4.400% 26-Nov-2023	4.193.153	0,95
<b>Mexiko - 3.791.442</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.906.494)</b>		<b>3.791.442</b>	<b>0,86</b>
200.000	Mexico Government International Bond 3.250% 16-Apr-2030	205.506	0,05
1.663.000	Mexico Government International Bond 5.000% 27-Apr-2051	1.893.442	0,43
3.100.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044	1.692.494	0,38
<b>Niederlande - 12.286.106</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.212.496)</b>		<b>12.286.106</b>	<b>2,77</b>
200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 15-Apr-2026	231.621	0,05
3.397.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	3.865.554	0,87
3.100.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024	3.544.004	0,80
3.958.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	4.644.927	1,05
<b>Peru - 3.267.184</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>3.267.184</b>	<b>0,74</b>
1.120.000	Consorcio Transmantar SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	1.232.218	0,28
1.947.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	2.034.966	0,46
<b>Republik Serbien - 1.304.964</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>1.304.964</b>	<b>0,30</b>
1.250.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	1.304.964	0,30

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Rumänien - 1.507.094</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.413.869)</b>		<b>1.507.094</b>	<b>0,34</b>
1.423.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.000% 28-Jan-2032	1.507.094	0,34
<b>Spanien - 5.279.250</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.652.616)</b>		<b>5.279.250</b>	<b>1,19</b>
1.800.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	2.133.006	0,48
2.712.000	Lorca Telecom Bondcoo SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	3.146.244	0,71
<b>Supranational - 3.677.751</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>3.677.751</b>	<b>0,83</b>
3.700.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20-Apr-2023	3.677.751	0,83
<b>Schweden - 3.841.160</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.759.863)</b>		<b>3.841.160</b>	<b>0,87</b>
1.435.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.000% 12-Aug-2027	1.619.481	0,37
2.017.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029	2.221.679	0,50
<b>Schweiz - 16.576.140</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>16.576.140</b>	<b>3,74</b>
2.011.000	Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028	2.185.829	0,49
2.173.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	2.452.981	0,56
906.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 3.091% 14-May-2032	923.888	0,21
250.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 4.194% 01-Apr-2031	276.273	0,06
4.802.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.076% 13-Dec-2031	4.798.644	1,08
2.295.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.607% 13-Dec-2051	2.252.489	0,51
3.231.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 29-Jan-2026	3.686.036	0,83
<b>Tunesien - 373.898</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.918.920)</b>		<b>373.898</b>	<b>0,08</b>
430.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 'REGS' 6.375% 15-Jul-2026	373.898	0,08
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 1.578.811</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.585.351)</b>		<b>1.578.811</b>	<b>0,36</b>
1.120.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 5.625% 25-Sep-2048	1.379.282	0,31
200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040	199.529	0,05
<b>Vereinigtes Königreich - 66.693.139</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 65.573.357)</b>		<b>66.693.139</b>	<b>15,06</b>
1.056.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 3.250% 31-Jul-2028	1.419.672	0,32
2.102.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 4.875% 31-Jul-2024	2.992.114	0,68
884.492	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0.462% 17-Mar-2039	1.125.057	0,25
620.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 1.550% 25-Jul-2058	842.673	0,19
800.000	BAT Capital Corp 5.282% 02-Apr-2050	910.699	0,21
2.350.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	3.185.520	0,72
1.731.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029	2.123.029	0,48
597.978	British Airways 2018-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.800% 20-Sep-2031	621.493	0,14
298.004	British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.250% 15-Nov-2032	316.461	0,07
1.849.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	2.065.639	0,47
715.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029	797.939	0,18
963.840	Canada Square Funding 2019-1 Plc '2019-1 A' FRN 1.150% 17-Oct-2051	1.307.588	0,29
526.000	Canada Square Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 1.649% 17-Jun-2058	712.497	0,16
738.000	Castell 2020-1 Plc '2020-1 C' FRN 2.471% 25-Mar-2053	1.011.847	0,23

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>				
2.542.000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 1.761% 30-Jun-2050	2.893.983	0,65	
381.000	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd 2.000% 13-Apr-2030	470.574	0,11	
3.412.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	3.826.025	0,86	
2.155.000	Hastings Group Finance Plc 3.000% 24-May-2025	3.071.045	0,69	
1.123.000	Hawksmoor Mortgage Funding 2019-1 Plc '2019-1X B' FRN 1.800% 25-May-2053	1.529.611	0,35	
3.295.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028	4.666.303	1,05	
1.962.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027	2.347.412	0,53	
200.000	LSEGA Financing Plc '144A' 3.200% 06-Apr-2041	209.735	0,05	
200.000	NatWest Markets Plc '144A' 0.800% 12-Aug-2024	196.849	0,04	
678.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 1.696% 15-Jul-2029	917.153	0,21	
826.000	Newday Partnership Funding 2020-1 Plc '2020-1X B' FRN 2.300% 15-Nov-2028	1.123.570	0,25	
3.164.000	Prudential Plc 'EMTN' FRN 2.950% 03-Nov-2033	3.139.827	0,71	
2.584.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4.870% 06-May-2026	3.792.981	0,86	
114.808	Ribbon Finance 2018 Plc '2018-1 D' FRN 1.961% 20-Apr-2028	153.320	0,03	
756.000	Ripon Mortgages Plc FRN 1.614% 20-Aug-2056	1.024.340	0,23	
925.000	Ripon Mortgages Plc FRN 1.614% 20-Aug-2056	1.253.406	0,28	
378.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 2.804% 23-Jan-2029	511.267	0,12	
1.753.000	Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc '2019-1 D' FRN 2.550% 25-May-2051	2.375.715	0,54	
2.042.593	Towd Point Mortgage Funding 2019-Auburn 13 Plc '2019-A13X A1' FRN 0.950% 20-Jul-2045	2.769.606	0,62	
642.997	Tower Bridge Funding 2021-2 PLC '2021-2 C' FRN 1.550% 20-Nov-2063	876.341	0,20	
2.743.000	United Kingdom Gilt 0.375% 22-Oct-2030	3.545.195	0,80	
643.000	United Kingdom Gilt 1.250% 22-Oct-2041	878.775	0,20	
2.048.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	2.771.961	0,63	
2.169.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	2.915.917	0,66	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 183.035.456 (31. Dezember 2020: 358.029.952)</b>				
		<b>183.035.456</b>	<b>41,32</b>	
1.605.000	7-Eleven Inc '144A' 1.800% 10-Feb-2031	1.522.236	0,34	
200.000	7-Eleven Inc 'REGS' 1.800% 10-Feb-2031	189.687	0,04	
200.000	AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039	230.996	0,05	
2.522.000	American International Group Inc 3.750% 10-Jul-2025	2.701.893	0,61	
59.000	Analog Devices Inc 2.950% 01-Oct-2051	60.992	0,01	
2.122.000	AT&T Inc 3.300% 01-Feb-2052	2.092.151	0,47	
200.000	AT&T Inc 3.500% 01-Jun-2041	206.551	0,05	
1.329.000	AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048	1.558.501	0,35	
200.000	Avangrid Inc 3.800% 01-Jun-2029	217.849	0,05	
3.900.000	Bank of America Corp FRN 2.299% 21-Jul-2032	3.843.191	0,87	
3.630.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031	3.646.734	0,82	
300.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029	334.963	0,08	
1.995.000	Boeing Co/The 4.875% 01-May-2025	2.185.237	0,49	
2.387.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.700% 01-Apr-2051	2.322.327	0,53	
4.400.000	Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024	5.044.952	1,14	
2.010.000	Cigna Corp 3.400% 15-Mar-2051	2.114.712	0,48	
100.000	Citigroup Inc FRN 5.316% 26-Mar-2041	132.739	0,03	
100.000	Commonwealth Edison Co 4.000% 01-Mar-2049	119.413	0,03	
2.887.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.950% 01-Apr-2050	3.319.144	0,75	
100.000	Crown Castle International Corp 3.250% 15-Jan-2051	98.927	0,02	
3.927.000	Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024	4.646.233	1,05	
293.000	Dell International LLC / EMC Corp 8.350% 15-Jul-2046	489.493	0,11	
942.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 3.375% 15-Dec-2041	936.427	0,21	
2.825.000	Digital Euro Finco LLC 1.125% 09-Apr-2028	3.266.842	0,74	
4.000.000	Duke Energy Corp 3.400% 15-Jun-2029	4.250.267	0,96	
779.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	811.631	0,18	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
1.829.000	Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049	2.400.948	0,54	
4.900.000	Entergy Corp 2.800% 15-Jun-2030	4.997.435	1,13	
300.000	Eversource Energy 2.550% 15-Mar-2031	301.608	0,07	
4.500.000	Exelon Corp 4.050% 15-Apr-2030	5.009.843	1,13	
3.437.000	FedEx Corp 4.250% 15-May-2030	3.916.182	0,88	
4.005.000	Fidelity National Information Services Inc 1.100% 15-Jul-2024	4.665.806	1,05	
1.282.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049	1.472.099	0,33	
480.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044	608.782	0,14	
100.000	General Motors Co 5.950% 01-Apr-2049	137.632	0,03	
4.828.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	5.318.782	1,20	
5.482.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.522% 22-Apr-2031	5.552.475	1,25	
300.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030	328.459	0,07	
3.107.000	Kraft Heinz Foods Co 4.125% 01-Jul-2027	4.622.801	1,04	
3.132.000	Kyndryl Holdings Inc '144A' 3.150% 15-Oct-2031	3.044.835	0,69	
17.000	Lowe's Cos Inc 1.700% 15-Sep-2028	16.686	0,00	
15.000	Lowe's Cos Inc 2.800% 15-Sep-2041	14.712	0,00	
150.000	Lowe's Cos Inc 3.650% 05-Apr-2029	164.740	0,04	
2.252.000	Marathon Petroleum Corp 5.125% 15-Dec-2026	2.566.024	0,58	
4.400.000	McDonald's Corp 'GMTN' 0.625% 29-Jan-2024	5.089.915	1,15	
100.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050	121.799	0,03	
1.856.000	Meritage Homes Corp '144A' 3.875% 15-Apr-2029	1.951.463	0,44	
4.375.000	Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033	4.988.942	1,13	
300.000	Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028	323.887	0,07	
1.724.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.500% 24-Mar-2026	2.329.730	0,53	
465.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028	659.059	0,15	
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 3.700% 15-May-2050	115.845	0,03	
1.042.000	ONEOK Inc 7.150% 15-Jan-2051	1.511.530	0,34	
2.957.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2050	2.911.357	0,66	
1.897.000	Phillips 66 3.300% 15-Mar-2052	1.905.806	0,43	
3.753.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	3.906.201	0,88	
220.000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.900% 17-May-2028	238.012	0,05	
2.851.000	Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081	3.153.359	0,71	
1.378.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031	1.358.148	0,31	
245.000	Stryker Corp 2.625% 30-Nov-2030	321.133	0,07	
1.951.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 4.000% 15-Jan-2032	2.042.170	0,46	
1.185.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.750% 12-Sep-2024	1.376.100	0,31	
2.100.000	Travelers Cos Inc/The 3.050% 08-Jun-2051	2.208.278	0,50	
786.600	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Jun-2022	786.312	0,18	
385.100	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Nov-2022	384.245	0,09	
3.502.000	United States Treasury Note/Bond 0.250% 31-May-2025	3.408.157	0,77	
2.505.400	United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025	2.431.217	0,55	
27.810.000	United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026	27.257.059	6,15	
8.032.400	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	7.065.061	1,60	
3.075.200	United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028-	3.326.982	0,75	
5.900.000	Verizon Communications Inc 2.550% 21-Mar-2031	5.965.249	1,35	
200.000	Verizon Communications Inc 3.400% 22-Mar-2041	210.341	0,05	
1.591.000	WP Carey Inc 2.450% 01-Feb-2032	1.555.788	0,35	
950.000	WPC Eurobond BV 0.950% 01-Jun-2030	1.048.695	0,24	
1.383.000	WPC Eurobond BV 1.350% 15-Apr-2028	1.599.679	0,36	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>431.881.052</b>	<b>97,50</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps - 5.740.006</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.996.179)</b>			
(1.750.000)	CDS Altice France SA 5.000% 20-Dec-2026	132.408	0,03
(4.156.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	101.524	0,02
(89.132.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	2.177.336	0,49
(116.800.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	2.981.693	0,67
(850.000)	CDS OI European Group BV 5.000% 20-Dec-2026	95.978	0,02
(1.650.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2026	236.720	0,06
(100.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2026	14.347	0,01

**Credit Default Swaps insgesamt 5.740.006 1,30**

<b>Währungsoptionen - 51.384</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 124.597)</b>			
1.200.000	Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.380	24.727	0,01
1.600.000	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.123	1.004	0,00
1.600.000	US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.132	12.168	0,00
1.600.000	US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.138	8.811	0,00
1.400.000	US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190	4	0,00
1.400.000	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650	110	0,00
1.400.000	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800	4.560	0,00

**Währungsoptionen insgesamt 51.384 0,01**

<b>Swaptions - 3.076</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.796.724)</b>			
116.800.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Put 16-Mar-2022 1.100	3.076	0,00

**Swaptions insgesamt 3.076 0,00**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 554.831</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 235.371)</b>				
82	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	9.245.298	235.082	0,05
(27)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(5.015.153)	72.210	0,02
(388)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(49.487.948)	51.378	0,01
59	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	5.973.823	688	0,00
(50)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(7.321.875)	35.133	0,01
27	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	3.266.367	2.698	0,00
206	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	33.050.125	60.292	0,02
(77)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(13.017.505)	97.350	0,02

**Offene Terminkontrakte insgesamt 554.831 0,13**

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.515.790 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.463.873) 1.515.790 0,34

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 440.596.139 99,47**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps - (4.948.648)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (6.839.835))</b>			
1.570.000	CDS Anglo American 5.000% 20-Dec-2026	(344.865)	(0,08)
1.283.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(22.623)	(0,01)
1.750.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(30.441)	(0,01)
83.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(1.444)	(0,00)
61.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(1.076)	(0,00)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Credit Default Swaps Forts.</b>			
1.167.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(20.578)	(0,00)
56.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026	(987)	(0,00)
77.500.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 36 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	(1.978.435)	(0,45)
1.570.000	CDS Glencore Finance Europe SA 5.000% 20-Dec-2026	(334.018)	(0,08)
1.570.000	CDS Heidelbergcement AG 5.000% 20-Dec-2026	(366.037)	(0,08)
1.570.000	CDS Holcim Ltd 1.000% 20-Dec-2026	(24.167)	(0,01)
22.800.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026	(676.274)	(0,15)
5.800.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026	(782.806)	(0,18)
100.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026	(13.497)	(0,00)
2.300.000	CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026	(68.221)	(0,02)
650.000	CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026	(43.607)	(0,01)
1.100.000	CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026	(73.796)	(0,02)
(1.750.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026	(63.142)	(0,01)
(1.500.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026	(54.122)	(0,01)
(17.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2026	(92)	(0,00)
(367.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2026	(1.978)	(0,00)
410.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(5.535)	(0,00)
800.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(10.801)	(0,00)
780.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(10.530)	(0,00)
50.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(675)	(0,00)
800.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(10.801)	(0,00)
50.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(675)	(0,00)
400.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(5.400)	(0,00)
100.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(1.350)	(0,00)
50.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026	(675)	(0,00)

**Credit Default Swaps insgesamt (4.948.648) (1,12)**

<b>Währungsoptionen - (22.245)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (77.804))</b>			
(1.200.000)	Euro/Chinese yuan Call 11-Feb-2022 7.589	(439)	(0,00)
(1.200.000)	Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.280	(11.314)	(0,01)
(1.600.000)	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.105	(79)	(0,00)
(2.400.000)	US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.108	(171)	(0,00)
(1.600.000)	US dollar/Euro Call 21-Jan-2022 1.113	(562)	(0,00)
(1.600.000)	US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.150	(1.580)	(0,00)
(1.600.000)	US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.148	(3.426)	(0,00)
(1.400.000)	US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190	(4)	(0,00)
(1.400.000)	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650	(110)	(0,00)
(1.400.000)	US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800	(4.560)	(0,00)

**Währungsoptionen insgesamt (22.245) (0,01)**

<b>Swaptions - (3.645.519)</b>			
<b>(31. Dezember 2020: (535.648))</b>			
(4.800.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.525	(10.627)	(0,00)
(45.100.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.525	(99.850)	(0,02)
(46.600.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 17-Feb-2022 0.525	(103.170)	(0,03)
(4.800.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.525	(5.341)	(0,00)
(45.100.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.525	(50.184)	(0,01)
(46.600.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 17-Feb-2022 0.525	(51.854)	(0,01)
(116.800.000)	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Call 16-Mar-2022 1.100	(3.324.493)	(0,75)

**Swaptions insgesamt (3.645.519) (0,82)**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (160.987)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (552.754))</b>				
50	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022	7.584.693	(39.205)	(0,01)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte Forts.</b>				
27	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	5.267.832	(90.620)	(0,02)
68	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	8.871.875	(7.867)	(0,00)
125	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022	27.271.484	(16.727)	(0,01)
3	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	591.375	(6.568)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(160.987)</b>	<b>(0,04)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (4.236.892) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.936.892))			(4.236.892)	(0,95)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(13.014.291)</b>	<b>(2,94)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>15.380.106</b>	<b>3,47</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>442.961.954</b>	<b>100,00</b>

– Ein Teil der Beteiligung wird von Citigroup Global Markets Limited als Sicherheit im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Währungsoptionen und Devisenterminkontrakten gehalten. Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, Morgan Stanley, BNP Paribas, Goldman Sachs und JPMorgan Securities Plc. Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Goldman Sachs, Citigroup Global Markets Limited, UBS AG und Morgan Stanley. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs. Die Kontrahenten für Swaptions sind Goldman Sachs, Citigroup Global Markets Limited und BNP Paribas.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,20
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,12
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,59
Sonstiges Umlaufvermögen	4,09
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>							
US-Dollar	Japanischer Yen	38.716	4.450.000	4. Jan. 22	HSBC Bank plc	30	
Euro	US-Dollar	2.342.000	2.652.219	12. Jan. 22	UBS AG	14.592	
Euro	US-Dollar	100.000	112.778	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	1.090	
Euro	US-Dollar	437.000	493.500	12. Jan. 22	Morgan Stanley	4.108	
Euro	US-Dollar	1.145.000	1.291.347	12. Jan. 22	Morgan Stanley	12.453	
Euro	US-Dollar	70.000	79.174	12. Jan. 22	UBS AG	535	
Euro	US-Dollar	151.000	171.001	12. Jan. 22	UBS AG	941	
Euro	US-Dollar	104.000	117.957	12. Jan. 22	Morgan Stanley	467	
Euro	US-Dollar	177.000	199.623	12. Jan. 22	Morgan Stanley	1.925	
Euro	US-Dollar	1.000.000	1.132.048	12. Jan. 22	Morgan Stanley	6.641	
Euro	US-Dollar	5.002.000	5.654.911	12. Jan. 22	BNP Paribas	40.813	
Euro	US-Dollar	2.799.000	3.164.463	12. Jan. 22	UBS AG	22.729	
Euro	US-Dollar	2.931.000	3.313.979	12. Jan. 22	UBS AG	23.520	
Euro	US-Dollar	3.021.000	3.421.573	12. Jan. 22	BNP Paribas	18.407	
Euro	US-Dollar	169.000	191.409	12. Jan. 22	BNP Paribas	1.030	
Euro	US-Dollar	98.000	110.716	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	876	
Euro	US-Dollar	1.629.000	1.840.364	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	14.561	
Euro	US-Dollar	159.000	180.127	12. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	924	
Euro	US-Dollar	57.000	64.440	12. Jan. 22	BNP Paribas	465	
Pfund Sterling	US-Dollar	405.000	536.962	12. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	11.216	
Pfund Sterling	US-Dollar	530.000	704.623	12. Jan. 22	Morgan Stanley	12.745	
US-Dollar	Japanischer Yen	20.440	2.311.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	349	
Australischer Dollar	Neuseeländischer Dollar	700.000	728.453	13. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	10.442	
Australischer Dollar	US-Dollar	1.120.929	800.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	15.556	
Australischer Dollar	US-Dollar	963.876	700.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	1.289	
Australischer Dollar	US-Dollar	965.596	700.000	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	2.540	
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.400.000	242.484	13. Jan. 22	BNP Paribas	8.312	
Kanadischer Dollar	Euro	1.020.709	700.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	9.810	
Chinesischer Yuan	US-Dollar	1.723.698	268.716	13. Jan. 22	BNP Paribas	2.240	
Euro	US-Dollar	707.646	804.749	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	1.056	
Euro	US-Dollar	1.417.500	1.600.000	13. Jan. 22	UBS AG	14.125	
Indische Rupie	US-Dollar	29.973.000	397.741	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	4.811	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	15.012.449	700.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	32.047	
Norwegische Krone	Euro	6.177.182	600.000	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	18.087	
Norwegische Krone	US-Dollar	9.202.852	1.017.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	27.829	
Norwegische Krone	US-Dollar	5.277.491	583.000	13. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	16.170	
Polnischer Zloty	US-Dollar	1.024.974	252.000	13. Jan. 22	UBS AG	2.231	
Russischer Rubel	US-Dollar	3.175.000	41.942	13. Jan. 22	Morgan Stanley	309	
Taiwan-Dollar	US-Dollar	12.444.000	449.540	13. Jan. 22	BNP Paribas	232	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	57.257	72.346	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	65	
US-Dollar	Chilenischer Peso	16.199	13.797.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	25	
US-Dollar	Japanischer Yen	536.256	60.931.650	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	6.515	
US-Dollar	Japanischer Yen	6.200.000	705.250.186	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	68.541	
US-Dollar	Koreanischer Won	237.230	279.323.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	2.344	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	248.033	353.970	13. Jan. 22	BNP Paribas	5.628	
US-Dollar	Russischer Rubel	184.092	13.624.000	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	2.793	
US-Dollar	Schwedische Krone	682.322	6.092.090	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	8.087	
US-Dollar	Taiwan-Dollar	450.043	12.444.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	270	
US-Dollar	Türkische Lira	111.721	1.263.810	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	16.950	
Australischer Dollar	US-Dollar	26.662	19.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	399	
Australischer Dollar	US-Dollar	226.160	162.000	20. Jan. 22	UBS AG	2.551	
Australischer Dollar	US-Dollar	39.297	28.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	592	
Australischer Dollar	US-Dollar	22.365	16.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	273	
Australischer Dollar	US-Dollar	33.228	24.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	177	
Brasilianischer Real	US-Dollar	122.000	21.232	20. Jan. 22	UBS AG	586	
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.012.000	180.415	20. Jan. 22	Morgan Stanley	567	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>						
Brasilianischer Real	US-Dollar	55.000	9.707	20. Jan. 22	BNP Paribas	129
Chilenischer Peso	US-Dollar	34.283.000	39.368	20. Jan. 22	UBS AG	779
Euro	US-Dollar	19.468	22.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	172
Euro	US-Dollar	37.394	42.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	587
Euro	US-Dollar	606.738	685.427	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	5.574
Indische Rupie	US-Dollar	6.136.000	81.955	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	349
Indische Rupie	US-Dollar	178.000	2.377	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	10
Indonesische Rupiah	US-Dollar	106.800.000	7.486	20. Jan. 22	Goldman Sachs	14
Indonesische Rupiah	US-Dollar	7.340.000	512	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	4
Indonesische Rupiah	US-Dollar	69.629.000	4.840	20. Jan. 22	BNP Paribas	50
Indonesische Rupiah	US-Dollar	72.287.000	5.069	20. Jan. 22	UBS AG	8
Indonesische Rupiah	US-Dollar	34.319.000	2.384	20. Jan. 22	BNP Paribas	26
Mexikanischer Peso	US-Dollar	375.723	18.000	20. Jan. 22	UBS AG	299
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	35.454	24.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	278
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	8.771	6.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	6
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	20.785	14.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	233
Norwegische Krone	US-Dollar	72.862	8.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	271
Norwegische Krone	US-Dollar	107.517	12.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	205
Norwegische Krone	US-Dollar	440.394	49.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	993
Norwegische Krone	US-Dollar	180.866	20.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	532
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	97.841	6.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	126
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	257.124	16.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	98
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	192.203	12.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	33
Pfund Sterling	US-Dollar	31.654	42.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	844
Pfund Sterling	US-Dollar	14.389	19.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	475
Pfund Sterling	US-Dollar	17.962	24.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	311
Pfund Sterling	US-Dollar	23.277	31.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	505
Pfund Sterling	US-Dollar	28.538	38.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	627
Schwedische Krone	US-Dollar	253.997	28.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	112
Schwedische Krone	US-Dollar	136.150	15.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	69
Schwedische Krone	US-Dollar	272.563	30.000	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	167
Schwedische Krone	US-Dollar	154.865	17.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	140
Schweizer Franken	US-Dollar	8.304	9.000	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	117
US-Dollar	Kanadischer Dollar	185.318	234.081	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	270
US-Dollar	Kanadischer Dollar	15.000	18.947	20. Jan. 22	Morgan Stanley	21
US-Dollar	Chilenischer Peso	132.075	110.481.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	2.695
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	4.739	19.029.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	69
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	5.397	21.556.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	106
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	9.771	39.325.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	119
US-Dollar	Japanischer Yen	30.000	3.401.524	20. Jan. 22	Morgan Stanley	425
US-Dollar	Japanischer Yen	10.000	1.142.407	20. Jan. 22	UBS AG	67
US-Dollar	Japanischer Yen	35.000	3.981.573	20. Jan. 22	BNP Paribas	382
US-Dollar	Japanischer Yen	12.000	1.379.977	20. Jan. 22	UBS AG	2
US-Dollar	Japanischer Yen	12.000	1.360.384	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	172
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	13.000	18.906	20. Jan. 22	BNP Paribas	54
US-Dollar	Russischer Rubel	13.692	1.015.000	20. Jan. 22	UBS AG	193
US-Dollar	Russischer Rubel	22.983	1.710.000	20. Jan. 22	Morgan Stanley	241
US-Dollar	Russischer Rubel	58.466	4.342.000	20. Jan. 22	UBS AG	720
US-Dollar	Russischer Rubel	8.978	671.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	54

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	309.406	4.916.919	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	1.571
US-Dollar	Türkische Lira	75.170	974.058	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	2.584
						<b>USD</b>
						<b>497.754</b>
US-Dollar	Australischer Dollar	569.038	808.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	(18.839)
US-Dollar	Australischer Dollar	10.082.823	14.317.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	(333.785)
US-Dollar	Euro	2.898.054	2.555.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	(11.297)
US-Dollar	Euro	1.366.719	1.207.000	12. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(7.679)
US-Dollar	Euro	2.094.668	1.852.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(14.185)
US-Dollar	Euro	33.842.472	30.032.000	12. Jan. 22	Goldman Sachs	(354.648)
US-Dollar	Euro	33.841.839	30.033.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	(356.420)
US-Dollar	Euro	1.615.890	1.434.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	(16.990)
US-Dollar	Euro	1.615.946	1.434.000	12. Jan. 22	Goldman Sachs	(16.934)
US-Dollar	Euro	33.840.799	30.032.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(356.321)
US-Dollar	Euro	10.060.072	8.880.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(51.490)
US-Dollar	Euro	33.841.292	30.032.000	12. Jan. 22	HSBC Bank plc	(355.828)
US-Dollar	Euro	1.614.736	1.433.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	(17.006)
US-Dollar	Euro	1.615.867	1.434.000	12. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(17.014)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.259.872	949.000	12. Jan. 22	Goldman Sachs	(24.622)
US-Dollar	Pfund Sterling	26.193.126	19.730.000	12. Jan. 22	Goldman Sachs	(511.908)
US-Dollar	Pfund Sterling	26.180.069	19.720.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	(511.429)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.258.555	948.000	12. Jan. 22	Morgan Stanley	(24.586)
Chilenischer Peso	US-Dollar	25.416.000	30.083	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(29.940)
Euro	Norwegische Krone	600.000	6.150.812	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(15.094)
Ungarischer Forint	US-Dollar	19.714.102	616.000	13. Jan. 22	BNP Paribas	(8.924)
Indonesische Rupiah	US-Dollar	4.372.000.000	308.341	13. Jan. 22	UBS AG	(1.436)
Japanischer Yen	US-Dollar	704.940.496	6.200.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(71.234)
Koreanischer Won	US-Dollar	279.323.000	235.398	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(512)
Neuseeländischer Dollar	Australischer Dollar	728.144	700.000	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(10.654)
Russischer Rubel	US-Dollar	10.415.000	140.979	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(2.383)
Russischer Rubel	US-Dollar	671.000	8.995	13. Jan. 22	BNP Paribas	(66)
Schwedische Krone	Euro	6.071.112	600.000	13. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(11.314)
Türkische Lira	US-Dollar	1.263.810	97.932	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(3.161)
US-Dollar	Australischer Dollar	800.000	1.122.471	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(16.678)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.757.805	2.424.582	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(6.252)
US-Dollar	Brasilianischer Real	237.985	1.338.000	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(1.705)
US-Dollar	Chilenischer Peso	13.390	11.619.000	13. Jan. 22	UBS AG	(230)
US-Dollar	Tschechische Krone	71.033	1.599.306	13. Jan. 22	BNP Paribas	(2.102)
US-Dollar	Euro	1.383.033	1.225.383	13. Jan. 22	UBS AG	(12.326)
US-Dollar	Euro	842.091	745.000	13. Jan. 22	Morgan Stanley	(6.250)
US-Dollar	Euro	1.400.000	1.243.614	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(16.120)
US-Dollar	Euro	22.112.836	19.545.491	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(143.868)
US-Dollar	Ungarischer Forint	308.000	100.658.188	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(1.965)
US-Dollar	Ungarischer Forint	288.120	93.896.387	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(1.022)
US-Dollar	Indische Rupie	395.422	29.973.000	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(7.129)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	303.632	4.372.000.000	13. Jan. 22	Goldman Sachs	(3.273)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	700.000	15.144.712	13. Jan. 22	BNP Paribas	(38.497)
US-Dollar	Norwegische Krone	4.176	37.115	13. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(38)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.392.871	12.292.700	13. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(2.759)
US-Dollar	Polnischer Zloty	308.447	1.283.334	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(9.866)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.198.913	6.092.010	13. Jan. 22	HSBC Bank plc	(46.751)
Chilenischer Peso	US-Dollar	3.989.000	4.673	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(2)
Chilenischer Peso	US-Dollar	13.797.000	16.185	20. Jan. 22	BNP Paribas	(28)
Chilenischer Peso	US-Dollar	13.279.000	16.010	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(460)
Chilenischer Peso	US-Dollar	36.173.000	44.311	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(1.950)
Chilenischer Peso	US-Dollar	14.012.000	16.558	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(149)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	185.112.000	46.763	20. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(1.327)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	49.917.000	12.770	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(517)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	51.580.000	12.981	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(321)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>						
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	41.774.000	10.437	20. Jan. 22	BNP Paribas	(184)
Japanischer Yen	US-Dollar	26.180.384	229.701	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(2.075)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	77.723	54.385	20. Jan. 22	BNP Paribas	(1.163)
Russischer Rubel	US-Dollar	10.240.000	137.633	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.447)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	4.7644	3.000	20. Jan. 22	UBS AG	(17)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	159.004	10.000	20. Jan. 22	UBS AG	(45)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	4.011.761	252.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(835)
Schwedische Krone	US-Dollar	921.157	102.745	20. Jan. 22	UBS AG	(791)
Schwedische Krone	US-Dollar	207.295	23.000	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(57)
Türkische Lira	US-Dollar	974.058	84.686	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(12.100)
US-Dollar	Australischer Dollar	15.000	20.831	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(157)
US-Dollar	Australischer Dollar	338.146	465.816	20. Jan. 22	Citigroup Global Markets Limited	(776)
US-Dollar	Brasilianischer Real	14.788	84.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(234)
US-Dollar	Brasilianischer Real	2.090	12.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(56)
US-Dollar	Brasilianischer Real	9.323	53.000	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(155)
US-Dollar	Brasilianischer Real	7.070	40.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(84)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	6.000	7.723	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(105)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	132.000	170.347	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.665)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	24.000	30.595	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(186)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	21.000	26.931	20. Jan. 22	UBS AG	(290)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	27.000	34.284	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(103)
US-Dollar	Euro	16.000	14.157	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(123)
US-Dollar	Euro	6.000	5.289	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(24)
US-Dollar	Euro	15.000	13.299	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(146)
US-Dollar	Indische Rupie	11.523	868.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(120)
US-Dollar	Indische Rupie	17.186	1.302.000	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	(279)
US-Dollar	Indische Rupie	5.151	386.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(26)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	3.713	53.633.000	20. Jan. 22	BNP Paribas	(53)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.000	230.095	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	30.000	633.744	20. Jan. 22	UBS AG	(866)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	6.000	129.453	20. Jan. 22	HSBC Bank plc	(305)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	10.000	207.181	20. Jan. 22	Goldman Sachs	(90)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	13.000	282.085	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(738)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	22.000	469.901	20. Jan. 22	BNP Paribas	(886)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	34.934	736.771	20. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(949)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	19.000	28.047	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(206)
US-Dollar	Norwegische Krone	6.000	53.457	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(68)
US-Dollar	Norwegische Krone	83.431	744.129	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.042)
US-Dollar	Russischer Rubel	41.879	317.500	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(346)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	3.000	47.953	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	311.889	231.858	20. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(1.930)
US-Dollar	Schwedische Krone	35.000	319.274	20. Jan. 22	UBS AG	(337)
US-Dollar	Schweizer Franken	13.000	11.942	20. Jan. 22	UBS AG	(111)
US-Dollar	Schweizer Franken	198.482	183.744	20. Jan. 22	BNP Paribas	(3.254)
US-Dollar	Schweizer Franken	14.000	12.928	20. Jan. 22	BNP Paribas	(193)
US-Dollar	Schweizer Franken	22.000	20.194	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(171)
US-Dollar	Schweizer Franken	25.000	23.055	20. Jan. 22	UBS AG	(313)
US-Dollar	Schweizer Franken	7.000	6.535	20. Jan. 22	Morgan Stanley	(175)
US-Dollar	Brasilianischer Real	731.823	4.158.000	2. Feb. 22	HSBC Bank plc	(9.416)
<b>USD</b>						<b>(3.493.328)</b>

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)</b>						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	371.446.463	292.750.302	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	891.777
<b>USD</b>						<b>891.777</b>
<b>CAD</b>						<b>1.128.053</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	22.488	25.427	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	181
Euro	US-Dollar	15.878.757	17.969.788	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111.932
<b>USD</b>						<b>112.113</b>
<b>EUR</b>						<b>98.474</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)</b>						
US-Dollar	Japanischer Yen	34.615	3.960.000	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	190
<b>USD</b>						<b>190</b>
<b>JPY</b>						<b>21.856</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	41.970.000	366.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.094)
Japanischer Yen	US-Dollar	140.000.000	1.227.567	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10.395)
Japanischer Yen	US-Dollar	80.000	701	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
Japanischer Yen	US-Dollar	162.450.000	1.430.165	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17.810)
Japanischer Yen	US-Dollar	150.000.000	1.319.713	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15.600)
Japanischer Yen	US-Dollar	3.500.000.000	30.830.944	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(401.629)
Japanischer Yen	US-Dollar	2.280.000	20.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(287)
Japanischer Yen	US-Dollar	1.680.000	14.788	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(182)
Japanischer Yen	US-Dollar	2.473.853.499	21.803.067	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(295.162)
Japanischer Yen	US-Dollar	3.960.000	34.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(191)
US-Dollar	Japanischer Yen	340.033	39.132.446	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(188)
<b>USD</b>						<b>(743.544)</b>
<b>JPY</b>						<b>(85.529.866)</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	430.112	568.208	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13.956
<b>USD</b>						<b>13.956</b>
<b>GBP</b>						<b>10.311</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	2.325	1.733	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)
<b>USD</b>						<b>(20)</b>
<b>GBP</b>						<b>(15)</b>

# BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Pfund Sterling - 6.620.068</b>				<b>Euro Forts.</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.139.869)</b>				<b>(31. Dezember 2020: 712.716)</b>			
3.346.151	BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	6.620.068	1,53	1.063.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.750% 22-May-2025	1.198.814	0,28
<b>US-Dollar - 13.148.875</b>				1.480.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	1.723.299	0,40
<b>(31. Dezember 2020: 20.977.824)</b>				1.817.000	Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029	2.079.503	0,48
2.635.811	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	13.148.875	3,04	1.201.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 4.375% 07-Feb-2025	1.366.863	0,32
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				6.216.609	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	7.527.755	1,74
<b>19.768.943</b>				362.000	Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029	418.936	0,10
<b>Anleihen</b>				579.000	H&M Finance BV 'EMTN' 0.250% 25-Aug-2029	635.914	0,15
<b>Australischer Dollar - 11.217.279</b>				1.548.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	1.658.104	0,38
<b>(31. Dezember 2020: 35.033.821)</b>				1.043.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	1.247.373	0,29
3.990.000	Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025	4.322.639	1,00	1.029.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 2.500% 15-Jan-2026	1.161.093	0,27
9.470.000	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	6.894.640	1,59	1.300.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	1.530.630	0,35
<b>Kanadischer Dollar - 28.568.852</b>				500.000	Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028	618.528	0,14
<b>(31. Dezember 2020: 12.331.555)</b>				1.132.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	1.319.564	0,30
21.200.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	17.000.030	3,93	1.259.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	1.380.967	0,32
5.715.000	Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	4.490.237	1,04	1.015.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025	1.258.817	0,29
6.171.452	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	7.078.585	1,63	1.233.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	1.425.283	0,33
<b>Kolumbianischer Peso - 5.579.121</b>				1.200.000	Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026	1.352.013	0,31
<b>(31. Dezember 2020: 4.972.277)</b>				1.170.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 3.125% 15-Sep-2026	1.325.324	0,31
8.829.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	1.966.882	0,46	1.860.000	Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026	2.068.979	0,48
15.942.800.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	3.612.239	0,83	1.214.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	1.346.290	0,31
<b>Tschechische Krone - 8.637.981</b>				1.713.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	1.922.215	0,44
<b>(31. Dezember 2020: 5.233.204)</b>				810.000	Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028	921.287	0,21
101.190.000	Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	4.349.690	1,00	1.616.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028	1.840.721	0,43
100.480.000	Czech Republic Government Bond 1.250% 14-Feb-2025	4.288.291	0,99	1.200.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	1.408.549	0,33
<b>Euro - 86.814.206</b>				898.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	1.032.756	0,24
<b>(31. Dezember 2020: 106.255.413)</b>				300.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1.625% 17-Jun-2032	355.158	0,08
800.000	ADLER Group SA 2.250% 27-Apr-2027	765.493	0,18	3.930.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	4.601.945	1,06
1.100.000	ADLER Group SA 3.250% 05-Aug-2025	1.080.846	0,25	1.655.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0.000% 07-Jul-2023	1.878.954	0,43
1.800.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025	2.257.831	0,52	996.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	1.096.832	0,25
2.092.000	Akelius Residential Property AB FRN 2.249% 17-May-2081	2.315.952	0,53	315.000	SELP Finance Sarl 1.250% 25-Oct-2023	363.683	0,08
398.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026	456.247	0,11	1.356.917	Silverback Finance DAC 3.126% 25-Feb-2037	1.603.313	0,37
1.190.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	1.341.871	0,31	1.550.000	SoftBank Group Corp 2.875% 06-Jan-2027	1.667.764	0,39
818.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029	908.688	0,21	1.438.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	1.700.615	0,39
1.200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-May-2022	1.382.804	0,32	300.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.000% 04-Sep-2023	350.879	0,08
1.000.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023	1.188.499	0,27	900.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	1.096.950	0,25
1.494.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	1.701.866	0,39	1.485.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	1.743.626	0,40
1.730.000	Bank of Ireland Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 19-May-2025	2.269.048	0,52	1.541.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	1.749.841	0,40
972.000	BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	1.116.661	0,26	1.260.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	1.368.017	0,32
500.000	CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 05-Feb-2027	554.816	0,13	1.240.000	United Group BV 'REGS' 4.875% 01-Jul-2024	1.422.063	0,33
1.370.000	Carnival Corp 1.875% 07-Nov-2022	1.524.073	0,35	976.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027	1.104.542	0,26
1.098.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028	1.212.914	0,28	100.000	Vivion Investments Sarl 3.000% 08-Aug-2024	112.302	0,03
408.000	Cedacri Mergesco SPA 'REGS' FRN 4.625% 15-May-2028	466.023	0,11	305.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 2.500% 20-Mar-2022	346.826	0,08
1.000.000	Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029	1.127.346	0,26	1.700.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029	2.102.129	0,49
617.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	708.212	0,16	<b>Indische Rupie - 3.117.921</b>			
				<b>(31. Dezember 2020: 712.716)</b>			
				50.000.000	Housing Development Finance Corp Ltd 'EMTN' 8.220% 28-Mar-2022	676.055	0,16
				176.790.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	2.441.866	0,56



## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Indonesische Rupiah - 5.573.775</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.670.298)</b>			
30.750.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022	2.196.643	0,51
45.466.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	3.377.132	0,78
<b>Japanischer Yen - 6.696.264</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 21.164.701)</b>			
498.950.000	Japan Government Two Year Bond 0.005% 01-Nov-2023	4.342.755	1,00
261.729.594	Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	2.353.509	0,55
<b>Malaysischer Ringgit - 3.260.921</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.193.559)</b>			
13.690.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	3.260.921	0,75
<b>Mexikanischer neuer Peso - 7.140.918</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.599.734)</b>			
60.850.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	3.011.647	0,70
79.710.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	4.129.271	0,95
<b>Neuseeländischer Dollar - 11.395.641</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.843.063)</b>			
3.010.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	2.110.374	0,49
5.100.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	4.876.398	1,12
3.220.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	2.201.328	0,51
3.090.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.500% 15-Apr-2023	2.207.541	0,51
<b>Pfund Sterling - 42.070.811</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 38.046.193)</b>			
176.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	239.774	0,06
1.627.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	2.116.114	0,49
1.633.000	Coventry Building Society 'EMTN' 1.000% 21-Sep-2025	2.160.284	0,50
1.374.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024	2.023.099	0,47
1.560.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	2.110.141	0,49
1.009.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	1.355.983	0,31
3.700.000	Dexia Credit Local SA 0.500% 22-Jul-2023	4.958.151	1,14
515.000	Heathrow Finance Plc 6.250% 03-Mar-2025	736.904	0,17
1.055.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	1.333.075	0,31
1.068.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024	1.508.911	0,35
592.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	809.435	0,19
950.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 5.250% 15-Jan-2027	1.301.037	0,30
1.830.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024	2.554.815	0,59
1.107.599	Mitchells & Butlers Finance Plc 6.013% 15-Dec-2028	1.618.913	0,37
1.540.000	National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023	2.118.845	0,49
545.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	750.696	0,17
2.200.000	Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2024	3.205.635	0,74
1.618.000	Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026	2.130.901	0,49
402.000	Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021	530.359	0,12
979.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' 8.250% 31-Jul-2025	1.341.070	0,31
475.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	608.438	0,14
829.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	1.119.569	0,26
1.043.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	1.383.628	0,32
822.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2028	1.174.036	0,27

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Pfund Sterling Forts.</b>			
2.120.000	Yorkshire Building Society FRN 0.739% 19-Nov-2023	2.880.998	0,67
<b>Schwedische Krone - 1.703.660</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.691.729)</b>			
15.000.000	Stadshypotek AB 1.500% 01-Mar-2024	1.703.660	0,39
<b>US-Dollar - 151.993.761</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 173.313.541)</b>			
210.000	Agile Group Holdings Ltd 4.850% 31-Aug-2022	136.542	0,03
1.560.000	Agile Group Holdings Ltd 6.700% 07-Mar-2022	1.251.900	0,29
1.108.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	1.375.410	0,32
1.500.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	1.492.627	0,34
4.770.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026	4.953.565	1,14
2.445.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 4.250% 25-Jan-2028	2.390.027	0,55
1.217.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	1.184.470	0,27
2.100.000	Bank of Montreal 'REGS' 2.100% 15-Jun-2022	2.116.751	0,49
1.072.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Aug-2025	1.218.805	0,28
1.310.000	Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028	1.205.213	0,28
899.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026	924.788	0,21
1.730.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	1.726.393	0,40
2.980.000	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	3.036.471	0,70
1.397.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	1.440.789	0,33
1.720.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Sep-2025	1.890.332	0,44
1.300.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023	1.407.292	0,33
2.090.000	DNB Boligkredit AS 'REGS' 2.500% 28-Mar-2022	2.100.624	0,49
1.480.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	1.508.135	0,35
1.685.000	Drax Finco Plc 'REGS' 6.625% 01-Nov-2025	1.739.324	0,40
126.496	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	71.470	0,02
442.650	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040	259.227	0,06
965.835	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035	636.244	0,15
4.850.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	4.856.305	1,12
1.340.000	First Quantum Minerals Ltd '144A' 6.875% 01-Mar-2026	1.393.493	0,32
2.022.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.370% 17-Nov-2023	2.077.403	0,48
983.000	GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS' 4.250% 27-Oct-2027	952.616	0,22
1.320.000	Greenland Global Investment Ltd 'EMTN' 6.125% 22-Apr-2023	1.003.200	0,23
3.476.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023	3.483.310	0,80
1.145.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	1.134.976	0,26
1.230.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	1.307.183	0,30
2.100.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2024	2.269.312	0,52
3.840.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	3.842.399	0,89
3.680.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.440% 17-Jun-2024	3.706.062	0,86
5.010.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027	5.066.736	1,17
3.020.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	2.976.723	0,69
1.909.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	1.932.863	0,45
2.700.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	2.739.256	0,63
2.684.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026	2.777.861	0,64
500.000	KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01-Sep-2023	385.000	0,09
464.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	471.540	0,11

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar Forts.</b>			
210.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 6.750% 27-Jun-2026	236.824	0,05
1.880.000	Lumen Technologies Inc 5.800% 15-Mar-2022	1.896.478	0,44
1.310.000	Mausser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	1.323.716	0,31
1.135.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	1.145.243	0,26
1.740.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027	1.642.027	0,38
932.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024	1.029.905	0,24
1.419.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029	1.414.743	0,33
1.557.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Dec-2025	1.707.749	0,39
1.000.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 10-Aug-2025	1.164.220	0,27
1.844.000	Oman Government International Bond 'REGS' 4.875% 01-Feb-2025	1.922.853	0,44
2.070.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	2.166.793	0,50
1.480.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025	1.571.967	0,36
1.285.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	1.302.630	0,30
3.570.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 4.750% 20-Feb-2024	3.721.264	0,86
600.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 5.375% 20-Feb-2029	638.467	0,15
3.340.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' FRN 0.620% 27-Apr-2026	3.337.844	0,77
504.000	Shimao Group Holdings Ltd 3.975% 16-Sep-2023	334.026	0,08
1.560.000	Shimao Group Holdings Ltd 4.750% 03-Jul-2022	1.115.400	0,26
1.895.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN' 3.000% 20-Jul-2026	1.931.291	0,45
2.150.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Dec-2023	2.340.813	0,54
1.760.000	Stadshypotek AB 'REGS' 2.500% 05-Apr-2022	1.769.948	0,41
1.039.000	Sunac China Holdings Ltd 7.250% 14-Jun-2022	782.367	0,18
1.271.000	T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	1.297.640	0,30
2.200.000	UBS Group AG FRN (Perpetual) 5.000% 31-Jan-2023	2.206.105	0,51
600.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024	657.363	0,15
13.030.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023	13.033.054	3,01
4.126.760	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.639.456	1,07
4.207.972	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	4.402.671	1,02
4.360.000	United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	4.362.044	1,01
2.078.000	Verizon Communications Inc FRN 0.840% 20-Mar-2026	2.104.570	0,49
236.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	255.925	0,06
990.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	972.220	0,22
549.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	664.306	0,15
1.837.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	1.821.413	0,42
1.395.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	1.481.462	0,34
1.360.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026	1.268.193	0,29
1.840.000	Ziggo BV '144A' 5.500% 15-Jan-2027	1.888.134	0,44
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>373.771.111</b>	<b>86,32</b>
<b>Optionen auf Futures - 217.313</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 54.375)</b>			
372	U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000	110.438	0,03
152	U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000	106.875	0,02
<b>Optionen auf Futures insgesamt</b>		<b>217.313</b>	<b>0,05</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 410.313</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (10.800))</b>				
(92)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(15.308.186)	184.673	0,04
(48)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(9.310.330)	135.740	0,03
(147)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(32.064.375)	27.935	0,01
(32)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(5.386.522)	61.965	0,01
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>410.313</b>	<b>0,09</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 5.430.962 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 3.068.650)			5.430.962	1,25
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>399.598.642</b>	<b>92,28</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.874.889) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (5.173.432))			(1.874.889)	(0,43)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(1.874.889)</b>	<b>(0,43)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>35.269.740</b>	<b>8,15</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>432.993.493</b>	<b>100,00</b>
Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.				
<b>Portfolioanalyse</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			89,69	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente			0,14	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			1,24	
Sonstiges Umlaufvermögen			8,93	
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>						
Euro	US-Dollar	545.903	613.487	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	4.949
Euro	US-Dollar	4.600.000	5.167.957	18. Feb. 22	State Street Bank	43.238
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	9.247.019	2.186.677	18. Feb. 22	State Street Bank	32.881
Mexikanischer Peso	US-Dollar	5.809.453	273.503	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	8.500
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	9.142.947	6.185.990	18. Feb. 22	State Street Bank	55.946
Polnischer Zloty	US-Dollar	18.100.000	4.387.081	18. Feb. 22	State Street Bank	58.036
Pfund Sterling	US-Dollar	220.715	293.431	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	3.955
Pfund Sterling	US-Dollar	587.019	790.563	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	374
Pfund Sterling	US-Dollar	1.009.689	1.358.863	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	1.571
Pfund Sterling	US-Dollar	5.959.658	7.965.679	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	64.238
US-Dollar	Australischer Dollar	2.895.706	3.922.087	18. Feb. 22	State Street Bank	51.849
US-Dollar	Australischer Dollar	8.841.726	12.001.670	18. Feb. 22	State Street Bank	139.461
US-Dollar	Kanadischer Dollar	4.488.076	5.715.000	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	1.483
US-Dollar	Kanadischer Dollar	24.781.879	30.900.475	18. Feb. 22	State Street Bank	523.285
US-Dollar	Euro	419.402	369.736	18. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	540
US-Dollar	Euro	208.945	180.074	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	4.945
US-Dollar	Euro	108.022.551	93.440.910	18. Feb. 22	State Street Bank	2.166.281
US-Dollar	Japanischer Yen	2.395.886	272.580.487	18. Feb. 22	State Street Bank	27.259
US-Dollar	Japanischer Yen	4.385.856	500.283.767	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	38.569
US-Dollar	Koreanischer Won	4.450.687	5.270.860.000	18. Feb. 22	State Street Bank	19.143
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	20.474.146	28.933.446	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	721.136
US-Dollar	Philippinischer Peso	6.532.207	331.431.100	18. Feb. 22	State Street Bank	98.571
US-Dollar	Sudafrikanischer Rand	6.304.955	97.839.244	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	221.903
US-Dollar	Sudafrikanischer Rand	519.850	8.300.000	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	2.750
US-Dollar	Schwedische Krone	13.283.635	113.910.356	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	707.795
<b>USD</b>						<b>4.998.658</b>
Euro	US-Dollar	1.161.848	1.318.490	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(2.268)
Euro	US-Dollar	880.000	998.469	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.545)
Euro	US-Dollar	957.682	1.091.389	18. Feb. 22	State Street Bank	(6.461)
Euro	US-Dollar	6.048.494	6.853.458	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(1.309)
Ungarischer Forint	US-Dollar	2.165.969.865	6.912.283	18. Feb. 22	State Street Bank	(312.033)
Japanischer Yen	US-Dollar	737.002.743	6.537.387	18. Feb. 22	State Street Bank	(133.096)
Koreanischer Won	US-Dollar	5.270.857.000	4.436.375	18. Feb. 22	State Street Bank	(4.833)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	12.737.227	8.995.539	18. Feb. 22	State Street Bank	(299.770)
Schwedische Krone	US-Dollar	41.897.813	4.885.906	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(260.337)
Schwedische Krone	US-Dollar	58.568.793	6.538.323	18. Feb. 22	State Street Bank	(72.258)
US-Dollar	Tschechische Krone	9.040.794	199.882.819	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(20.975)
US-Dollar	Euro	6.934.949	6.147.748	18. Feb. 22	State Street Bank	(29.842)
US-Dollar	Euro	6.744.972	5.975.337	18. Feb. 22	State Street Bank	(24.299)
US-Dollar	Indische Rupie	3.191.080	239.538.426	18. Feb. 22	State Street Bank	(15.224)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.800.771	83.681.340.000	18. Feb. 22	State Street Bank	(67.634)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	5.486.258	22.998.393	18. Feb. 22	State Street Bank	(34.036)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.653.315	34.616.762	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(27.055)
US-Dollar	Pfund Sterling	66.171.754	49.231.273	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(161.423)
<b>USD</b>						<b>(1.474.198)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	2.887.484	3.262.806	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.064

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	4.467	3.943	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
<b>USD</b>						<b>6.067</b>
<b>EUR</b>						<b>5.360</b>
Euro	US-Dollar	4.988	5.650	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	13.349	11.822	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(34)
<b>USD</b>						<b>(38)</b>
<b>EUR</b>						<b>(34)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	302.868	342.235	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	636
<b>USD</b>						<b>636</b>
<b>EUR</b>						<b>562</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	7.184.711	8.118.597	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	15.089
US-Dollar	Euro	13.760	12.145	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11
US-Dollar	Euro	49.368	43.577	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	35
US-Dollar	Euro	2.270	2.004	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
<b>USD</b>						<b>15.137</b>
<b>EUR</b>						<b>13.374</b>
US-Dollar	Euro	68.947	60.964	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(70)
<b>USD</b>						<b>(70)</b>
<b>EUR</b>						<b>(62)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	1.369.081	1.547.038	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.875
US-Dollar	Euro	24.954	22.027	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	17
<b>USD</b>						<b>2.892</b>
<b>EUR</b>						<b>2.555</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	58.057.234	65.603.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	121.928
Euro	US-Dollar	11.552.610	13.061.764	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16.745
US-Dollar	Euro	28.270	24.950	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	25
<b>USD</b>						<b>138.698</b>
<b>EUR</b>						<b>122.541</b>
US-Dollar	Euro	13.057.843	11.552.610	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17.983)
Euro	US-Dollar	159.500	180.696	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(129)
US-Dollar	Euro	2.820	2.498	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged) Forts.</b>							
US-Dollar	Euro	142.372	125.900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(157)
<b>USD</b>							<b>(18.277)</b>
<b>EUR</b>							<b>(16.148)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)</b>							
US-Dollar	Euro	3.989	3.522	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3
Euro	US-Dollar	2.271	2.568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3
Euro	US-Dollar	12.552	14.174	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		36
Euro	US-Dollar	2.510	2.832	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		10
Euro	US-Dollar	378	426	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	10.195.482	11.520.716	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		21.412
<b>USD</b>							<b>21.465</b>
<b>EUR</b>							<b>18.965</b>
Euro	US-Dollar	3.414	3.868	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(3)
Euro	US-Dollar	3.522	3.990	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(3)
US-Dollar	Euro	6.170	5.471	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(23)
<b>USD</b>							<b>(29)</b>
<b>EUR</b>							<b>(26)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)</b>							
Japanischer Yen	US-Dollar	2.020.449.147	17.809.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(256.983)
<b>USD</b>							<b>(256.983)</b>
<b>JPY</b>							<b>(29.583.883)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Inc) (Hedged)</b>							
US-Dollar	Japanischer Yen	13.067	1.485.179	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		164
<b>USD</b>							<b>164</b>
<b>JPY</b>							<b>18.880</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	984.910.965	8.681.476	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(125.272)
<b>USD</b>							<b>(125.272)</b>
<b>JPY</b>							<b>(14.421.313)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse SGD I (Acc) (Hedged)</b>							
Singapur-Dollar	US-Dollar	10.007	7.330	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		83
<b>USD</b>							<b>83</b>
<b>SGD</b>							<b>112</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	2.350	3.158	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		9
US-Dollar	Pfund Sterling	46	34	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		-
Pfund Sterling	US-Dollar	49	65	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	94	124	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3
Pfund Sterling	US-Dollar	34	46	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		-
Pfund Sterling	US-Dollar	631	848	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2
Pfund Sterling	US-Dollar	8.726.183	11.512.601	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		246.533
<b>USD</b>							<b>246.548</b>
<b>GBP</b>							<b>182.953</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	848	631	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	233	173	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	833	627	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.159	2.350	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(8)
<b>USD</b>							<b>(22)</b>
<b>GBP</b>							<b>(16)</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	10.855	14.321	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		307
<b>USD</b>							<b>307</b>
<b>GBP</b>							<b>228</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	10.856	14.322	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		307
<b>USD</b>							<b>307</b>
<b>GBP</b>							<b>228</b>

# BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Argentinien - 2.751.785</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.538.888)</b>			
4.848	Globant SA	1.528.817	2,88
902	MercadoLibre Inc	1.222.968	2,31
<b>Brasilien - 590.098</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 230.741)</b>			
295.049	B3 SA - Brasil Bolsa Balcão	590.098	1,11
<b>China - 18.389.535</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 20.093.835)</b>			
81.172	Alibaba Group Holding Ltd	1.237.094	2,33
10.263	Autohome Inc ADR	303.323	0,57
6.871	Bilibili Inc ADR	328.159	0,62
351.200	By-health Co Ltd	1.485.341	2,80
333.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	443.667	0,84
163.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	827.191	1,56
52.300	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	862.496	1,63
138.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	424.263	0,80
102.580	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	1.387.321	2,62
34.669	Meituan '144A'	1.002.502	1,89
166.400	NARI Technology Co Ltd 'A'	1.045.262	1,97
41.800	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	645.357	1,22
163.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	1.174.162	2,21
136.200	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1.466.105	2,76
9.400	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	561.904	1,06
34.100	Sungrow Power Supply Co Ltd	780.116	1,47
42.248	Tencent Holdings Ltd	2.474.198	4,66
104.787	Tencent Music Entertainment Group ADR	718.315	1,35
24.815	Yum China Holdings Inc	1.222.759	2,31
<b>Hongkong - 1.911.597</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.500.173)</b>			
189.600	AIA Group Ltd	1.911.597	3,61
<b>Ungarn - 509.442</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
10.013	OTP Bank Nyrt	509.442	0,96
<b>Indien - 13.962.309</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.797.858)</b>			
29.255	Asian Paints Ltd	1.331.930	2,51
70.935	Godrej Consumer Products Ltd	923.216	1,74
13.833	HDFC Asset Management Co Ltd '144A'	455.637	0,86
48.531	HDFC Bank Ltd	966.743	1,83
32.446	Hindustan Unilever Ltd	1.030.354	1,94
67.892	Housing Development Finance Corp Ltd	2.361.678	4,45
24.313	Info Edge India Ltd	1.823.099	3,44
24.058	Jubilant Foodworks Ltd	1.161.520	2,19
11.684	Maruti Suzuki India Ltd	1.166.425	2,20
43.625	PB Fintech Ltd	560.383	1,06
32.086	Tata Consultancy Services Ltd	1.613.663	3,04
16.751	Titan Co Ltd	567.661	1,07
<b>Japan - 1.240.358</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
13.100	Advantest Corp	1.240.358	2,34
<b>Mexiko - 876.155</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
234.788	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	876.155	1,65
<b>Niederlande - 1.430.921</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 826.842)</b>			
1.784	ASML Holding NV	1.430.921	2,70
<b>Republik Korea - 2.966.900</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.367.637)</b>			
1.389	LG Chem Ltd	719.184	1,36
421	LG Household & Health Care Ltd	388.329	0,73
3.372	Samsung SDI Co Ltd	1.859.387	3,50

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Russland - 870.050</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 396.567)</b>			
16.785	HeadHunter Group Plc ADR	870.050	1,64
<b>Südafrika - 595.960</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 970.777)</b>			
30.089	Clicks Group Ltd	595.960	1,12
<b>Taiwan - 3.539.433</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.329.481)</b>			
40.000	Elite Material Co Ltd	402.646	0,76
141.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.136.787	5,91
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 2.849.029</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.586.230)</b>			
2.432	EPAM Systems Inc	1.636.906	3,09
48.945	Livent Corp	1.212.123	2,28
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>52.483.572</b>	<b>98,95</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.329 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 28.662)		2.329	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>52.485.901</b>	<b>98,95</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (255) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.162))		(255)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(255)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>554.036</b>	<b>1,05</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>53.039.682</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
			<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			98,47
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,00
Sonstiges Umlaufvermögen			1,53
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>							
US-Dollar	Brasilianischer Real	7.886	44.096	3. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(31)	
Euro	US-Dollar	3.159	3.581	4. Jan. 22	State Street Bank	(5)	
<b>USD</b>						<b>(36)</b>	
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	3.152	3.568	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	555.009	627.151	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.166	
US-Dollar	Euro	6.880	6.075	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
<b>USD</b>						<b>1.169</b>	
<b>EUR</b>						<b>1.033</b>	
Euro	US-Dollar	1.190	1.348	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
Euro	US-Dollar	4.713	5.338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
Euro	US-Dollar	6.844	7.756	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
US-Dollar	Euro	3.710	3.286	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)	
US-Dollar	Euro	10.191	9.015	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)	
US-Dollar	Euro	11.241	9.959	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(34)	
US-Dollar	Euro	7.372	6.534	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(25)	
US-Dollar	Euro	5.445	4.828	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)	
<b>USD</b>						<b>(115)</b>	
<b>EUR</b>						<b>(102)</b>	
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	3.144	3.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	550.958	622.573	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.157	
US-Dollar	Euro	6.813	6.015	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
<b>USD</b>						<b>1.160</b>	
<b>EUR</b>						<b>1.025</b>	
Euro	US-Dollar	4.724	5.350	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
Euro	US-Dollar	6.851	7.764	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
US-Dollar	Euro	10.069	8.908	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)	
US-Dollar	Euro	11.144	9.874	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(34)	
US-Dollar	Euro	7.302	6.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(25)	
US-Dollar	Euro	5.339	4.734	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)	
<b>USD</b>						<b>(104)</b>	
<b>EUR</b>						<b>(92)</b>	

# BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>China - 9.597.381</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 23.105.318)</b>			
372.136	Alibaba Group Holding Ltd	5.671.503	1,12
545.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	3.925.878	0,78
<b>Dänemark - 6.457.303</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
78.687	Novozymes A/S	6.457.303	1,28
<b>Frankreich - 9.829.857</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.747.284)</b>			
12.221	L'Oreal SA	5.796.789	1,14
299.370	Vivendi SE	4.033.068	0,80
<b>Deutschland - 27.095.077</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 33.513.913)</b>			
70.219	Bayer AG	3.740.206	0,74
44.859	Continental AG	4.729.568	0,93
67.875	Deutsche Post AG	4.329.052	0,86
62.736	SAP SE	8.829.106	1,75
27.222	Volkswagen AG - Preference	5.467.145	1,08
<b>Hongkong - 9.344.239</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.960.555)</b>			
926.800	AIA Group Ltd	9.344.239	1,85
<b>Indien - 4.858.119</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
243.880	HDFC Bank Ltd	4.858.119	0,96
<b>Japan - 30.805.605</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 25.621.448)</b>			
121.600	Ebara Corp	6.749.687	1,34
113.500	Sony Group Corp	14.283.628	2,82
62.800	Sugi Holdings Co Ltd	3.802.259	0,75
155.000	Suzuki Motor Corp	5.970.031	1,18
<b>Niederlande - 29.642.398</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.944.103)</b>			
354.493	Relx Plc	11.429.123	2,26
255.356	Royal Dutch Shell Plc	5.576.155	1,10
299.370	Universal Music Group NV	8.409.213	1,66
36.222	Wolters Kluwer NV	4.227.907	0,84
<b>Republik Korea - 10.067.267</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.826.694)</b>			
18.257	Samsung SDI Co Ltd	10.067.267	1,99
<b>Schweden - 8.247.164</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.102.262)</b>			
410.165	Swedbank AB	8.247.164	1,63
<b>Schweiz - 22.483.144</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.670.383)</b>			
8.310	Lonza Group AG	6.932.888	1,37
61.232	Novartis AG	5.384.794	1,06
24.477	Roche Holding AG	10.165.462	2,01
<b>Taiwan - 10.057.655</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.557.605)</b>			
83.518	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	10.057.655	1,99
<b>Vereinigtes Königreich - 42.158.906</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 35.044.789)</b>			
122.545	Associated British Foods Plc	3.306.138	0,65
2.472.817	Barclays Plc	6.232.865	1,23
208.498	Diageo Plc	11.297.887	2,24
66.982	Ferguson Plc	11.817.945	2,34
469.065	Informa Plc	3.244.001	0,64
118.117	Unilever Plc	6.260.070	1,24

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 276.734.432</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 210.572.063)</b>			
107.790	Abbott Laboratories	15.198.929	3,00
40.525	Accenture Plc - Class A	16.775.526	3,32
25.599	Albemarle Corp	6.002.582	1,19
8.449	Alphabet Inc - Class A	24.706.566	4,88
108.885	Altria Group Inc	5.144.816	1,02
5.746	Amazon.com Inc	19.386.257	3,83
164.253	Apple Inc	29.274.812	5,79
85.376	Applied Materials Inc	13.486.847	2,67
157.943	Citigroup Inc	9.543.706	1,89
37.953	CME Group Inc	8.676.625	1,71
14.802	Cooper Cos Inc/The	6.278.860	1,24
18.118	Costco Wholesale Corp	10.218.371	2,02
40.160	Dollar General Corp	9.471.535	1,87
21.202	Ecolab Inc	4.962.222	0,98
40.303	Eversource Energy	3.673.014	0,73
67.242	General Electric Co	6.368.826	1,26
20.731	Goldman Sachs Group Inc/The	7.991.593	1,58
42.207	JPMorgan Chase & Co	6.687.066	1,32
27.792	Mastercard Inc	10.036.803	1,98
72.456	Medtronic Plc	7.571.290	1,50
89.941	Microsoft Corp	30.521.029	6,03
29.657	Norfolk Southern Corp	8.741.252	1,73
48.352	TE Connectivity Ltd	7.767.024	1,54
43.555	Texas Instruments Inc	8.248.881	1,63
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>497.378.547</b>	<b>98,34</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.152 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 398.999)		1.152	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>497.379.699</b>	<b>98,34</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (92) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (386.114))		(92)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(92)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>8.392.549</b>	<b>1,66</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>505.772.156</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
<b>% des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,22	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,00	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,78	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

## Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged)</b>						
Australischer Dollar	US-Dollar	279	202	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	200	144	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	111	80	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Australischer Dollar	US-Dollar	229	165	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Australischer Dollar	US-Dollar	105	75	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Australischer Dollar	US-Dollar	16.774	11.989	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	172
					<b>USD</b>	<b>176</b>
					<b>AUD</b>	<b>243</b>
US-Dollar	Australischer Dollar	158	221	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Australischer Dollar	102	142	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Australischer Dollar	107	150	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Australischer Dollar	121	171	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Australischer Dollar	68	94	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
					<b>USD</b>	<b>(9)</b>
					<b>AUD</b>	<b>(12)</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	2.915	3.297	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	462.777	522.930	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	972
US-Dollar	Euro	2.848	2.514	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
					<b>USD</b>	<b>976</b>
					<b>EUR</b>	<b>862</b>
Euro	US-Dollar	7.642	8.669	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17)
Euro	US-Dollar	5.554	6.290	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	3.031	3.434	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	6.337	7.174	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	4.708	4.173	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Euro	5.360	4.752	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)
US-Dollar	Euro	6.925	6.126	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Euro	4.442	3.935	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)
					<b>USD</b>	<b>(83)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(73)</b>



# BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 3.774.322</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.217.768	Insurance Australia Group Ltd	3.774.322	0,92
<b>Bermudas - 4.311.089</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
34.446	Credicorp Ltd	4.311.089	1,05
<b>China - 4.995.590</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.918.477)</b>			
693.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	4.995.590	1,21
<b>Frankreich - 15.315.030</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 29.114.204)</b>			
86.152	Sanofi	8.630.226	2,10
132.105	TotalEnergies SE	6.684.804	1,63
<b>Deutschland - 30.741.852</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 33.404.869)</b>			
138.794	Bayer AG	7.392.845	1,80
59.616	Continental AG	6.285.426	1,53
36.725	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	10.828.257	2,63
9.980	Vitesco Technologies Group AG	486.005	0,12
28.627	Volkswagen AG - Preference	5.749.319	1,40
<b>Hongkong - 4.748.028</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.399.532)</b>			
539.749	Link REIT (Units) (REIT)	4.748.028	1,15
<b>Indien - 15.210.395</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 29.586.440)</b>			
598.481	Infosys Ltd ADR	15.210.395	3,70
<b>Irland - 6.383.495</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
61.089	Medtronic Plc	6.383.495	1,55
<b>Japan - 4.127.328</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.093.351)</b>			
141.200	KDDI Corp	4.127.328	1,00
<b>Niederlande - 5.851.801</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.717.018)</b>			
267.979	Royal Dutch Shell Plc	5.851.801	1,42
<b>Republik Korea - 9.268.104</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 36.913.952)</b>			
154.631	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	9.268.104	2,25
<b>Spanien - 8.060.079</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.748.422)</b>			
249.646	Industria de Diseno Textil SA	8.060.079	1,96
<b>Schweden - 7.709.802</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 30.688.608)</b>			
713.137	Svenska Handelsbanken AB	7.709.802	1,88
<b>Schweiz - 47.457.512</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 104.829.728)</b>			
59.382	Cie Financiere Richemont SA	8.917.056	2,17
60.997	Nestle SA	8.516.197	2,07
118.999	Novartis AG	10.464.874	2,54
27.022	Roche Holding AG	11.222.417	2,73
19.003	Zurich Insurance Group AG	8.336.968	2,03
<b>Vereinigtes Königreich - 79.201.790</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 118.409.189)</b>			
156.276	Anglo American Plc	6.364.261	1,55
1.168.306	BAE Systems Plc	8.660.830	2,11
218.984	British American Tobacco Plc	8.026.802	1,95
77.423	British American Tobacco Plc ADR	2.883.620	0,70

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
155.370	Bunzl Plc	6.035.285	1,47
1.157.057	Informa Plc	8.002.076	1,95
480.696	RELX Plc	15.498.288	3,77
546.567	Sage Group Plc/The	6.298.274	1,53
2.693.440	Taylor Wimpey Plc	6.366.462	1,55
208.932	Unilever Plc	11.065.892	2,69
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 158.131.073</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 299.001.064)</b>			
280.335	Cisco Systems Inc/Delaware	17.834.913	4,34
110.400	Citigroup Inc	6.670.920	1,62
33.309	CME Group Inc	7.614.937	1,85
156.811	CMS Energy Corp	10.207.612	2,48
104.643	Dominion Energy Inc	8.211.859	2,00
116.770	Emerson Electric Co	10.820.492	2,63
102.580	Eversource Energy	9.348.628	2,28
16.502	Hubbell Inc - Class B	3.422.020	0,83
70.144	JPMorgan Chase & Co	11.113.265	2,70
101.434	Merck & Co Inc	7.825.126	1,90
120.416	Organon & Co	3.699.782	0,90
38.378	Paychex Inc	5.237.638	1,28
86.019	PepsiCo Inc	14.853.761	3,61
65.397	Philip Morris International Inc	6.165.302	1,50
97.559	Principal Financial Group Inc	7.034.979	1,71
47.217	Procter & Gamble Co/The	7.686.219	1,87
43.636	QUALCOMM Inc	7.976.006	1,94
80.873	Sysco Corp	6.308.498	1,54
32.204	Texas Instruments Inc	6.099.116	1,49
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>405.287.290</b>	<b>98,58</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Schweiz - 566.286</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 139.320)</b>			
522.242	Cie Financiere Richemont SA (WTS) 22-Nov-2023	566.286	0,14
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>566.286</b>	<b>0,14</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 33.009 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 375.646)		33.009	0,01
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>405.886.585</b>	<b>98,73</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (2.591) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (9.834))		(2.591)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(2.591)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>5.217.305</b>	<b>1,27</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>411.101.299</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			98,43
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,01
Sonstiges Umlaufvermögen			1,56
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>						
Euro	US-Dollar	433.178	490.973	4. Jan. 22	State Street Bank	(680)
<b>USD</b>						<b>(680)</b>

**BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)**

Euro	US-Dollar	5.244.233	5.925.892	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11.014
Euro	US-Dollar	28.714	32.497	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	9.988	11.294	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13
<b>USD</b>						<b>11.037</b>
<b>EUR</b>						<b>9.751</b>

Euro	US-Dollar	53.718	60.931	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(117)
Euro	US-Dollar	54.197	61.380	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(25)
Euro	US-Dollar	49.732	56.358	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(57)
Euro	US-Dollar	71.942	81.453	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	89.993	79.611	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(133)
US-Dollar	Euro	45.245	40.102	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(153)
<b>USD</b>						<b>(494)</b>
<b>EUR</b>						<b>(436)</b>

**BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	7.752.462	8.760.147	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16.281
Euro	US-Dollar	41.691	47.184	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	14
Euro	US-Dollar	20.000	22.584	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	58
Euro	US-Dollar	19.188	21.699	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	24
US-Dollar	Euro	61.952	54.675	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	55
<b>USD</b>						<b>16.432</b>
<b>EUR</b>						<b>14.518</b>

Euro	US-Dollar	77.999	88.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(170)
Euro	US-Dollar	78.694	89.125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(36)
Euro	US-Dollar	73.190	82.941	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(84)
Euro	US-Dollar	105.601	119.561	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Euro	121.745	107.650	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(123)
US-Dollar	Euro	132.174	116.926	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(195)
US-Dollar	Euro	66.441	58.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(225)
<b>USD</b>						<b>(846)</b>
<b>EUR</b>						<b>(747)</b>

**BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)**

Euro	US-Dollar	2.516.206	2.843.269	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.284
Euro	US-Dollar	13.306	15.059	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Euro	25.305	22.335	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	21
<b>USD</b>						<b>5.310</b>
<b>EUR</b>						<b>4.691</b>

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	10.195	11.549	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)
Euro	US-Dollar	25.111	28.483	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(55)
Euro	US-Dollar	25.274	28.624	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12)
Euro	US-Dollar	23.266	26.366	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(27)
Euro	US-Dollar	33.584	38.023	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)

US-Dollar	Euro	41.526	36.735	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(61)
US-Dollar	Euro	20.666	18.316	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(70)
US-Dollar	Euro	94.495	83.757	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(324)
<b>USD</b>						<b>(561)</b>
<b>EUR</b>						<b>(496)</b>

**BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	513	581	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	109.581	123.824	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	230
Euro	US-Dollar	603	682	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.507	1.707	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	581	513	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
<b>USD</b>						<b>230</b>
<b>EUR</b>						<b>203</b>

Euro	US-Dollar	1.140	1.293	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	US-Dollar	1.135	1.285	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	1.045	1.184	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	1.860	1.646	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	920	816	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
<b>USD</b>						<b>(10)</b>
<b>EUR</b>						<b>(9)</b>

# BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 263.557</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
250.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	263.557	0,16
<b>Belgien - 374.079</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 142.831)</b>			
325.000	House of Finance NV/The 'REGS' 4.375% 15-Jul-2026	374.079	0,22
<b>Bermudas - 327.302</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
119.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	118.263	0,07
210.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	209.039	0,13
<b>Kanada - 2.959.724</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.015.480)</b>			
267.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	274.174	0,17
235.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	207.164	0,12
100.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	95.950	0,06
180.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029	178.825	0,11
277.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	278.233	0,17
400.000	Hudbay Minerals Inc '144A' 4.500% 01-Apr-2026	399.460	0,24
304.000	Hudbay Minerals Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	322.932	0,19
520.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	549.385	0,33
650.000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.250% 15-May-2029	653.601	0,39
<b>Dänemark - 464.011</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 583.839)</b>			
415.000	Norican A/S 4.500% 15-May-2023	464.011	0,28
<b>Finnland - 619.534</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
420.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	414.954	0,25
180.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy 'REGS' 3.625% 04-Feb-2028	204.580	0,12
<b>Frankreich - 5.229.963</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.729.354)</b>			
415.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	404.791	0,24
585.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	577.222	0,35
430.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	488.010	0,29
290.000	Chrome Holdco SASU 'REGS' 5.000% 31-May-2029	331.389	0,20
600.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jun-2030	702.370	0,42
570.000	Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027	639.916	0,39
325.000	Kapla Holding SAS 'REGS' 3.375% 15-Dec-2026	367.682	0,22
180.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 4.000% 15-May-2024	200.797	0,12
280.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 5.125% 15-May-2025	315.521	0,19
355.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	408.272	0,25
400.000	Renault SA 'EMTN' 2.500% 02-Jun-2027	455.341	0,27
300.000	Renault SA 'EMTN' 2.500% 01-Apr-2028	338.652	0,20
<b>Deutschland - 4.789.218</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.262.230)</b>			
355.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	359.942	0,22
385.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028	455.718	0,27
205.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	220.775	0,13
635.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	716.317	0,43
265.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 3.500% 30-Sep-2024	300.627	0,18
215.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 'REGS' 3.375% 15-Apr-2029	251.867	0,15
700.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	821.654	0,49
285.000	Standard Profil Automotive GmbH 'REGS' 6.250% 30-Apr-2026	262.841	0,16

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Deutschland Forts.</b>			
375.000	Tele Columbus AG 'REGS' 3.875% 02-May-2025	419.992	0,25
621.000	TUI Cruises GmbH 'REGS' 6.500% 15-May-2026	699.565	0,42
260.000	WEPA Hygieneerzeugnisse GmbH 'REGS' 2.875% 15-Dec-2027	279.920	0,17
<b>Irland - 2.184.552</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.948.116)</b>			
255.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	261.056	0,16
500.000	Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 6.120% 15-Mar-2032	558.184	0,33
500.000	Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 4.100% 15-Mar-2032	565.455	0,34
300.000	Harvest CLO XXI DAC FRN 6.190% 15-Jul-2031	333.933	0,20
345.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	465.924	0,28
<b>Italien - 4.392.880</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.499.568)</b>			
410.000	Brunello Bidco SpA 'REGS' 3.500% 15-Feb-2028	460.861	0,28
537.931	Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4.125% 30-Nov-2024	610.249	0,36
220.000	Gamma Bidco SpA 'REGS' 5.125% 15-Jul-2025	250.891	0,15
500.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 'REGS' 3.750% 15-Jan-2028	562.711	0,34
775.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 4.750% 30-Sep-2024	848.947	0,51
566.000	Shiba Bidco SpA 'REGS' 4.500% 31-Oct-2028	649.984	0,39
168.000	Verde Bidco SpA 'REGS' 4.625% 01-Oct-2026	194.882	0,12
712.000	Zoncolan Bidco SpA 'REGS' 4.875% 21-Oct-2028	814.355	0,49
<b>Jersey - 743.610</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
300.000	AA Bond Co Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jan-2026	411.719	0,25
245.000	CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027	331.891	0,20
<b>Liberia - 1.172.080</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
288.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	267.540	0,16
440.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	446.525	0,27
450.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	458.015	0,27
<b>Luxemburg - 12.190.256</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.704.471)</b>			
370.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026	424.149	0,25
570.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	564.442	0,34
600.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	647.946	0,39
415.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	398.072	0,24
615.000	Altice France Holding SA 'REGS' 4.000% 15-Feb-2028	666.518	0,40
235.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	242.294	0,15
110.000	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	128.267	0,08
260.000	B&M European Value Retail SA 4.000% 15-Nov-2028	352.831	0,21
607.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028	813.315	0,49
960.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	1.008.096	0,60
429.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	423.168	0,25
410.000	Crystal Almond SARL 'REGS' 4.250% 15-Oct-2024	474.500	0,28
851.000	Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029	941.691	0,56
405.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025	476.227	0,29
625.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	876.033	0,53
430.000	Herens Midco Sarl 'REGS' 5.250% 15-May-2029	461.981	0,28
870.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	1.008.924	0,60
510.000	Motion Finco Sarl 'REGS' 7.000% 15-May-2025	605.350	0,36
403.000	PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	467.092	0,28
310.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	366.614	0,22

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>				<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Luxemburg Forts.</b>				<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
825.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	842.746	0,51	150.000	Victoria Plc 3.625% 24-Aug-2026	172.857	0,10
<b>Niederlande - 7.371.092</b>				210.000	Victoria Plc 3.750% 15-Mar-2028	241.677	0,15
<b>(31. Dezember 2020: 6.700.461)</b>				270.000	Virgin Media Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2030	306.354	0,18
360.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	374.762	0,22	215.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	287.729	0,17
355.000	Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029	390.008	0,23	360.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	355.972	0,21
420.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	465.767	0,28	265.000	Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080	303.252	0,18
370.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	415.189	0,25	<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 96.020.449</b>			
560.000	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023	638.159	0,38	<b>(31. Dezember 2020: 98.707.044)</b>			
235.969	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	273.959	0,16	360.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	365.042	0,22
292.642	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	338.788	0,20	741.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	723.520	0,43
300.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	323.732	0,19	790.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	828.840	0,50
500.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.875% 24-Jun-2027	571.466	0,34	473.000	Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025	403.724	0,24
510.000	Titan Holdings II BV 'REGS' 5.125% 15-Jul-2029	575.665	0,35	240.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	254.131	0,15
220.000	United Group BV 'REGS' 3.625% 15-Feb-2028	243.143	0,15	803.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	844.286	0,51
250.000	United Group BV 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	281.119	0,17	535.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	536.894	0,32
690.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	708.364	0,43	305.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	315.611	0,19
283.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	310.779	0,19	210.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	196.055	0,12
225.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV 'REGS' 5.500% 15-Jan-2030	259.816	0,16	193.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	239.580	0,14
400.000	ZF Europe Finance BV 3.000% 23-Oct-2029	468.781	0,28	270.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	274.100	0,16
660.000	Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3.375% 28-Feb-2030	731.595	0,44	390.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	402.577	0,24
<b>Panama - 1.788.647</b>				810.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	819.489	0,49
<b>(31. Dezember 2020: 1.068.334)</b>				345.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	356.557	0,21
720.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	719.496	0,43	250.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	274.626	0,16
271.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	270.858	0,16	265.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	284.212	0,17
460.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	476.700	0,29	211.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	234.544	0,14
270.000	Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026	321.593	0,19	131.000	Antero Resources Corp '144A' 8.375% 15-Jul-2026	149.318	0,09
<b>Polen - 562.215</b>				504.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	499.671	0,30
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				198.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	210.375	0,13
575.000	Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029	562.215	0,34	400.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	417.568	0,25
<b>Spanien - 1.399.739</b>				705.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	751.939	0,45
<b>(31. Dezember 2020: 291.109)</b>				330.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	336.687	0,20
544.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	555.897	0,33	174.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	177.731	0,11
730.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	843.842	0,51	548.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029	541.980	0,33
<b>Schweden - 864.789</b>				205.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	216.997	0,13
<b>(31. Dezember 2020: 920.915)</b>				250.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	244.583	0,15
110.000	Verisure Holding AB 'REGS' FRN 5.000% 15-Apr-2025	126.572	0,08	395.000	Banff Merger Sub Inc 'REGS' 8.375% 01-Sep-2026	469.994	0,28
640.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029	738.217	0,44	865.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	855.052	0,51
<b>Vereinigtes Königreich - 8.212.245</b>				590.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	590.888	0,35
<b>(31. Dezember 2020: 8.406.263)</b>				395.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	408.035	0,25
255.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	342.691	0,21	225.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	238.734	0,14
850.000	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC 'REGS' 4.750% 15-Sep-2024	1.149.676	0,69	170.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 6.500% 02-Oct-2025	202.986	0,12
490.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	520.745	0,31	205.000	Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025	244.777	0,15
478.000	Maison Finco Plc 'REGS' 6.000% 31-Oct-2027	659.645	0,40	535.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	549.988	0,33
490.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.625% 15-Nov-2027	659.958	0,40	340.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSi Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	336.160	0,20
573.000	RAC Bond Co Plc 'REGS' 5.250% 04-Nov-2027	752.933	0,45	415.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	409.404	0,25
555.000	TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025	713.858	0,43	339.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	340.832	0,20
525.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	535.453	0,32	145.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	152.254	0,09
690.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025	663.118	0,40	320.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	330.154	0,20
406.000	Very Group Funding Plc/The 'REGS' 6.500% 01-Aug-2026	546.327	0,33	273.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	275.810	0,17
				170.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	172.853	0,10

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
290.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	297.541	0,18	
550.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	572.976	0,34	
120.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	123.747	0,07	
230.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	247.955	0,15	
465.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	495.430	0,30	
480.000	Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031	504.689	0,30	
320.000	Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029	339.754	0,20	
400.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031	403.648	0,24	
485.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	480.885	0,29	
495.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	505.039	0,30	
345.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	349.744	0,21	
310.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	334.499	0,20	
400.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	413.568	0,25	
260.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	257.854	0,15	
450.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	443.887	0,27	
125.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	128.122	0,08	
350.000	CommScope Inc 'REGS' 6.000% 01-Mar-2026	360.971	0,22	
124.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Jan-2032	127.287	0,08	
590.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	616.143	0,37	
390.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029	418.817	0,25	
595.000	Covanta Holding Corp 6.000% 01-Jan-2027	615.046	0,37	
155.000	Covert Mergerco Inc '144A' 4.875% 01-Dec-2029	157.561	0,09	
757.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	754.279	0,45	
281.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029	292.282	0,18	
480.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	499.930	0,30	
310.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	317.338	0,19	
505.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	478.078	0,29	
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	214.817	0,13	
325.000	CSC Holdings LLC 'REGS' 6.500% 01-Feb-2029	349.222	0,21	
800.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	833.868	0,50	
288.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	293.584	0,18	
288.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	290.340	0,17	
607.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	619.395	0,37	
450.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	509.238	0,31	
570.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	587.941	0,35	
665.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 5.375% 15-Feb-2026	929.344	0,56	
530.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	562.269	0,34	
655.000	Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	611.708	0,37	
210.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	206.690	0,12	
340.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	347.745	0,21	
410.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	425.808	0,26	
145.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	152.408	0,09	
180.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	196.905	0,12	
305.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	323.105	0,19	
115.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	124.329	0,07	
145.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	162.583	0,10	
795.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	806.245	0,48	
556.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	573.086	0,34	
551.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	536.407	0,32	
216.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	221.832	0,13	
210.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	247.131	0,15	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	211.749	0,13	
404.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	437.023	0,26	
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	215.226	0,13	
365.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	415.357	0,25	
200.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	196.781	0,12	
355.000	Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043	447.548	0,27	
420.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	429.920	0,26	
285.000	Golden Nugget Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2024	285.370	0,17	
675.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	698.827	0,42	
450.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	468.799	0,28	
455.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	464.555	0,28	
820.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	812.825	0,49	
487.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	490.694	0,29	
116.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000% 01-Dec-2029	116.309	0,07	
895.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	923.251	0,55	
290.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	302.776	0,18	
234.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	254.642	0,15	
233.000	Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025	232.408	0,14	
306.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	309.817	0,19	
131.000	Kobe US Midco 2 Inc '144A' 9.250% 01-Nov-2026	133.631	0,08	
565.000	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025	585.368	0,35	
442.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	437.100	0,26	
420.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	429.712	0,26	
931.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	914.126	0,55	
62.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	65.084	0,04	
325.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	331.242	0,20	
645.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	654.588	0,39	
400.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	398.564	0,24	
515.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	491.336	0,29	
440.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	422.013	0,25	
90.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	91.960	0,06	
435.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	432.396	0,26	
120.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	123.373	0,07	
315.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	306.015	0,18	
930.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	933.394	0,56	
279.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 8.500% 15-Apr-2024	289.933	0,17	
530.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co 'REGS' 4.750% 15-Apr-2024	601.476	0,36	
400.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	400.662	0,24	
490.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	483.569	0,29	
210.256	Mitchell International, Inc. 0.000% 01-Oct-2029	211.965	0,13	
387.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029	385.839	0,23	
641.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 5.250% 01-Oct-2029	648.743	0,39	
630.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	643.551	0,39	
205.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	214.193	0,13	
293.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	293.467	0,18	
505.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	558.747	0,34	
270.000	New Albertsons LP 8.000% 01-May-2031	330.862	0,20	
685.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	699.950	0,42	
370.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027	367.780	0,22	
575.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	566.901	0,34	
230.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	241.898	0,15	
230.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029	236.148	0,14	
280.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	340.670	0,20	
184.000	Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-Sep-2028	217.374	0,13	
285.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	363.944	0,22	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
230.000	Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030	310.896	0,19	
663.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	650.393	0,39	
245.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250% 01-Oct-2029	239.219	0,14	
200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	203.596	0,12	
775.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	809.329	0,49	
354.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.250% 01-Feb-2028	381.070	0,23	
555.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	571.106	0,34	
213.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	203.714	0,12	
480.000	Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029	472.274	0,28	
490.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	509.688	0,31	
770.000	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp 'REGS' 3.000% 15-Jun-2029	824.811	0,49	
440.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029	456.078	0,27	
493.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	507.115	0,30	
285.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	287.538	0,17	
480.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	483.223	0,29	
335.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	336.313	0,20	
253.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	248.836	0,15	
329.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	326.328	0,20	
435.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	443.835	0,27	
250.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	263.540	0,16	
380.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	393.283	0,24	
510.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	542.474	0,33	
490.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	512.307	0,31	
290.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	293.979	0,18	
805.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	802.195	0,48	
77.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Dec-2031	80.422	0,05	
494.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	489.453	0,29	
717.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	736.119	0,44	
547.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	554.680	0,33	
420.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	471.805	0,28	
275.000	Scientific Games International Inc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2026	319.221	0,19	
270.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026	278.100	0,17	
660.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2031	673.863	0,40	
540.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	567.844	0,34	
270.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	266.429	0,16	
290.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	291.952	0,18	
245.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	246.028	0,15	
145.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	156.481	0,09	
482.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	487.396	0,29	
361.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	382.268	0,23	
180.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	192.917	0,12	
110.000	Southwestern Energy Co 8.375% 15-Sep-2028	122.939	0,07	
560.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	709.341	0,43	
655.000	Sprint Corp 7.625% 01-Mar-2026	787.222	0,47	
230.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	235.474	0,14	
645.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	607.777	0,36	
210.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.000% 15-Jan-2028	220.839	0,13	
285.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.500% 15-Jul-2027	304.545	0,18	
375.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	410.218	0,25	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>				
1.004.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	948.780	0,57	
458.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	470.682	0,28	
476.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	484.418	0,29	
400.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	411.578	0,25	
645.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027	668.449	0,40	
65.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 7.500% 01-Apr-2025	68.487	0,04	
20.000	Tenet Healthcare Corp 'REGS' 6.250% 01-Feb-2027	20.727	0,01	
560.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	578.348	0,35	
550.000	Terrier Media Buyer Inc '144A' 8.875% 15-Dec-2027	595.529	0,36	
390.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	410.487	0,25	
230.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	236.502	0,14	
240.000	T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026	240.966	0,14	
230.000	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	242.473	0,15	
390.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3.500% 15-Apr-2031	404.812	0,24	
289.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	287.356	0,17	
339.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	340.968	0,20	
310.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	319.075	0,19	
575.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	574.434	0,34	
410.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	417.944	0,25	
500.000	UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029	560.422	0,34	
310.000	Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 5.250% 30-Sep-2028	313.704	0,19	
164.000	Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 7.500% 30-Sep-2029	165.873	0,10	
250.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	259.704	0,16	
195.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	202.231	0,12	
525.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	562.944	0,34	
400.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	412.926	0,25	
315.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	327.975	0,20	
298.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	310.994	0,19	
230.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	243.466	0,15	
480.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	485.623	0,29	
240.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2030	254.590	0,15	
420.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029	450.150	0,27	
59.000	Vistra Corp '144A' FRN (Perpetual) 7.000% 15-Dec-2026	60.019	0,04	
445.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	446.622	0,27	
631.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	635.051	0,38	
300.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	327.162	0,20	
280.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	292.298	0,18	
666.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	684.285	0,41	
157.000	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	150.199	0,09	
535.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	545.277	0,33	
240.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	237.367	0,14	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>151.929.942</b>	<b>91,15</b>	
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 69.741</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
4.200	Altice USA Inc	69.741	0,04	
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>69.741</b>	<b>0,04</b>	
<b>Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 7136.922</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 6.429.236)</b>				
483.753	Amynta Agency Borrower Inc Term Loan 0.000% 31-Jan-2025	483.149	0,29	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
401.893	AP Gaming I LLC Term Loan 4.500% 15-Feb-2024	400.303	0,24
110.104	Asurion LLC Term Loan 0.000% 15-Jan-2029	109.897	0,07
620.000	Asurion LLC Term Loan 5.337% 03-Feb-2028	618.837	0,37
1.020	Autokiniton US Holdings, Inc. Term Loan 5.000% 06-Apr-2028	1.023	0,00
410.850	Caesars Resort Collection LLC Term Loan 3.587% 20-Jul-2025	412.134	0,25
398.000	CT Technologies Intermediate Holdings Inc Term Loan 5.000% 10-Dec-2025	399.036	0,24
89.354	Cubic Corp Term Loan 5.000% 29-Apr-2028	89.789	0,05
439.321	Cubic Corp Term Loan 5.000% 25-May-2028	441.463	0,27
970.000	DirecTV Financing LLC Term Loan 5.750% 22-Jul-2027	971.213	0,58
500.000	Flexsys Holdings Inc 0.000% 12-Aug-2028	502.500	0,30
547.860	Great Outdoors Group LLC Term Loan 5.000% 26-Feb-2028	549.401	0,33
471.438	Greeneden US Holdings II LLC Term Loan 4.750% 01-Dec-2027	473.697	0,28
541.812	Ivanti Software Inc Term Loan 5.750% 01-Dec-2027	541.812	0,33
802.988	One Call Corporation Term Loan 6.250% 07-Apr-2027	805.330	0,48
42	Pathway Vet Alliance LLC Term Loan 0.000% 31-Mar-2027	42	0,00
336.538	PECF USS Intermediate Holding Term Loan 0.000% 04-Nov-2028	337.296	0,20
<b>Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)</b>		<b>7.136.922</b>	<b>4,28</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 102.431 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 550.506)		102.431	0,06
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>159.239.036</b>	<b>95,53</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (163.678) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (122.171))		(163.678)	(0,10)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(163.678)</b>	<b>(0,10)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>7.618.337</b>	<b>4,57</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>166.693.695</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	90,35
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	4,24
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,06
Sonstiges Umlaufvermögen	5,35
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>								
Euro	US-Dollar	2.000.000	2.261.172	31. Jan. 22	Citibank N.A.		3.783	
Pfund Sterling	US-Dollar	395.000	527.393	31. Jan. 22	Goldman Sachs		4.875	
US-Dollar	Euro	657.291	580.000	31. Jan. 22	Goldman Sachs		454	
							<b>USD</b>	<b>9.112</b>
Euro	US-Dollar	850.000	963.560	31. Jan. 22	Goldman Sachs		(954)	
US-Dollar	Euro	36.580.882	32.350.000	31. Jan. 22	Goldman Sachs		(54.762)	
US-Dollar	Pfund Sterling	9.189.203	6.890.000	31. Jan. 22	Goldman Sachs		(95.176)	
US-Dollar	Pfund Sterling	653.276	490.000	31. Jan. 22	Goldman Sachs		(7.006)	
							<b>USD</b>	<b>(157.898)</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	1.341.305	1.515.651	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.817	
US-Dollar	Euro	73.121	64.546	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		50	
							<b>USD</b>	<b>2.867</b>
							<b>EUR</b>	<b>2.533</b>
Euro	US-Dollar	7.872	8.929	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(17)	
US-Dollar	Euro	5.629	4.989	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(19)	
							<b>USD</b>	<b>(36)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(32)</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	10.935.734	12.357.187	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		22.967	
							<b>USD</b>	<b>22.967</b>
							<b>EUR</b>	<b>20.292</b>
Euro	US-Dollar	69.310	78.616	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(152)	
							<b>USD</b>	<b>(152)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(134)</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged)</b>								
Euro	US-Dollar	18.901.778	21.358.677	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		39.696	
							<b>USD</b>	<b>39.696</b>
							<b>EUR</b>	<b>35.072</b>
Euro	US-Dollar	125.876	142.777	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(275)	
US-Dollar	Euro	790.105	700.000	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(2.353)	
							<b>USD</b>	<b>(2.628)</b>
							<b>EUR</b>	<b>(2.322)</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)</b>								
Pfund Sterling	US-Dollar	886.267	1.169.267	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		25.039	
Pfund Sterling	US-Dollar	108.898	146.379	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		368	
Pfund Sterling	US-Dollar	21.553	28.704	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		340	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	98.043	130.077	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.042
						<b>USD</b>
						<b>27.789</b>
						<b>GBP</b>
						<b>20.621</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	146.350	108.898	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(401)
Pfund Sterling	US-Dollar	5.966	8.041	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.980	10.404	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(41)
US-Dollar	Pfund Sterling	30.029	22.548	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(356)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.002	3.749	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(51)
US-Dollar	Pfund Sterling	134.669	101.503	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.114)
						<b>USD</b>
						<b>(2.964)</b>
						<b>GBP</b>
						<b>(2.199)</b>



# BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Belgien - 9.397.066</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.056.729)</b>			
480.716	Proximus SADP	9.397.066	4,13
<b>Kanada - 17.686.339</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.561.171)</b>			
452.698	Enbridge Inc	17.686.339	7,77
<b>China - 5.599.449</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.809.108)</b>			
5.468.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	5.599.449	2,46
<b>Frankreich - 25.294.919</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.571.722)</b>			
81.416	Bouygues SA	2.916.560	1,28
809.705	Engie SA	11.995.111	5,27
968.987	Orange SA	10.383.248	4,56
<b>Deutschland - 1.794.787</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.698.787)</b>			
27.976	Deutsche Post AG	1.794.787	0,79
<b>Italien - 19.939.937</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.716.689)</b>			
273.921	Atlantia SpA	5.444.284	2,39
632.237	Enel SpA	5.071.368	2,23
1.368.458	Italgas SpA	9.424.285	4,14
<b>Norwegen - 1.591.995</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.451.024)</b>			
195.217	SFL Corp Ltd	1.591.995	0,70
<b>Spanien - 43.327.016</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 27.843.456)</b>			
602.797	Enagas SA	14.007.076	6,15
227.381	Endesa SA	5.227.950	2,30
340.061	Naturgy Energy Group SA	11.099.870	4,87
600.058	Red Electrica Corp SA	12.992.120	5,71
<b>Vereinigtes Königreich - 10.921.833</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.791.935)</b>			
383.343	Drax Group Plc	3.145.675	1,38
348.499	SSE Plc	7.776.158	3,41
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 87.930.381</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 48.833.242)</b>			
1.412.769	Antero Midstream Corp	13.668.540	6,00
163.751	Clearway Energy Inc	5.900.767	2,59
192.892	Exelon Corp	11.149.158	4,90
503.289	Medical Properties Trust Inc (REIT)	11.890.203	5,22
352.916	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	10.444.549	4,59
73.376	ONEOK Inc	4.311.941	1,89
176.635	PPL Corp	5.308.765	2,33
34.913	Public Service Enterprise Group Inc	2.329.919	1,02
179.544	Verizon Communications Inc	9.330.004	4,10
325.584	Vistra Corp	7.415.175	3,26

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
237.425	Williams Cos Inc/The	6.181.360	2,71
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>223.483.722</b>	<b>98,15</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.813.323 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.816.466)		1.813.323	0,80
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>225.297.045</b>	<b>98,95</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (48.500) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (72.634))		(48.500)	(0,02)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(48.500)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>2.459.039</b>	<b>1,07</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>227.707.584</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,56	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,79	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,65	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	15.288	17.305	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	101	
Euro	US-Dollar	5.848	6.627	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33	
Euro	US-Dollar	8.585	9.715	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	61	
Euro	US-Dollar	5.667	6.413	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40	
Euro	US-Dollar	4.919	5.579	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22	
Euro	US-Dollar	9.322	10.569	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	46	
Euro	US-Dollar	661.064	748.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.660	
							<b>USD 4.963</b>
							<b>EUR 4.359</b>
US-Dollar	Euro	7.002	6.207	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(66)	
US-Dollar	Euro	5.630	4.963	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21)	
US-Dollar	Euro	7.370	6.539	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(76)	
US-Dollar	Euro	17.309	15.288	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(100)	
US-Dollar	Euro	6.659	5.893	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(52)	
							<b>USD (315)</b>
							<b>EUR (277)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	7.614	8.628	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	43	
Euro	US-Dollar	2.500	2.836	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11	
Euro	US-Dollar	11.162	12.632	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	79	
Euro	US-Dollar	7.313	8.275	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	52	
Euro	US-Dollar	6.348	7.200	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	29	
Euro	US-Dollar	1.000	1.132	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7	
Euro	US-Dollar	12.157	13.783	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	60	
Euro	US-Dollar	853.090	965.431	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.014	
							<b>USD 6.295</b>
							<b>EUR 5.529</b>
US-Dollar	Euro	1.132	1.000	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
US-Dollar	Euro	8.593	7.605	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(67)	
US-Dollar	Euro	9.104	8.070	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(86)	
US-Dollar	Euro	9.511	8.438	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(97)	
							<b>USD (257)</b>
							<b>EUR (226)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	866	982	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	1.266	1.432	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	830	939	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6	
Euro	US-Dollar	721	818	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	1.390	1.576	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Euro	US-Dollar	96.458	109.160	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	680	
							<b>USD 710</b>
							<b>EUR 624</b>
US-Dollar	Euro	1.016	900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)	
US-Dollar	Euro	1.058	939	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)	
US-Dollar	Euro	968	857	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
							<b>USD (28)</b>
							<b>EUR (25)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	139.303	157.847	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	782	
Euro	US-Dollar	203.502	230.289	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.446	
Euro	US-Dollar	133.461	151.032	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	946	
Euro	US-Dollar	115.915	131.471	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	526	
Euro	US-Dollar	223.488	253.384	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.110	
Euro	US-Dollar	15.509.252	17.551.624	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	109.327	
							<b>USD 114.137</b>
							<b>EUR 100.252</b>
US-Dollar	Euro	163.323	144.782	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.545)	
US-Dollar	Euro	170.149	150.952	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.745)	
US-Dollar	Euro	155.655	137.755	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.211)	
							<b>USD (4.501)</b>
							<b>EUR (3.953)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)</b>							
Singapur-Dollar	US-Dollar	14.187	10.458	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	68	
Singapur-Dollar	US-Dollar	20.572	15.077	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	187	
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.984	1.450	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22	
Singapur-Dollar	US-Dollar	13.746	10.071	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	129	
Singapur-Dollar	US-Dollar	11.728	8.597	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	106	
Singapur-Dollar	US-Dollar	9.918	7.273	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	87	
Singapur-Dollar	US-Dollar	22.380	16.549	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	57	
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.548.134	1.134.368	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	14.364	
							<b>USD 15.020</b>
							<b>SGD 20.241</b>
US-Dollar	Singapur-Dollar	9.932	13.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(129)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	10.477	14.304	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(137)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	11.264	15.425	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(182)	
							<b>USD (448)</b>
							<b>SGD (604)</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged)</b>							
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.265	931	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		8
Singapur-Dollar	US-Dollar	992	730	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		6
Singapur-Dollar	US-Dollar	78.542	57.901	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		378
Singapur-Dollar	US-Dollar	113.876	83.460	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.037
Singapur-Dollar	US-Dollar	198.300	144.980	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2.161
Singapur-Dollar	US-Dollar	490.000	358.347	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5.238
Singapur-Dollar	US-Dollar	70.083	51.345	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		657
Singapur-Dollar	US-Dollar	59.794	43.830	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		538
Singapur-Dollar	US-Dollar	100.000	73.065	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.136
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.984	1.459	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		13
Singapur-Dollar	US-Dollar	123.918	91.631	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		317
Singapur-Dollar	US-Dollar	19.836	14.533	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		185
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.822.694	5.731.941	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		72.579
						<b>USD</b>	<b>84.253</b>
						<b>SGD</b>	<b>113.539</b>
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.459	1.984	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(13)
US-Dollar	Singapur-Dollar	50.188	68.515	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(650)
US-Dollar	Singapur-Dollar	55.437	75.688	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(725)
US-Dollar	Singapur-Dollar	571.35	78.243	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(922)
US-Dollar	Singapur-Dollar	931	1.265	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(8)
						<b>USD</b>	<b>(2.318)</b>
						<b>SGD</b>	<b>(3.124)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	431.967	579.355	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5.320
Pfund Sterling	US-Dollar	629.796	839.494	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		12.946
Pfund Sterling	US-Dollar	410.980	546.053	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		10.216
Pfund Sterling	US-Dollar	358.174	477.668	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		7126
Pfund Sterling	US-Dollar	691.871	934.993	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.466
Pfund Sterling	US-Dollar	47.797.814	63.144.311	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.550.871
						<b>USD</b>	<b>1.587.945</b>
						<b>GBP</b>	<b>1.173.171</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	554.892	419.841	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(13.370)
US-Dollar	Pfund Sterling	591.744	446.788	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(12.992)
US-Dollar	Pfund Sterling	610.732	461.762	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(14.271)
						<b>USD</b>	<b>(40.633)</b>
						<b>GBP</b>	<b>(30.020)</b>

# BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 2.430.773</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 1.180.185)</b>	<b>2.430.773</b>	<b>3,72</b>
11.500	CSL Ltd	2.430.773	3,72
<b>Kaiman-Inseln - 1.897.658</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: -)</b>	<b>1.897.658</b>	<b>2,90</b>
32.400	Tencent Holdings Ltd	1.897.658	2,90
<b>Dänemark - 3.086.481</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 977.978)</b>	<b>3.086.481</b>	<b>4,72</b>
27.300	Novo Nordisk A/S	3.086.481	4,72
<b>Frankreich - 5.959.341</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 3.461.994)</b>	<b>5.959.341</b>	<b>9,12</b>
8.300	Air Liquide SA	1.448.239	2,22
4.100	L'Oreal SA	1.946.145	2,98
3.100	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.564.957	3,92
<b>Hongkong - 2.438.141</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 1.923.046)</b>	<b>2.438.141</b>	<b>3,73</b>
241.800	AIA Group Ltd	2.438.141	3,73
<b>Japan - 3.893.124</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 3.345.736)</b>	<b>3.893.124</b>	<b>5,96</b>
5.900	FANUC Corp	1.252.013	1,92
4.200	Keyence Corp	2.641.111	4,04
<b>Niederlande - 2.574.834</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 1.603.508)</b>	<b>2.574.834</b>	<b>3,94</b>
3.200	ASML Holding NV	2.574.834	3,94
<b>Spanien - 1.302.277</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 1.464.367)</b>	<b>1.302.277</b>	<b>1,99</b>
40.100	Industria de Diseno Textil SA	1.302.277	1,99
<b>Schweiz - 2.788.051</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 1.151.999)</b>	<b>2.788.051</b>	<b>4,27</b>
6.700	Roche Holding AG	2.788.051	4,27
<b>Taiwan - 2.707.087</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 2.028.051)</b>	<b>2.707.087</b>	<b>4,14</b>
22.500	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	2.707.087	4,14
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 35.415.551</b>			
	<b>(31. Dezember 2020: 21.089.087)</b>	<b>35.415.551</b>	<b>54,19</b>
4.700	Adobe Inc	2.666.028	4,08
640	Alphabet Inc	1.852.413	2,84
275	Alphabet Inc	795.959	1,22
33.800	Amphenol Corp - Class A	2.955.472	4,52
11.800	Automatic Data Processing Inc	2.910.411	4,45
5.950	Ecolab Inc	1.395.513	2,14
26.300	Edwards Lifesciences Corp	3.405.850	5,21
7.300	Illumina Inc	2.778.927	4,25
8.620	Intuitive Surgical Inc	3.096.088	4,74
5.400	Mastercard Inc	1.940.490	2,97
2.600	Mastercard Inc	934.310	1,43
8.200	Microsoft Corp	2.757.373	4,22
8.400	NIKE Inc	1.400.196	2,14
8.200	NIKE Inc	1.366.858	2,09
11.900	Texas Instruments Inc	2.243.567	3,43
15.700	TJX Cos Inc/The	1.192.258	1,82

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
22.700	TJX Cos Inc/The	1.723.838	2,64
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>64.493.318</b>	<b>98,68</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 7178 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 18.265)		7178	0,01
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>64.500.496</b>	<b>98,69</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (562) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (933))		(562)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(562)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>857.126</b>	<b>1,31</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>65.357.060</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,58	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,01	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,41	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK H (Acc) (Hedged)</b>						
Dänische Krone	US-Dollar	167.372	25.464	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	165
Dänische Krone	US-Dollar	1.102	168	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	1.067	163	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	2.353	358	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Dänische Krone	US-Dollar	3.529	537	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Dänische Krone	US-Dollar	1.745	266	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	1.024	156	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
<b>USD</b>						<b>175</b>
<b>DKK</b>						<b>1.143</b>
US-Dollar	Dänische Krone	176	1.158	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	437	2.884	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Dänische Krone	235	1.545	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Dänische Krone	198	1.301	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	408	2.694	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Dänische Krone	154	1.013	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>USD</b>						<b>(13)</b>
<b>DKK</b>						<b>(85)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged)</b>						
Dänische Krone	US-Dollar	169.935	25.854	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	167
Dänische Krone	US-Dollar	1.154	176	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	1.090	166	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	2.395	364	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Dänische Krone	US-Dollar	3.591	546	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Dänische Krone	US-Dollar	1.778	271	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	1.045	159	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
<b>USD</b>						<b>177</b>
<b>DKK</b>						<b>1.156</b>
US-Dollar	Dänische Krone	178	1.170	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	442	2.912	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Dänische Krone	238	1.563	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Dänische Krone	200	1.316	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	414	2.730	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Dänische Krone	154	1.011	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>USD</b>						<b>(13)</b>
<b>DKK</b>						<b>(85)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	249.366	282.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.758
Euro	US-Dollar	1.619	1.835	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	1.580	1.790	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	3.521	3.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	25
Euro	US-Dollar	5.242	5.933	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	37

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	2.581	2.927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	1.539	1.739	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13
<b>USD</b>						<b>1.862</b>
<b>EUR</b>						<b>1.635</b>
US-Dollar	Euro	1.960	1.735	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	4.830	4.282	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(46)
US-Dollar	Euro	2.576	2.278	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Euro	2.212	1.955	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	4.543	4.030	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(47)
US-Dollar	Euro	1.715	1.516	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)
<b>USD</b>						<b>(151)</b>
<b>EUR</b>						<b>(133)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)</b>						
Norwegische Krone	US-Dollar	1.747.119	194.092	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.260
Norwegische Krone	US-Dollar	1.111,3	1.257	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Norwegische Krone	US-Dollar	24.454	2.761	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16
Norwegische Krone	US-Dollar	36.624	4.122	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	37
Norwegische Krone	US-Dollar	17.921	1.996	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39
Norwegische Krone	US-Dollar	10.652	1.181	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	28
<b>USD</b>						<b>4.384</b>
<b>NOK</b>						<b>38.608</b>
Norwegische Krone	US-Dollar	11.698	1.329	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.365	12.270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(28)
US-Dollar	Norwegische Krone	3.365	30.222	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(67)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.737	15.725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(48)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.505	13.545	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Norwegische Krone	3.104	28.301	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(109)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.175	10.660	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(35)
<b>USD</b>						<b>(321)</b>
<b>NOK</b>						<b>(2.827)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)</b>						
Norwegische Krone	US-Dollar	198.088	22.006	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	483
Norwegische Krone	US-Dollar	1.367	155	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Norwegische Krone	US-Dollar	1.267	143	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Norwegische Krone	US-Dollar	2.780	314	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Norwegische Krone	US-Dollar	4.161	468	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Norwegische Krone	US-Dollar	2.039	227	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Norwegische Krone	US-Dollar	1.214	135	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
						<b>USD</b>	<b>497</b>
						<b>NOK</b>	<b>4.377</b>
US-Dollar	Norwegische Krone	154	1.384	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Norwegische Krone	379	3.408	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
US-Dollar	Norwegische Krone	196	1.777	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Norwegische Krone	170	1.529	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Norwegische Krone	351	3.202	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12)	
US-Dollar	Norwegische Krone	131	1.188	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	
						<b>USD</b>	<b>(36)</b>
						<b>NOK</b>	<b>(317)</b>

**BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)**

Schwedische Krone	US-Dollar	190.719	21.073	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	35	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.198	133	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.213	133	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Schwedische Krone	US-Dollar	2.683	295	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Schwedische Krone	US-Dollar	4.022	442	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.188	131	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
						<b>USD</b>	<b>41</b>
						<b>SEK</b>	<b>370</b>
Schwedische Krone	US-Dollar	1.981	220	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Schwedische Krone	149	1.354	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Schwedische Krone	361	3.303	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Schwedische Krone	198	1.809	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Schwedische Krone	166	1.507	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Schwedische Krone	337	3.070	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Schwedische Krone	127	1.156	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
						<b>USD</b>	<b>(14)</b>
						<b>SEK</b>	<b>(127)</b>

**BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)**

Schwedische Krone	US-Dollar	194.044	21.440	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	35	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.258	139	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.242	136	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
Schwedische Krone	US-Dollar	2.737	301	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2	
Schwedische Krone	US-Dollar	4.099	450	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Schwedische Krone	US-Dollar	1.215	134	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
						<b>USD</b>	<b>42</b>
						<b>SEK</b>	<b>380</b>
Schwedische Krone	US-Dollar	2.023	224	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
US-Dollar	Schwedische Krone	151	1.371	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Schwedische Krone	365	3.342	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Schwedische Krone	201	1.835	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Schwedische Krone	168	1.527	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Schwedische Krone	342	3.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Schwedische Krone	127	1.156	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
						<b>USD</b>	<b>(14)</b>
						<b>SEK</b>	<b>(127)</b>

# BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>China - 291.740</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.586.593)</b>			
40.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	291.740	0,78
<b>Dänemark - 531.933</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
6.482	Novozymes A/S	531.933	1,43
<b>Frankreich - 374.463</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.033.439)</b>			
27.796	Vivendi SE	374.463	1,01
<b>Deutschland - 1.435.011</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.249.526)</b>			
7.899	Bayer AG	420.739	1,13
7.207	SAP SE	1.014.272	2,73
<b>Hongkong - 762.219</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.063.433)</b>			
75.600	AIA Group Ltd	762.219	2,05
<b>Indien - 645.133</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
32.386	HDFC Bank Ltd	645.133	1,73
<b>Japan - 2.700.132</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.407.963)</b>			
15.000	Ebara Corp	832.609	2,24
9.300	Sony Group Corp	1.170.377	3,15
18.100	Suzuki Motor Corp	697.146	1,87
<b>Niederlande - 2.615.990</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.097.197)</b>			
31.844	Relx Plc	1.026.675	2,76
27.796	Universal Music Group NV	780.781	2,10
6.927	Wolters Kluwer NV	808.534	2,17
<b>Republik Korea - 773.642</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 966.407)</b>			
1.403	Samsung SDI Co Ltd	773.642	2,08
<b>Schweden - 689.990</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 697.906)</b>			
34.316	Swedbank AB	689.990	1,86
<b>Schweiz - 1.829.076</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.748.240)</b>			
697	Lonza Group AG	581.495	1,56
3.004	Roche Holding AG	1.247.581	3,36
<b>Taiwan - 575.993</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 763.790)</b>			
4.783	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	575.993	1,55
<b>Vereinigtes Königreich - 3.913.520</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.523.479)</b>			
279.331	Barclays Plc	704.069	1,89
20.569	Diageo Plc	1.114.573	3,00
5.647	Ferguson Plc	996.326	2,68
55.604	Informa Plc	384.551	1,03
13.472	Unilever Plc	714.001	1,92
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 19.393.143</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.321.637)</b>			
71.17	Abbott Laboratories	1.003.533	2,70
2.987	Accenture Plc - Class A	1.236.484	3,32
667	Alphabet Inc - Class A	1.950.441	5,24
399	Amazon.com Inc	1.346.174	3,62
8.232	Apple Inc	1.467.189	3,94
5.510	Applied Materials Inc	870.415	2,34
9.556	Citigroup Inc	577.421	1,55
4.097	CME Group Inc	936.636	2,52

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
1.639	Cooper Cos Inc/The	695.247	1,87
1.155	Costco Wholesale Corp	651.408	1,75
3.419	Ecolab Inc	800.200	2,15
7.104	Eversource Energy	647.423	1,74
2.863	Goldman Sachs Group Inc/The	1.103.658	2,97
2.791	Mastercard Inc	1.007.942	2,71
9.223	Medtronic Plc	963.757	2,59
7.160	Microsoft Corp	2.429.710	6,53
6.038	TE Connectivity Ltd	969.914	2,61
3.884	Texas Instruments Inc	735.591	1,98
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>36.531.985</b>	<b>98,21</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 608 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.872)		608	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>36.532.593</b>	<b>98,21</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (51) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (149))		(51)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(51)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>665.908</b>	<b>1,79</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>37.198.450</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,90
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen	2,10
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	256.584	289.935	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	539
Euro	US-Dollar	3.454	3.911	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.520	1.719	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Euro	1.471	1.299	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
<b>USD</b>						<b>541</b>
<b>EUR</b>						<b>478</b>
Euro	US-Dollar	3.167	3.587	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	1.670	1.893	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	US-Dollar	4.446	5.043	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Euro	4.148	3.669	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	2.163	1.917	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	2.824	2.503	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Euro	2.625	2.328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
<b>USD</b>						<b>(46)</b>
<b>EUR</b>						<b>(41)</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	31.882	36.026	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	67
Euro	US-Dollar	395	447	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	209	237	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	430	487	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	191	217	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	182	161	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
<b>USD</b>						<b>67</b>
<b>EUR</b>						<b>59</b>
Euro	US-Dollar	558	633	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	513	453	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	268	237	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	350	310	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	325	288	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
<b>USD</b>						<b>(5)</b>
<b>EUR</b>						<b>(4)</b>



# BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Guernsey - 13.681.925</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
3.757.699	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	4.630.572	0,15
6.727.641	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	9.051.353	0,29
<b>Irland - 14.947.842</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 119.941.755)</b>			
169.730	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	14.947.842	0,48
<b>Jersey - 117.419.475</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
696.569	WisdomTree Copper - ETF	24.136.968	0,77
14.626.056	WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	93.282.507	2,99
<b>Vereinigtes Königreich - 4.710.306</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.407.634)</b>			
6.128.002	Riverstone Credit Opportunities Income Plc/The Fund	4.710.306	0,15
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>150.759.548</b>	<b>4,83</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Frankreich - 19.129.345</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 38.650.840)</b>			
2.192.000	Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028	2.141.650	0,07
3.450.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029	3.413.775	0,11
5.797.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	5.775.348	0,18
1.987.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	1.999.786	0,06
5.488.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	5.798.786	0,19
<b>Deutschland - 4.508.453</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 17.977.468)</b>			
4.346.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	4.508.453	0,14
<b>Indien - 4.295.303</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.040.109)</b>			
360.000.000	National Highways Authority of India 7.300% 18-May-2022	4.295.303	0,14
<b>Irland - 8.666.890</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.628.304)</b>			
8.175.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024	8.666.890	0,28
<b>Italien - 26.437.519</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 24.647.191)</b>			
11.036.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7.700% 17-Sep-2025	10.976.811	0,35
9.962.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	9.556.049	0,31
6.100.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024	5.904.659	0,19
<b>Luxemburg - 6.582.618</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.680.709)</b>			
6.300.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	6.582.618	0,21
<b>Spanien - 30.494.158</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 30.134.958)</b>			
6.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-Sep-2023	7.052.034	0,23
8.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Mar-2024	9.274.928	0,30
8.400.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.750% 19-Mar-2025	8.706.936	0,28
5.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023	5.460.260	0,17

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich - 32.595.690</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 65.018.037)</b>			
20.000.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025	21.914.800	0,70
9.113.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	10.680.890	0,34
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 49.700.321</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 70.527.187)</b>			
10.411.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	11.418.154	0,37
7.726.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	6.643.532	0,21
3.648.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026	3.315.494	0,11
8.048.419	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	7.777.099	0,25
7.991.669	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6.500% 20-Jun-2027	7.556.762	0,24
5.512.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	7.313.034	0,23
4.493.000	Sprint Corp 7.125% 15-Jun-2024	4.450.980	0,14
1.335.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	1.225.266	0,04
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>182.410.297</b>	<b>5,84</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 16.182.426</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.362.441)</b>			
6.883.801	Star Entertainment Grp Ltd/The	16.182.426	0,52
<b>Kaiman-Inseln - 29.943.052</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 84.076.771)</b>			
780.449	Alibaba Group Holding Ltd	10.508.772	0,34
234.868	Tencent Holdings Ltd	12.152.430	0,39
1.202.329	Tencent Music Entertainment Group ADR	7.281.850	0,23
<b>China - 23.970.995</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 18.166.339)</b>			
1.597.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	7.160.348	0,23
697.340	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	10.160.408	0,33
556.560	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	6.650.239	0,21
<b>Dänemark - 33.236.724</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 32.600.372)</b>			
198.338	Novozymes A/S	14.380.205	0,46
167.844	Orsted AS '144A'	18.856.519	0,61
<b>Finnland - 13.233.865</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
305.632	Neste Oyj	13.233.865	0,42
<b>Frankreich - 103.992.905</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 114.570.064)</b>			
99.873	Air Liquide SA	15.286.561	0,49
600.134	Bureau Veritas SA	17.490.905	0,56
151.068	Legrand SA	15.503.354	0,50
71.149	L'Oreal SA	29.816.767	0,95
35.730	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	25.895.318	0,83
<b>Deutschland - 116.690.913</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 130.032.769)</b>			
560.246	Bayer AG	26.365.177	0,84
256.861	Continental AG	23.926.602	0,77
650.237	RWE AG	23.161.442	0,74
243.675	Volkswagen AG - Preference	43.237.692	1,39
<b>Guernsey - 2.020.415</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.793.238)</b>			
5.954.200	Amedeo Air Four Plus Ltd	2.020.415	0,07
<b>Hongkong - 46.297.470</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 57.929.251)</b>			
3.307.600	AIA Group Ltd	29.463.334	0,94
2.166.000	Link REIT (Units) (REIT)	16.834.136	0,54

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Indien - 22.615.910</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.254.853)</b>			
735.870	Housing Development Finance Corp Ltd	22.615.910	0,72
<b>Irland - 175.729.128</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 149.211.335)</b>			
76.996	Accenture Plc - Class A	28.159.976	0,90
6.596.602	Greencoat Renewables Plc	7.355.211	0,24
4.555	Kerry Group Plc	519.498	0,02
160.225	Linde Plc	48.748.388	1,56
454.592	Medtronic Plc	41.968.967	1,34
315.067	Ryanair Holdings Plc ADR	28.446.071	0,91
115.710	Trane Technologies Plc	20.531.017	0,66
<b>Japan - 81.860.778</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 29.958.552)</b>			
283.400	Advantest Corp	23.707.544	0,76
360.200	Sony Group Corp	40.049.526	1,28
532.000	Suzuki Motor Corp	18.103.708	0,58
<b>Jersey - 17.000.914</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.268.214)</b>			
109.063	Ferguson Plc	17.000.914	0,54
<b>Niederlande - 58.603.997</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 26.725.046)</b>			
61.483	ASML Holding NV	43.569.928	1,40
605.785	Universal Music Group NV	15.034.069	0,48
<b>Norwegen - 11.209.716</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
177.417	TOMRA Systems ASA	11.209.716	0,36
<b>Republik Korea - 23.691.757</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 27.181.274)</b>			
48.630	Samsung SDI Co Ltd	23.691.757	0,76
<b>Schweiz - 133.202.817</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 115.881.669)</b>			
413.201	Alcon Inc	32.288.219	1,04
137.711	Chubb Ltd	23.498.525	0,75
25.423	Lonza Group AG	18.739.196	0,60
127.890	Nestle SA	15.775.560	0,51
302.287	TE Connectivity Ltd	42.901.317	1,37
<b>Vereinigtes Königreich - 343.171.805</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 243.239.383)</b>			
859.556	3i Group Plc	14.887.946	0,48
896.758	Associated British Foods Plc	21.375.269	0,68
480.719	AstraZeneca Plc	49.322.471	1,58
1.835.589	BAE Systems Plc	12.022.349	0,38
2.485.400	Barratt Developments Plc	22.104.930	0,71
723.882	Diageo Plc	34.655.654	1,11
5.347.406	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	7.589.124	0,24
1.947.683	Informa Plc	11.900.828	0,38
8.876.289	Melrose Industries Plc	16.740.132	0,54
585.543	Persimmon Plc	19.949.168	0,64
2.412.156	Prudential Plc	36.459.470	1,17
1.126.650	Relx Plc	32.092.625	1,03
9.563.858	Taylor Wimpey Plc	19.972.616	0,64
881.366	Travis Perkins Plc	16.506.586	0,53
525.725	Unilever Plc	24.617.073	0,79
1.053.172	Wickes Group Plc	2.975.564	0,09
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 720.241.563</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 521.763.297)</b>			
220.643	Abbott Laboratories	27.487.525	0,88
18.174	Alphabet Inc - Class A	46.953.565	1,50
9.881	Amazon.com Inc	29.453.725	0,94
27.608	American Tower Corp (REIT)	7.102.438	0,23
693.619	Bank of America Corp	27.285.749	0,87
233.773	CME Group Inc	47.218.268	1,51

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
554.484	ConocoPhillips	35.414.264	1,13
181.533	Dominion Energy Inc	12.586.294	0,40
179.091	Ecolab Inc	37.032.592	1,19
453.038	Elanco Animal Health Inc	11.485.551	0,37
41.620	Eli Lilly & Co	10.197.696	0,33
129.803	Eversource Energy	10.451.555	0,34
110.515	Fidelity National Information Services Inc	10.740.998	0,34
71.916	Goldman Sachs Group Inc/The	24.493.431	0,79
86.297	Hubbell Inc - Class B	15.810.755	0,51
31.592	IDEXX Laboratories Inc	18.467.156	0,59
308.847	JPMorgan Chase & Co	43.232.017	1,39
36.771	Lockheed Martin Corp	11.490.670	0,37
76.055	Mastercard Inc	24.266.902	0,78
147.923	Microsoft Corp	44.349.440	1,42
178.247	Morgan Stanley	15.558.516	0,50
264.485	NIKE Inc	39.141.710	1,25
135.785	Norfolk Southern Corp	35.359.753	1,13
380.713	Otis Worldwide Corp	29.056.749	0,93
87.628	salesforce.com Inc	19.766.133	0,63
54.350	Sherwin-Williams Co/The	16.825.998	0,54
64.264	Thermo Fisher Scientific Inc	37.796.712	1,21
278.741	Yum China Holdings Inc	12.134.963	0,39
88.110	Zoetis Inc	19.080.438	0,61
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>1.972.897.150</b>	<b>63,20</b>
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Guernsey - 119.250.810</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 105.213.933)</b>			
6.549.058	Bluefield Solar Income Fund Ltd	9.684.399	0,31
14.081.036	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	21.006.705	0,67
17.589.278	International Public Partnerships Ltd	35.538.746	1,14
6.816.822	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	8.546.387	0,27
27.855.487	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	44.474.573	1,43
<b>Luxemburg - 13.353.511</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.379.424)</b>			
6.379.760	BBGI Global Infrastructure SA	13.353.511	0,43
<b>Vereinigtes Königreich - 77.385.503</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 66.132.581)</b>			
23.468.108	BioPharma Credit Plc/The Fund	20.091.522	0,64
25.091.832	Greencoat UK Wind Plc/Funds	42.003.931	1,35
10.952.766	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	15.290.050	0,49
<b>Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumenten</b>		<b>209.989.824</b>	<b>6,73</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Luxemburg - 44.051.853</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
318.018	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	44.051.853	1,41
<b>Vereinigtes Königreich - 139.975.593</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 88.559.036)</b>			
768.117	Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	70.922.926	2,27
768.117	Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	69.052.667	2,21
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>184.027.446</b>	<b>5,89</b>
<b>Indexoptionen - 26.754.878</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 23.915.389)</b>			
743	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000	3.971.506	0,13
799	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000	18.798.748	0,60
7434	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000	3.984.624	0,13
<b>Indexoptionen insgesamt</b>		<b>26.754.878</b>	<b>0,86</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 1.619.234</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 3.967.462)</b>				
413	FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	23.078.622	405.794	0,01
367	Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	81.061.955	1.213.440	0,04

**Offene Terminkontrakte insgesamt 1.619.234 0,05**

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.678.463 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 65.016.516) 2.678.463 0,09

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 2.731.136.840 87,49**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Indexoptionen - (18.691.421)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (8.313.488))</b>				
(743)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022	4.250.000	(2.533.886)	(0,08)
(799)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022	4.200.000	(13.629.975)	(0,44)
(7.434)	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022	3.750.000	(2.527.560)	(0,08)

**Indexoptionen insgesamt (18.691.421) (0,60)**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (2.277.516)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(550)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(115.948.960)	(2.277.516)	(0,07)

**Offene Terminkontrakte insgesamt (2.277.516) (0,07)**

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (44.019.460) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (16.084.605)) (44.019.460) (1,41)

**Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (64.988.397) (2,08)**

**Nettoumlaufvermögen 455.580.316 14,59**

**Summe Nettovermögen 3.121.728.759 100,00**

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

**Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	84,58
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,89
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,08
Sonstiges Umlaufvermögen	14,45
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)**

Euro	Schwedische Krone	12.149.098	120.421.827	14. Jan. 22	State Street Bank	408.666
Indische Rupie	US-Dollar	4.225.986.219	56.154.808	14. Jan. 22	State Street Bank	556.382
Pfund Sterling	Euro	4.095.263	4.810.950	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	63.827
Pfund Sterling	Euro	16.533.770	19.400.494	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	280.399
Euro	Japanischer Yen	1.822.359	234.099.230	18. Feb. 22	State Street Bank	26.706
Euro	Japanischer Yen	1.055.350	135.494.118	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	16.045
Euro	Japanischer Yen	16.780.244	2.167.523.478	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	154.304
Hongkong-Dollar	Euro	25.870.602	2.925.080	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	3.518
Schweizer Franken	Euro	4.838.719	4.590.993	18. Feb. 22	State Street Bank	92.604
Schweizer Franken	Euro	1.658.451	1.583.941	18. Feb. 22	State Street Bank	21.342
Schweizer Franken	Euro	3.921.514	3.737.904	18. Feb. 22	State Street Bank	57.893
Schweizer Franken	Euro	2.564.353	2.446.673	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	35.471
Schweizer Franken	Euro	4.127.016	3.941.068	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	53.642
Schweizer Franken	Euro	7.234.992	6.912.014	18. Feb. 22	State Street Bank	91.036
Schweizer Franken	Euro	5.760.513	5.482.513	18. Feb. 22	State Street Bank	93.327
Schweizer Franken	Euro	2.801.830	2.661.037	18. Feb. 22	State Street Bank	50.971
Schweizer Franken	Euro	2.462.053	2.332.307	18. Feb. 22	State Street Bank	50.816
Schweizer Franken	Euro	2.845.949	2.703.093	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	51.619
Schweizer Franken	Euro	2.897.188	2.745.618	18. Feb. 22	State Street Bank	58.691
Schweizer Franken	Euro	3.381.158	3.207.419	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	65.345
Schweizer Franken	Euro	2.867.990	2.711.438	18. Feb. 22	State Street Bank	64.608
Schweizer Franken	Euro	2.899.494	2.740.281	18. Feb. 22	State Street Bank	66.260
Schweizer Franken	Euro	4.382.105	4.194.592	18. Feb. 22	State Street Bank	47.029
US-Dollar	Euro	11.291.050	9.909.743	18. Feb. 22	State Street Bank	57.036
US-Dollar	Euro	11.643.894	10.220.307	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	57.933
US-Dollar	Euro	10.938.201	9.591.547	18. Feb. 22	State Street Bank	63.767
Australischer Dollar	Euro	1.621.691	1.022.851	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	14.606
						<b>EUR 2.603.843</b>
Euro	Pfund Sterling	436.824	370.339	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(4.007)
Euro	Pfund Sterling	675.431	571.592	14. Jan. 22	State Street Bank	(4.960)
Euro	Pfund Sterling	614.464	522.445	14. Jan. 22	State Street Bank	(7.428)
Euro	Pfund Sterling	3.132.351	2.667.183	14. Jan. 22	State Street Bank	(42.517)
Euro	Pfund Sterling	526.801	448.569	14. Jan. 22	State Street Bank	(7.151)
Euro	Pfund Sterling	1.264.114	1.076.896	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(17.764)
Euro	Pfund Sterling	420.413	358.737	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(6.608)
Euro	Pfund Sterling	482.569.709	411.861.183	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(7.687.253)
Euro	Pfund Sterling	1.415.845	1.190.274	14. Jan. 22	State Street Bank	(1.192)
Euro	Pfund Sterling	398.655	334.218	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(1.179)
Euro	Pfund Sterling	482.343	408.621	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(4.057)
Russischer Rubel	US-Dollar	1.312.442.395	18.194.076	14. Jan. 22	State Street Bank	(643.366)
Russischer Rubel	US-Dollar	661.697.430	9.174.251	14. Jan. 22	State Street Bank	(325.513)
Schwedische Krone	Euro	549.752.645	54.208.555	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(610.853)
US-Dollar	Indische Rupie	10.818.420	817.991.564	14. Jan. 22	State Street Bank	(152.773)
US-Dollar	Indische Rupie	44.774.873	3.407.994.655	14. Jan. 22	State Street Bank	(899.610)
Australischer Dollar	US-Dollar	65.013.781	48.158.666	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(898.575)
Euro	Hongkong-Dollar	63.828.875	576.099.954	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	(1.386.645)
Euro	Japanischer Yen	79.638.072	10.458.246.869	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	(581.676)
Euro	Schweizer Franken	98.324.462	104.026.642	18. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(2.367.249)
Euro	Schweizer Franken	7.021.288	7.305.406	18. Feb. 22	State Street Bank	(49.919)
Euro	Schweizer Franken	5.260.472	5.469.075	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(33.274)
Euro	US-Dollar	378.065	429.930	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(1.441)
Euro	US-Dollar	3.380.901	3.879.976	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(44.012)
Euro	US-Dollar	1.064.246.344	1.235.478.260	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(26.328.848)
Euro	US-Dollar	183.653	209.294	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.094)
Euro	US-Dollar	6.690.073	7.607.790	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(25.438)
Euro	US-Dollar	1.068.931	1.211.590	18. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	(557)
Euro	US-Dollar	6.604.166	7.575.427	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(82.777)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.</b>						
Hongkong-Dollar	Euro	6.555.659	745.298	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(3.186)
Hongkong-Dollar	Euro	5.413.313	613.027	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(230)
Hongkong-Dollar	Euro	3.572.920	404.523	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(62)
Hongkong-Dollar	Euro	13.841.765	1.568.873	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(1.961)
Ungarischer Forint	Euro	22.616.747.582	62.436.154	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.600.446)
Japanischer Yen	Euro	669.724.311	5.226.376	18. Feb. 22	State Street Bank	(89.271)
Euro	Australischer Dollar	7.215.749	11.430.266	16. Mrz. 22	Royal Bank of Scotland	(96.626)
						<b>EUR (44.009.516)</b>

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	Euro	903.299	864.759	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9.412
Schweizer Franken	Euro	4.952	4.763	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	29
Schweizer Franken	Euro	7.651	7.345	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	59
Schweizer Franken	Euro	8.441	8.139	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	30
						<b>EUR 9.530</b>
						<b>CHF 9.848</b>
Euro	Schweizer Franken	11.559	12.013	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(67)
Euro	Schweizer Franken	6.327	6.585	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(45)
						<b>EUR (112)</b>
						<b>CHF (116)</b>

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)

Singapur-Dollar	Euro	26.469	17.194	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	126
Singapur-Dollar	Euro	40.889	26.482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	274
Singapur-Dollar	Euro	4.774.044	3.093.338	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	30.542
Singapur-Dollar	Euro	44.879	29.262	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	105
						<b>EUR 31.047</b>
						<b>SGD 47.434</b>
Euro	Singapur-Dollar	39.617	61.223	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(444)
Euro	Singapur-Dollar	23.371	36.126	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(268)
						<b>EUR (712)</b>
						<b>SGD (1.088)</b>

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	Euro	8.367	9.907	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	52
Pfund Sterling	Euro	12.842	15.125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	161
Pfund Sterling	Euro	14.374	17.081	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	29
Pfund Sterling	Euro	1.526.478	1.783.557	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33.479
						<b>EUR 33.721</b>
						<b>GBP 28.322</b>
Euro	Pfund Sterling	23.743	20.303	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(424)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Euro	Pfund Sterling	13.428	11.447	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(199)
						<b>EUR (623)</b>
						<b>GBP (523)</b>

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	50.291	56.856	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	68
Euro	US-Dollar	28.923	32.626	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	104
US-Dollar	Euro	24.631	21.750	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7
US-Dollar	Euro	37.894	33.443	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	30
US-Dollar	Euro	59.480	52.494	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	47
US-Dollar	Euro	41.835	36.889	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	66
						<b>EUR 322</b>
						<b>USD 364</b>
US-Dollar	Euro	4.366.774	3.865.790	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8.497)
						<b>EUR (8.497)</b>
						<b>USD (9.617)</b>

# BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Guernsey - 280.659</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>280.659</b>	<b>0,42</b>
87.936	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	91.014	0,14
167.828	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	189.645	0,28
<b>Irland - 313.692</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.120.819)</b>		<b>313.692</b>	<b>0,48</b>
4.241	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	313.692	0,48
<b>Jersey - 2.288.129</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>2.288.129</b>	<b>3,47</b>
16.423	WisdomTree Copper - ETF	477.968	0,72
337.922	WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	1.810.161	2,75
<b>Vereinigtes Königreich - 209.528</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 197.469)</b>		<b>209.528</b>	<b>0,32</b>
160.866	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	209.528	0,32
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>3.092.008</b>	<b>4,69</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Frankreich - 239.363</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 853.353)</b>		<b>239.363</b>	<b>0,36</b>
145.000	Altice France SA/France 'REGS' 4,125% 15-Jan-2029	121.330	0,18
133.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5,625% 15-Oct-2028	118.033	0,18
<b>Deutschland - 87.130</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 285.977)</b>		<b>87.130</b>	<b>0,13</b>
100.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4,375% 15-Jul-2027	87.130	0,13
<b>Indien - 100.212</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 100.923)</b>		<b>100.212</b>	<b>0,15</b>
10.000.000	National Highways Authority of India 7,300% 18-May-2022	100.212	0,15
<b>Irland - 178.087</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 189.831)</b>		<b>178.087</b>	<b>0,27</b>
200.000	AlB Group Plc FRN (Perpetual) 5,250% 09-Oct-2024	178.087	0,27
<b>Italien - 558.492</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 556.598)</b>		<b>558.492</b>	<b>0,85</b>
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7,700% 17-Sep-2025	167.079	0,25
284.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 03-Jun-2027	228.812	0,35
200.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8,000% 03-Jun-2024	162.601	0,25
<b>Luxemburg - 174.638</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 189.773)</b>		<b>174.638</b>	<b>0,27</b>
199.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750% 31-Oct-2026	174.638	0,27
<b>Spanien - 534.766</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 564.255)</b>		<b>534.766</b>	<b>0,81</b>
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5,875% 24-Sep-2023	179.485	0,27
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,000% 29-Mar-2024	181.163	0,28
200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,750% 19-Mar-2025	174.118	0,26
<b>Vereinigtes Königreich - 4.025.858</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.208.107)</b>		<b>4.025.858</b>	<b>6,11</b>
276.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4,947% 27-Jun-2025	254.006	0,39
3.600.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-Apr-2022	3.598.596	5,46

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
176.000	Vmed 02 UK Financing I Plc 'REGS' 4,000% 31-Jan-2029	173.256	0,26
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 1.149.862</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.707.324)</b>		<b>1.149.862</b>	<b>1,75</b>
250.000	American Airlines Inc '144A' 11,750% 15-Jul-2025	230.288	0,35
186.000	Ball Corp 2,875% 15-Aug-2030	134.334	0,20
200.944	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4,750% 20-Oct-2028	163.083	0,25
200.000	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6,500% 20-Jun-2027	158.839	0,24
215.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4,500% 15-Sep-2026	161.732	0,25
150.000	Sprint Capital Corp 8,750% 15-Mar-2032	167.150	0,25
131.000	Sprint Corp 7,125% 15-Jun-2024	108.998	0,17
33.000	United Airlines Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2026	25.438	0,04
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>7.048.408</b>	<b>10,70</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Kaiman-Inseln - 500.150</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.532.719)</b>		<b>500.150</b>	<b>0,76</b>
16.223	Alibaba Group Holding Ltd	183.471	0,28
4.280	Tencent Holdings Ltd	185.999	0,28
25.690	Tencent Music Entertainment Group ADR	130.680	0,20
<b>China - 476.898</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 363.539)</b>		<b>476.898</b>	<b>0,72</b>
40.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	150.632	0,23
16.000	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	195.801	0,29
13.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	130.465	0,20
<b>Dänemark - 722.170</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 725.086)</b>		<b>722.170</b>	<b>1,10</b>
5.159	Novozymes A/S	314.161	0,48
4.324	Orsted AS '144A'	408.009	0,62
<b>Finnland - 271.121</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>271.121</b>	<b>0,41</b>
7.455	Neste Oyj	271.121	0,41
<b>Frankreich - 2.243.887</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.410.013)</b>		<b>2.243.887</b>	<b>3,40</b>
2.615	Air Liquide SA	336.172	0,51
16.546	Bureau Veritas SA	405.028	0,61
3.805	Legrand SA	327.971	0,50
1.800	L'Oreal SA	633.566	0,96
889	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	541.150	0,82
<b>Deutschland - 2.326.830</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.687.947)</b>		<b>2.326.830</b>	<b>3,53</b>
13.441	Bayer AG	531.265	0,80
6.219	Continental AG	486.554	0,74
16.700	RWE AG	499.618	0,76
5.431	Volkswagen AG - Preference	809.393	1,23
<b>Guernsey - 35.653</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 52.776)</b>		<b>35.653</b>	<b>0,05</b>
125.098	Amedeo Air Four Plus Ltd	35.653	0,05
<b>Hongkong - 902.209</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.222.401)</b>		<b>902.209</b>	<b>1,37</b>
82.200	AlA Group Ltd	614.990	0,93
44.000	Link REIT (Units) (REIT)	287.219	0,44
<b>Indien - 492.928</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 366.223)</b>		<b>492.928</b>	<b>0,75</b>
19.096	Housing Development Finance Corp Ltd	492.928	0,75

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Irland - 3.403.783</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.134.009)</b>		<b>3.403.783</b>	<b>5,17</b>
2.081	Accenture Plc - Class A	639.240	0,97
139.441	Greencoat Renewables Plc	130.585	0,20
118	Kerry Group Plc	11.303	0,02
3.751	Linde Plc	958.528	1,45
9.410	Medtronic Plc	729.666	1,11
6.492	Ryanair Holdings Plc ADR	492.295	0,75
2.967	Trane Technologies Plc	442.166	0,67
<b>Japan - 1.682.065</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 536.633)</b>		<b>1.682.065</b>	<b>2,55</b>
7.300	Advantest Corp	512.906	0,78
9.000	Sony Group Corp	840.473	1,27
11.500	Suzuki Motor Corp	328.686	0,50
<b>Jersey - 412.676</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 364.202)</b>		<b>412.676</b>	<b>0,63</b>
3.152	Ferguson Plc	412.676	0,63
<b>Niederlande - 1.180.298</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 562.920)</b>		<b>1.180.298</b>	<b>1,79</b>
1.464	ASML Holding NV	871.366	1,32
14.821	Universal Music Group NV	308.932	0,47
<b>Norwegen - 224.899</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>224.899</b>	<b>0,34</b>
4.238	TOMRA Systems ASA	224.899	0,34
<b>Republik Korea - 491.842</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 615.402)</b>		<b>491.842</b>	<b>0,75</b>
1.202	Samsung SDI Co Ltd	491.842	0,75
<b>Schweiz - 2.872.366</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.499.997)</b>		<b>2.872.366</b>	<b>4,36</b>
10.386	Alcon Inc	681.646	1,04
3.531	Chubb Ltd	506.054	0,77
662	Lonza Group AG	409.836	0,62
3.196	Nestle SA	331.118	0,50
7.917	TE Connectivity Ltd	943.712	1,43
<b>Vereinigtes Königreich - 6.818.158</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.872.869)</b>		<b>6.818.158</b>	<b>10,35</b>
21.574	3i Group Plc	313.848	0,48
13.447	Associated British Foods Plc	269.209	0,41
12.309	AstraZeneca Plc	1.060.728	1,61
50.186	BAE Systems Plc	276.073	0,42
54.354	Barratt Developments Plc	406.024	0,61
18.229	Diageo Plc	732.988	1,11
249.180	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	297.022	0,45
54.907	Informa Plc	281.783	0,43
14.346	Persimmon Plc	410.511	0,62
60.311	Prudential Plc	765.648	1,16
29.654	Relx Plc	709.459	1,08
220.849	Taylor Wimpey Plc	387.369	0,59
22.242	Travis Perkins Plc	349.867	0,53
12.675	Unilever Plc	498.487	0,76
24.923	Wickes Group Plc	59.142	0,09
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 15.012.880</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.903.927)</b>		<b>15.012.880</b>	<b>22,78</b>
874	Abbott Laboratories	91.450	0,14
4.632	Abbott Laboratories	484.665	0,74
442	Alphabet Inc - Class A	959.109	1,46
256	Amazon.com Inc	640.925	0,97
668	American Tower Corp (REIT)	144.337	0,22
16.548	Bank of America Corp	546.749	0,83
5.816	CME Group Inc	986.661	1,50
13.279	ConocoPhillips	712.332	1,08
4.806	Dominion Energy Inc	279.868	0,42
2.546	Ecolab Inc	442.177	0,67
1.510	Ecolab Inc	262.250	0,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
10.860	Elanco Animal Health Inc	231.246	0,35
1.031	Eli Lilly & Co	212.171	0,32
333	Eversource Energy	22.520	0,03
3.842	Eversource Energy	259.825	0,39
2.797	Fidelity National Information Services Inc	228.320	0,35
1.804	Goldman Sachs Group Inc/The	516.046	0,78
2.228	Hubbell Inc - Class B	342.847	0,52
782	IDEXX Laboratories Inc	383.935	0,58
7.280	JPMorgan Chase & Co	855.896	1,30
1.073	Lockheed Martin Corp	281.622	0,43
1.936	Mastercard Inc	518.824	0,79
3.647	Microsoft Corp	918.366	1,39
64	Microsoft Corp	16.116	0,02
4.390	Morgan Stanley	321.839	0,49
5.921	NIKE Inc	735.972	1,12
3.328	Norfolk Southern Corp	727.895	1,10
10.336	Otis Worldwide Corp	662.567	1,01
2.072	salesforce.com Inc	392.551	0,60
1.512	Sherwin-Williams Co/The	393.152	0,60
1.618	Thermo Fisher Scientific Inc	799.268	1,21
6.304	Yum China Holdings Inc	230.506	0,35
2.259	Zoetis Inc	410.873	0,62
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>40.070.813</b>	<b>60,81</b>
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Guernsey - 2.230.900</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.209.747)</b>		<b>2.230.900</b>	<b>3,39</b>
131.949	Bluefield Solar Income Fund Ltd	163.881	0,25
332.581	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	416.724	0,63
359.692	International Public Partnerships Ltd	610.397	0,93
147.586	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	155.408	0,24
659.575	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	884.490	1,34
<b>Luxemburg - 246.440</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 266.913)</b>		<b>246.440</b>	<b>0,37</b>
140.182	BBGI Global Infrastructure SA	246.440	0,37
<b>Vereinigtes Königreich - 1.762.163</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.692.944)</b>		<b>1.762.163</b>	<b>2,67</b>
646.769	BioPharma Credit Plc/The Fund	465.063	0,70
458.355	Greencoat UK Wind Plc/Funds	644.447	0,98
556.634	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	652.653	0,99
<b>Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>		<b>4.239.503</b>	<b>6,43</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Luxemburg - 890.024</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
7.650	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	890.024	1,35
<b>Vereinigtes Königreich - 2.795.889</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.057.163)</b>			
18.267	Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	1.416.623	2,15
18.267	Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	1.379.266	2,09
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>3.685.913</b>	<b>5,59</b>
<b>Indexoptionen - 540.005</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 532.999)</b>			
18	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000	80.810	0,12
19	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000	375.460	0,57
186	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000	83.735	0,13
<b>Indexoptionen insgesamt</b>		<b>540.005</b>	<b>0,82</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 29.700</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 91.828)</b>				
10	FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	469.340	8.230	0,01
8	Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.484.119	21.470	0,03
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>29.700</b>	<b>0,04</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 208.957 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.814.858)				
			208.957	0,32
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>58.915.307</b>	<b>89,40</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettovermögen %
<b>Indexoptionen - (376.900)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (185.509))</b>				
(18)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000		(51.558)	(0,08)
(19)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000		(272.226)	(0,41)
(186)	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000		(53.116)	(0,08)
<b>Indexoptionen insgesamt</b>			<b>(376.900)</b>	<b>(0,57)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (46.560)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(13)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.301.841)	(46.560)	(0,07)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(46.560)</b>	<b>(0,07)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (180.785) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (257.658))				
			(180.785)	(0,28)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(604.245)</b>	<b>(0,92)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>7.585.983</b>	<b>11,52</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>65.897.045</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	87,35
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,86
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,31
Sonstiges Umlaufvermögen	11,48
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<b>Devisenterminkontrakte</b>							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>							
Euro	Pfund Sterling	1	1	14. Jan. 22	HSBC Bank plc	-	
Indische Rupie	US-Dollar	100.992.856	1.341.991	14. Jan. 22	State Street Bank	11.170	
Pfund Sterling	Euro	601.448	705.654	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	8.633	
Pfund Sterling	Euro	145.850	172.689	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	775	
Pfund Sterling	Euro	52.752	61.922	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	732	
Pfund Sterling	Euro	78.135	91.573	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	1.206	
Pfund Sterling	Euro	8.398.940	9.842.074	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	130.688	
Pfund Sterling	Euro	60.821	71.399	14. Jan. 22	State Street Bank	839	
Pfund Sterling	Euro	125.894	147.481	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.996	
Pfund Sterling	Japanischer Yen	1.553.106	237.789.913	18. Feb. 22	State Street Bank	19.529	
Pfund Sterling	Japanischer Yen	19.586	2.948.263	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	572	
Pfund Sterling	Japanischer Yen	33.850	5.109.625	18. Feb. 22	State Street Bank	897	
Pfund Sterling	Japanischer Yen	244.492	37.520.217	18. Feb. 22	State Street Bank	2.513	
Pfund Sterling	Schweizer Franken	150.192	182.749	18. Feb. 22	State Street Bank	1.463	
Pfund Sterling	Schweizer Franken	182.716	222.635	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	1.527	
Pfund Sterling	US-Dollar	70.077	94.166	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	188	
Pfund Sterling	US-Dollar	15.422	20.658	18. Feb. 22	State Street Bank	90	
Pfund Sterling	US-Dollar	136.302	182.718	18. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	692	
Pfund Sterling	US-Dollar	24.262	32.675	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	11	
Pfund Sterling	US-Dollar	134.587	180.836	18. Feb. 22	State Street Bank	374	
Pfund Sterling	US-Dollar	3.865	5.201	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	5	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	36.545	29.454	18. Feb. 22	State Street Bank	289	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	85.686	68.682	18. Feb. 22	State Street Bank	1.053	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	56.515	45.512	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	482	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	93.117	74.817	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	965	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	62.778	50.961	18. Feb. 22	State Street Bank	131	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	135.014	108.199	18. Feb. 22	State Street Bank	1.681	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	61.627	49.372	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	783	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	54.107	43.887	18. Feb. 22	State Street Bank	147	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	114.739	92.181	18. Feb. 22	State Street Bank	1.198	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	74.347	60.502	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	5	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	64.218	52.168	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	96	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	63.680	51.715	18. Feb. 22	State Street Bank	110	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	169.655	136.632	18. Feb. 22	State Street Bank	1.440	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	63.195	51.062	18. Feb. 22	State Street Bank	368	
Pfund Sterling	Dänische Krone	779.801	6.748.078	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC	16.309	
						<b>GBP</b>	<b>208.957</b>
Euro	Pfund Sterling	54.242	46.228	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(660)	
Euro	Pfund Sterling	38.261	32.248	14. Jan. 22	HSBC Bank plc	(105)	
Euro	Pfund Sterling	44.466	37.865	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(509)	
Euro	Pfund Sterling	69.425	58.725	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(402)	
Euro	Pfund Sterling	38.364	32.415	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(186)	
Euro	Pfund Sterling	69.944	59.900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.140)	
Euro	Pfund Sterling	101.452	85.254	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(25)	
Euro	Pfund Sterling	442.961	375.245	14. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	(3.117)	
Russischer Rubel	US-Dollar	31.571.589	437.669	14. Jan. 22	State Street Bank	(13.002)	
Russischer Rubel	US-Dollar	16.053.669	222.580	14. Jan. 22	State Street Bank	(6.635)	
Pfund Sterling	Koreanischer Won	550.507	883.563.821	14. Jan. 22	State Street Bank	(1.020)	
US-Dollar	Indische Rupie	1.133.173	86.250.297	14. Jan. 22	State Street Bank	(19.127)	
US-Dollar	Indische Rupie	194.979	14.742.559	14. Jan. 22	State Street Bank	(2.313)	
Australischer Dollar	US-Dollar	1.547.368	1.146.206	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(17.982)	
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	274.774	26.660	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(507)	
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	98.334	9.512	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(152)	
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	102.137	9.855	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(133)	
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	66.164	6.388	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(91)	
Ungarischer Forint	Pfund Sterling	240.888.460	571.065	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(26.721)	
Pfund Sterling	Hongkong-Dollar	1.536.555	16.169.627	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(2.461)	
Pfund Sterling	Schweizer Franken	1.713.481	2.111.048	18. Feb. 22	State Street Bank	(4.574)	
Pfund Sterling	US-Dollar	15.685	21.200	18. Feb. 22	The Bank of New York Mellon	(49)	
Pfund Sterling	US-Dollar	21.791.471	29.467.408	18. Feb. 22	State Street Bank	(78.701)	
Pfund Sterling	US-Dollar	6.799	9.180	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(14)	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	102.740	83.893	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(279)	
Dänische Krone	Pfund Sterling	168.253	19.257	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	(221)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrech- nungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
------	---------	---------------	---------------	----------------------------	------------	---

**BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.**

Dänische Krone	Pfund Sterling	401.335	46.067	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	(659)
<b>GBP</b>						<b>(180.785)</b>



# BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Guernsey - 1.419.211</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
374.368	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	522.156	0,12
589.087	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	897.055	0,21
<b>Irland - 2.104.475</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.199.041)</b>			
2.104.475	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	2.104.475	0,48
<b>Jersey - 13.835.809</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
71.244	WisdomTree Copper - ETF	2.794.190	0,64
1.529.575	WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	11.041.619	2,52
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>17.359.495</b>	<b>3,97</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Frankreich - 1.903.546</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.018.200)</b>			
346.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029	387.508	0,09
505.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	569.450	0,13
179.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	203.905	0,04
621.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	742.683	0,17
<b>Deutschland - 486.102</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.498.334)</b>			
414.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	486.102	0,11
<b>Indien - 405.137</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 413.219)</b>			
30.000.000	National Highways Authority of India 7,300% 18-May-2022	405.137	0,09
<b>Irland - 1.222.753</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.320.020)</b>			
1.019.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024	1.222.753	0,28
<b>Italien - 2.941.634</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.967.572)</b>			
945.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7,700% 17-Sep-2025	1.063.862	0,24
897.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	973.898	0,22
825.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8,000% 03-Jun-2024	903.874	0,21
<b>Luxemburg - 684.740</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 753.580)</b>			
579.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750% 31-Oct-2026	684.740	0,16
<b>Spanien - 4.298.514</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.605.526)</b>			
600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5,875% 24-Sep-2023	725.622	0,17
800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,000% 29-Mar-2024	976.542	0,22
1.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,750% 19-Mar-2025	1.407.850	0,32
1.000.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5,250% 29-Sep-2023	1.188.500	0,27
<b>Vereinigtes Königreich - 1.173.322</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.684.560)</b>			
62.000	Tesco Plc 'EMTN' 6,125% 24-Feb-2022	84.196	0,02
821.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4,000% 31-Jan-2029	1.089.126	0,25

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 30.746.845</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.700.797)</b>			
659.000	Ball Corp 2,875% 15-Aug-2030	641.385	0,15
465.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500% 01-May-2026	478.339	0,11
114.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4,750% 20-Oct-2028	124.681	0,03
513.000	Sprint Capital Corp 8,750% 15-Mar-2032	770.362	0,18
468.000	Sprint Corp 7,125% 15-Jun-2024	524.752	0,12
134.000	United Airlines Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2026	139.201	0,03
28.000.000	United States Treasury Note/Bond 2,000% 15-Feb-2022	28.068.125	6,41
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>43.862.593</b>	<b>10,02</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 1.236.276</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.298.063)</b>			
464.634	Star Entertainment Grp Ltd/The	1.236.276	0,28
<b>Kaiman-Inseln - 3.200.520</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.432.465)</b>			
77.890	Alibaba Group Holding Ltd	1.187.075	0,27
20.420	Tencent Holdings Ltd	1.195.870	0,27
119.267	Tencent Music Entertainment Group ADR	817.575	0,19
<b>China - 3.092.822</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.708.988)</b>			
199.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	1.009.884	0,23
77.100	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	1.271.481	0,29
60.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	811.457	0,19
<b>Dänemark - 5.344.629</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.517.062)</b>			
25.129	Novozymes A/S	2.062.165	0,47
25.814	Orsted AS '144A'	3.282.464	0,75
<b>Finnland - 1.818.287</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
37.101	Neste Oyj	1.818.287	0,42
<b>Frankreich - 14.541.771</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.282.451)</b>			
11.373	Air Liquide SA	1.970.270	0,45
71.894	Bureau Veritas SA	2.371.623	0,54
24.617	Legrand SA	2.859.416	0,65
7.828	L'Oreal SA	3.713.057	0,85
4.422	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.627.405	0,83
<b>Deutschland - 16.099.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.906.397)</b>			
59.683	Bayer AG	3.179.008	0,73
29.305	Continental AG	3.089.681	0,70
114.629	RWE AG	4.621.441	1,06
25.936	Volkswagen AG - Preference	5.208.870	1,19
<b>Guernsey - 204.450</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 306.503)</b>			
532.330	Amedeo Air Four Plus Ltd	204.450	0,05
<b>Hongkong - 5.719.117</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.348.448)</b>			
395.800	Alia Group Ltd	3.990.559	0,91
196.500	Link REIT (Units) (REIT)	1.728.558	0,40
<b>Indien - 3.019.964</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.689.630)</b>			
86.816	Housing Development Finance Corp Ltd	3.019.964	0,69
<b>Irland - 24.209.117</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.519.767)</b>			
9.845	Accenture Plc - Class A	4.075.387	0,93
650.381	Greencoat Renewables Plc	820.789	0,19

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Irland Forts.</b>			
483	Kerry Group Plc	62.349	0,01
23.723	Linde Plc	8.169.371	1,87
43.307	Medtronic Plc	4.525.365	1,03
35.392	Ryanair Holdings Plc ADR	3.616.709	0,83
14.635	Trane Technologies Plc	2.939.147	0,67
<b>Japan - 10.885.248</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.664.503)</b>		<b>10.885.248</b>	<b>2,49</b>
35.400	Advantest Corp	3.351.807	0,77
44.100	Sony Group Corp	5.549.850	1,27
51.500	Suzuki Motor Corp	1.983.591	0,45
<b>Jersey - 2.121.979</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.707.427)</b>		<b>2.121.979</b>	<b>0,48</b>
12.027	Ferguson Plc	2.121.979	0,48
<b>Niederlande - 7.565.565</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.645.401)</b>		<b>7.565.565</b>	<b>1,73</b>
6.776	ASML Holding NV	5.434.933	1,24
75.851	Universal Music Group NV	2.130.632	0,49
<b>Norwegen - 1.508.650</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>1.508.650</b>	<b>0,34</b>
21.096	TOMRA Systems ASA	1.508.650	0,34
<b>Republik Korea - 3.316.789</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.858.785)</b>		<b>3.316.789</b>	<b>0,76</b>
6.015	Samsung SDI Co Ltd	3.316.789	0,76
<b>Schweiz - 19.246.384</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.173.973)</b>		<b>19.246.384</b>	<b>4,40</b>
50.881	Alcon Inc	4.500.154	1,03
17.417	Chubb Ltd	3.363.832	0,77
3.953	Lonza Group AG	3.297.919	0,75
15.910	Nestle SA	2.221.301	0,51
36.500	TE Connectivity Ltd	5.863.178	1,34
<b>Vereinigtes Königreich - 41.881.840</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 23.649.907)</b>		<b>41.881.840</b>	<b>9,57</b>
107.603	3i Group Plc	2.109.473	0,48
59.472	Associated British Foods Plc	1.604.493	0,37
54.550	AstraZeneca Plc	6.334.864	1,45
234.934	BAE Systems Plc	1.741.601	0,40
236.555	Barratt Developments Plc	2.381.299	0,54
90.697	Diageo Plc	4.914.601	1,12
1.015.840	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	1.631.785	0,37
219.732	Informa Plc	1.519.642	0,35
63.106	Persimmon Plc	2.433.468	0,56
286.249	Prudential Plc	4.897.089	1,12
132.518	Relx Plc	4.272.481	0,98
1.096.981	Taylor Wimpey Plc	2.592.925	0,59
99.406	Travis Perkins Plc	2.107.185	0,48
57.211	Unilever Plc	3.032.120	0,69
96.569	Wickes Group Plc	308.814	0,07
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 106.426.720</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 52.622.959)</b>		<b>106.426.720</b>	<b>24,32</b>
27.037	Abbott Laboratories	3.812.352	0,87
2.096	Alphabet Inc - Class A	6.129.123	1,40
1.217	Amazon.com Inc	4.106.000	0,94
3.108	American Tower Corp (REIT)	904.987	0,21
73.944	Bank of America Corp	3.292.357	0,75
25.469	CME Group Inc	5.822.595	1,33
76.158	ConocoPhillips	5.505.462	1,26
5.336	Cooper Cos Inc/The	2.263.478	0,52
27.419	Dominion Energy Inc	2.151.706	0,49
20.141	Ecolab Inc	4.713.900	1,08
56.577	Elanco Animal Health Inc	1.623.477	0,37
5.183	Eli Lilly & Co	1.437.376	0,33
20.001	Eversource Energy	1.822.791	0,42
12.111	Fidelity National Information Services Inc	1.332.271	0,30

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
8.825	Goldman Sachs Group Inc/The	3.401.949	0,78
10.734	Hubbell Inc - Class B	2.225.910	0,51
4.073	IDEXX Laboratories Inc	2.694.799	0,61
44.302	JPMorgan Chase & Co	7.018.987	1,60
4.907	Lockheed Martin Corp	1.735.581	0,40
8.834	Mastercard Inc	3.190.311	0,73
17.977	Microsoft Corp	6.100.405	1,39
22.410	Morgan Stanley	2.213.996	0,50
30.833	NIKE Inc	5.164.682	1,18
23.150	Norfolk Southern Corp	6.823.347	1,56
57.089	Otis Worldwide Corp	4.931.633	1,13
12.478	salesforce.com Inc	3.185.758	0,73
8.836	Sherwin-Williams Co/The	3.096.179	0,71
8.052	Thermo Fisher Scientific Inc	5.360.176	1,22
31.105	Yum China Holdings Inc	1.532.699	0,35
11.556	Zoetis Inc	2.832.433	0,65
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>271.439.128</b>	<b>62,03</b>
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Guernsey - 14.071.017</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.195.198)</b>		<b>14.071.017</b>	<b>3,21</b>
662.365	Bluefield Solar Income Fund Ltd	1.108.614	0,25
1.398.833	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	2.361.991	0,54
1.726.944	International Public Partnerships Ltd	3.949.311	0,90
611.390	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	867.577	0,20
3.200.387	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	5.783.524	1,32
<b>Luxemburg - 1.571.801</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.417.270)</b>		<b>1.571.801</b>	<b>0,36</b>
663.464	BBGI Global Infrastructure SA	1.571.801	0,36
<b>Vereinigtes Königreich - 11.149.726</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.143.652)</b>		<b>11.149.726</b>	<b>2,55</b>
2.754.663	BioPharma Credit Plc/The Fund	2.669.268	0,61
2.162.070	Greencoat UK Wind Plc/Funds	4.096.532	0,94
2.774.528	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	4.383.926	1,00
<b>Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps</b>		<b>26.792.544</b>	<b>6,12</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Luxemburg - 5.660.056</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
36.101	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	5.660.056	1,29
<b>Vereinigtes Königreich - 16.322.758</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 9.224.705)</b>			
79.137	Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	8.270.426	1,89
79.137	Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	8.052.332	1,84
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>21.982.814</b>	<b>5,02</b>
<b>Indexoptionen - 3.645.801</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.524.275)</b>			
92	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000	556.600	0,12
95	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000	2.529.850	0,58
922	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000	559.351	0,13
<b>Indexoptionen insgesamt</b>		<b>3.645.801</b>	<b>0,83</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 189.596</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 413.365)</b>				
40	FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.529.932	44.363	0,01
38	Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	9.500.000	145.233	0,03
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>189.596</b>	<b>0,04</b>

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.191.163 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 660.975)

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 388.463.134 88,76**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Indexoptionen - (2.544.192)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (891.632))</b>				
(92)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000		(355.120)	(0,08)
(95)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000		(1.834.260)	(0,42)
(922)	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000		(354.812)	(0,08)
<b>Indexoptionen insgesamt</b>			<b>(2.544.192)</b>	<b>(0,58)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (316.381)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(67)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(15.987.038)	(316.381)	(0,07)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(316.381)</b>	<b>(0,07)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (362.098) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (4.790.803))				
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(3.222.671)</b>	<b>(0,73)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>52.368.872</b>	<b>11,97</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>437.609.335</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	85,94
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,86
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,72
Sonstiges Umlaufvermögen	12,48
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte		Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>						
US-Dollar	Euro	727.755	628.654	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	16.067
US-Dollar	Euro	61.116.748	52.559.137	14. Jan. 22	State Street Bank	1.615.462
US-Dollar	Euro	492.020	423.181	14. Jan. 22	State Street Bank	12.944
US-Dollar	Euro	316.490	273.636	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	6.711
US-Dollar	Euro	344.692	298.039	14. Jan. 22	HSBC Bank plc	7.288
US-Dollar	Euro	4.287.876	3.686.973	14. Jan. 22	State Street Bank	113.918
US-Dollar	Euro	768.862	661.809	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	19.639
US-Dollar	Euro	3.996.537	3.442.073	14. Jan. 22	State Street Bank	99.826
US-Dollar	Euro	4.440.339	3.917.013	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	5.957
US-Dollar	Pfund Sterling	894.305	654.495	14. Jan. 22	HSBC Bank plc	2.328
US-Dollar	Pfund Sterling	571.554.61	41.986.184	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	576.178
US-Dollar	Pfund Sterling	47.970	35.206	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	528
US-Dollar	Pfund Sterling	482.715	355.585	14. Jan. 22	UBS AG	3.540
US-Dollar	Pfund Sterling	59.897	44.022	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	575
US-Dollar	Pfund Sterling	4.261.351	3.089.991	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	97.374
US-Dollar	Pfund Sterling	4.254.653	3.099.613	14. Jan. 22	State Street Bank	77.710
Hongkong-Dollar	US-Dollar	374.506	48.007	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	20
Schweizer Franken	US-Dollar	242.077	263.094	18. Feb. 22	State Street Bank	2.356
Schweizer Franken	US-Dollar	163.263	175.424	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	3.602
Schweizer Franken	US-Dollar	252.354	271.661	18. Feb. 22	State Street Bank	5.058
Schweizer Franken	US-Dollar	421.595	455.494	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	6.806
Schweizer Franken	US-Dollar	780.938	844.952	18. Feb. 22	State Street Bank	11.387
Schweizer Franken	US-Dollar	622.411	673.484	18. Feb. 22	State Street Bank	9.020
Schweizer Franken	US-Dollar	565.477	611.062	18. Feb. 22	State Street Bank	9.012
Schweizer Franken	US-Dollar	385.587	413.100	18. Feb. 22	State Street Bank	9.716
Schweizer Franken	US-Dollar	275.511	296.855	18. Feb. 22	State Street Bank	5.256
Schweizer Franken	US-Dollar	332.519	362.477	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	2.147
Schweizer Franken	US-Dollar	284.904	312.233	18. Feb. 22	State Street Bank	179
Schweizer Franken	US-Dollar	601.553	651.638	18. Feb. 22	State Street Bank	7.995
Schweizer Franken	US-Dollar	280.088	305.285	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	1.845
US-Dollar	Euro	10.884.953	9.376.346	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	262.786
US-Dollar	Hongkong-Dollar	8.458.163	65.862.232	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	11.812
US-Dollar	Hongkong-Dollar	293.803	2.288.185	18. Feb. 22	UBS AG	360
US-Dollar	Japanischer Yen	4.308.007	490.237.645	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	48.017
US-Dollar	Japanischer Yen	216.983	24.559.553	18. Feb. 22	State Street Bank	3.549
US-Dollar	Japanischer Yen	8.916.608	1.016.713.247	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	81.733
US-Dollar	Japanischer Yen	89.909	10.190.975	18. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank	1.353
US-Dollar	Japanischer Yen	188.676	21.281.025	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	3.752
US-Dollar	Japanischer Yen	2.975.533	337.072.596	18. Feb. 22	State Street Bank	46.493
US-Dollar	Schweizer Franken	39.673	36.140	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	43
Dänische Krone	US-Dollar	2.052.421	312.511	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	323
Dänische Krone	US-Dollar	856.894	130.112	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	498
						<b>USD 3.191.163</b>
Euro	US-Dollar	2.022.000	2.351.521	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(62.450)
Euro	US-Dollar	191.326	216.791	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(195)
Euro	US-Dollar	178.251	206.510	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(4.715)
Euro	US-Dollar	323.068	375.839	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(10.099)
Euro	US-Dollar	180.764	210.897	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(6.258)
Russischer Rubel	US-Dollar	148.988.834	2.065.397	14. Jan. 22	State Street Bank	(82.682)
Russischer Rubel	US-Dollar	74.594.076	1.034.226	14. Jan. 22	State Street Bank	(41.542)
Pfund Sterling	US-Dollar	439.098	599.569	14. Jan. 22	State Street Bank	(7.855)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	2.087.257	13.448.196	14. Jan. 22	State Street Bank	(23.180)
US-Dollar	Euro	1.497.651	1.325.389	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(2.799)
US-Dollar	Euro	400.017	355.186	14. Jan. 22	State Street Bank	(2.082)
US-Dollar	Euro	939.826	832.367	14. Jan. 22	State Street Bank	(2.482)
US-Dollar	Indische Rupie	3.636.946	275.578.667	14. Jan. 22	State Street Bank	(66.011)
US-Dollar	Pfund Sterling	117.713	88.319	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(1.303)
US-Dollar	Pfund Sterling	103.385	77.062	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(461)
US-Dollar	Pfund Sterling	73.998	55.360	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(603)
US-Dollar	Pfund Sterling	346.352	259.489	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(3.327)
US-Dollar	Pfund Sterling	76.611	57.549	14. Jan. 22	HSBC Bank plc	(940)
US-Dollar	Pfund Sterling	84.405	63.258	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(840)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

### Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrech- nungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.</b>						
Hongkong-Dollar	US-Dollar	231.578	29.713	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(15)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	426.117	54.656	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(10)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	893.017	114.523	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(1)
Schweizer Franken	US-Dollar	281.916	309.774	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(639)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.209.538	1.109.239	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(6.799)
US-Dollar	Schweizer Franken	985.515	908.803	18. Feb. 22	State Street Bank	(11.034)
US-Dollar	Schweizer Franken	13.543.986	12.356.178	18. Feb. 22	State Street Bank	(5.189)
US-Dollar	Dänische Krone	4.196.623	27.637.429	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	(15.937)
US-Dollar	Dänische Krone	861.974	5.672.554	16. Mrz. 22	Royal Bank of Scotland	(2.650)
<b>USD</b>						<b>(362.098)</b>

# BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Supranational - 73.536.026</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 37.621.950)</b>			
73.536.026	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	73.536.026	9,28
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>73.536.026</b>	<b>9,28</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 17.487.860</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.909.954)</b>			
13.554.000	Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026	9.795.180	1,24
7.420.000	Perenti Finance Pty Ltd 'REGS' 6.500% 07-Oct-2025	7.692.680	0,97
<b>Belgien - 7.207.194</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
6.000.000	House of HR 'REGS' 7.500% 15-Jan-2027	7.207.194	0,91
<b>Brasilien - 17.710.970</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.112.282)</b>			
11.354.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	12.460.845	1,57
5.000.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026	5.250.125	0,67
<b>Chile - 9.372.825</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
9.000.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024	9.372.825	1,18
<b>Dänemark - 16.363.104</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.939.810)</b>			
7.000.000	DKT Finance ApS '144A' 9.375% 17-Jun-2023	7.107.737	0,89
8.000.000	DKT Finance ApS 'REGS' 7.000% 17-Jun-2023	9.255.367	1,17
<b>Ägypten - 1.695.121</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
1.700.000	Energiean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	1.695.121	0,21
<b>Finnland - 8.168.377</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
7.000.000	PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026	8.168.377	1,03
<b>Frankreich - 48.614.912</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 63.220.246)</b>			
5.000.000	Altice France SA/France 'REGS' 2.125% 15-Feb-2025	5.552.026	0,70
5.000.000	Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027	5.969.900	0,75
3.200.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	3.798.152	0,48
8.000.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.561% 25-Jan-2023	9.182.381	1,16
6.000.000	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	7.040.253	0,89
2.000.000	Lion/Polaris Lux 4 SA 'REGS' FRN 4.000% 01-Jul-2026	2.298.487	0,29
8.000.000	Parts Europe SA 'REGS' 6.500% 16-Jul-2025	9.452.344	1,19
4.600.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	5.321.369	0,67
<b>Deutschland - 57.210.930</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 47.756.921)</b>			
8.000.000	CeramTec BondCo GmbH 'REGS' 5.250% 15-Dec-2025	9.248.423	1,17
12.100.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	13.717.837	1,73
1.000.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 7.250% 30-Sep-2025	1.160.895	0,15
12.550.000	Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025	14.869.056	1,87
7.473.182	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS' 6.000% 30-Jul-2026	8.776.668	1,11
8.000.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	9.438.051	1,19
<b>Ghana - 2.456.685</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
3.000.000	Tullow Oil Plc '144A' 7.000% 01-Mar-2025	2.456.685	0,31

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Griechenland - 6.976.005</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
6.000.000	Crystal Almond SARL 'REGS' 4.250% 15-Oct-2024	6.976.005	0,88
<b>Israel - 6.045.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.560.000)</b>			
6.000.000	Energiean Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024	6.045.000	0,76
<b>Italien - 22.662.909</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.335.384)</b>			
10.925.000	Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4.125% 31-Aug-2026	12.470.773	1,57
9.250.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 4.750% 30-Sep-2024	10.192.136	1,29
<b>Luxemburg - 57.493.354</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 76.733.286)</b>			
10.000.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	11.156.057	1,41
14.000.000	Altice France Holding SA '144A' 8.000% 15-May-2027	16.888.006	2,13
3.000.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	4.224.033	0,53
5.000.000	Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026	5.241.167	0,66
6.382.000	Monitechm HoldCo 2 SA 'REGS' 9.500% 15-Sep-2026	7.829.021	0,99
2.000.000	Monitechm HoldCo 3 SA 'REGS' FRN 5.250% 15-Mar-2025	2.286.110	0,29
8.019.368	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	9.868.960	1,24
<b>Mexiko - 9.084.510</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.390.000)</b>			
8.794.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024	9.084.510	1,15
<b>Niederlande - 73.377.816</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 53.925.890)</b>			
2.052.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024	2.356.373	0,30
7.350.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 3.875% 01-Apr-2024	8.383.303	1,06
10.346.000	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023	11.786.292	1,48
1.000.000	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' FRN 6.250% 15-Aug-2023	1.133.662	0,14
4.195.000	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	4.898.994	0,62
6.879.644	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	8.017.101	1,01
8.400.000	Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026	9.832.379	1,24
10.605.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	12.265.425	1,55
2.000.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' FRN 3.750% 15-Aug-2026	2.276.982	0,29
7.000.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	7.272.230	0,92
5.000.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	5.155.075	0,65
<b>Nigeria - 5.307.550</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.315.000)</b>			
5.000.000	IHS Netherlands Holdco BV '144A' 8.000% 18-Sep-2027	5.307.550	0,67
<b>Norwegen - 10.402.719</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.005.160)</b>			
6.000.000	DNO ASA '144A' 7.875% 09-Sep-2026	6.180.000	0,78
4.075.000	DNO ASA '144A' 8.375% 29-May-2024	4.222.719	0,53
<b>Spanien - 8.041.306</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
7.000.000	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	8.041.306	1,02
<b>Schweden - 14.584.806</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.431.232)</b>			
5.760.000	Unilabs Subholding AB 'REGS' 5.750% 15-May-2025	6.660.563	0,84
2.850.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.500% 15-May-2023	3.273.733	0,41

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Schweden Forts.</b>			
4.000.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	4.650.510	0,59
<b>Tansania - 9.879.975</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
9.450.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	9.879.975	1,25
<b>Vereinigtes Königreich - 115.263.612</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 82.555.364)</b>			
4.050.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	5.489.939	0,69
2.500.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	2.631.500	0,33
1.250.000	CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027	1.700.035	0,22
6.475.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	9.121.341	1,15
3.000.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	4.076.956	0,52
6.000.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	8.097.226	1,02
6.677.104	EnQuest Plc '144A' 'EMTN' 7.000% 15-Oct-2023	6.212.511	0,79
2.203.390	EnQuest Plc 'EMTN' 7.000% 15-Oct-2023	2.857.975	0,36
4.015.000	esure Group Plc 6.750% 19-Dec-2024	6.126.781	0,77
1.000.000	Greene King Finance Plc FRN 1.898% 15-Dec-2034	1.111.604	0,14
5.050.000	Harbour Energy Plc 'REGS' 5.500% 15-Oct-2026	5.017.327	0,63
9.595.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	11.025.709	1,39
20.000.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026	20.520.798	2,59
3.250.000	Marston's Issuer Plc FRN 2.684% 16-Jul-2035	3.409.428	0,43
6.000.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025	6.999.959	0,88
4.000.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 6.375% 15-Feb-2025	5.492.926	0,69
4.100.000	Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026	5.567.733	0,70
2.685.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' FRN 5.750% 31-Jul-2025	3.023.995	0,38
5.000.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	6.779.869	0,86
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 140.595.550</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 160.059.990)</b>			
5.300.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	5.477.736	0,69
6.000.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	6.044.250	0,76
5.000.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	5.220.825	0,66
10.264.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	10.893.029	1,37
5.000.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	5.180.000	0,65
7.000.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	7.295.750	0,92
10.000.000	Cogent Communications Group Inc 'REGS' 4.375% 30-Jun-2024	11.581.600	1,46
5.000.000	Fresh Market Inc/The '144A' 9.750% 01-May-2023	5.149.750	0,65
4.000.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	4.154.000	0,52
8.000.000	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025	8.290.920	1,05
8.000.000	LABEL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	8.398.000	1,06
9.000.000	MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	9.427.140	1,19
5.000.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2023	5.242.575	0,66
7.000.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 4.375% 01-Nov-2026	8.133.160	1,03
1.000.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' FRN 4.375% 01-Nov-2026	1.153.558	0,15
7.000.000	SRM Escrow Issuer LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	7.491.295	0,95
2.571.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	2.635.275	0,33
9.000.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	9.571.500	1,21
11.000.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	11.213.125	1,42
7.500.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	8.042.062	1,01
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>666.003.090</b>	<b>84,03</b>

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)</b>			
<b>Niederlande - 5.713.852</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.752.462)</b>			
5.000.000	Kraton Polymers Holdings B.V. Term Loan 0.000% 18-Nov-2028	5.713.852	0,72
<b>Norwegen - 8.929.100</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.824.673)</b>			
8.571.429	INEOS Rafnes AS 2.100% 08-Nov-2024	8.929.100	1,13
<b>Vereinigtes Königreich - 19.924.007</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.707.392)</b>			
3.500.000	Constellation Automotive Group Limited Term Loan 7.551% 15-Jul-2029	4.809.958	0,61
4.005.668	INEOS Enterprises Holdings II Ltd 2.750% 03-Sep-2024	4.537.655	0,57
5.000.000	Parkdean Resorts Richmond UK Holdco Limited Term Loan 4.333% 03-Mar-2024	6.702.885	0,84
2.887.000	Zephyr Bidco Limited Term Loan 4.813% 06-Jun-2025	3.873.509	0,49
<b>Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)</b>		<b>34.566.959</b>	<b>4,36</b>
<b>Credit Default Swaps - 116.058</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.126)</b>			
(3.000.000)	CDS Casino Guichard-Perrachon 5.000% 20-Dec-2022	85.214	0,01
(1.800.000)	CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2022	30.844	0,00
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>		<b>116.058</b>	<b>0,01</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 11.959.722 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 5.863.263)		11.959.722	1,51
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>786.181.855</b>	<b>99,19</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.769.339) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.621.219))		(1.769.339)	(0,22)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(1.769.339)</b>	<b>(0,22)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>8.160.856</b>	<b>1,03</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>792.573.372</b>	<b>100,00</b>
Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Goldman Sachs und Morgan Stanley.			
<b>Portfolioanalyse</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		91,62	
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		4,28	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,50	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,60	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>						
Euro	US-Dollar	10.373.000	11.733.388	11. Jan. 22	UBS AG	77.993
Euro	US-Dollar	2.679.000	3.022.251	11. Jan. 22	Morgan Stanley	28.234
US-Dollar	Euro	61.238.748	52.584.000	11. Jan. 22	Morgan Stanley	1.363.143
US-Dollar	Euro	61.243.270	52.584.000	11. Jan. 22	Barclays Bank PLC	1.367.665
US-Dollar	Australischer Dollar	1.492.720	2.048.000	19. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	2.625
Pfund Sterling	US-Dollar	214.000	282.716	25. Jan. 22	HSBC Bank plc	6.929
US-Dollar	Pfund Sterling	68.343.329	50.438.000	25. Jan. 22	Barclays Bank PLC	76.455
US-Dollar	Pfund Sterling	4.084.011	2.997.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	27.628
Euro	US-Dollar	16.906.000	19.108.412	1. Feb. 22	UBS AG	150.238
Euro	US-Dollar	1.560.000	1.769.689	1. Feb. 22	HSBC Bank plc	7.401
US-Dollar	Euro	114.354.601	98.977.000	1. Feb. 22	Toronto Dominion Bank	1.603.898
Euro	US-Dollar	1.333.000	1.506.513	18. Feb. 22	Morgan Stanley	12.477
Euro	US-Dollar	641.000	726.215	18. Feb. 22	UBS AG	4.223

**USD 4.728.909**

Euro	US-Dollar	8.402.000	9.751.916	11. Jan. 22	Morgan Stanley	(184.845)
Euro	US-Dollar	371.000	431.239	11. Jan. 22	Bank of America Merrill Lynch	(8.794)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.629.480	1.968.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(34.170)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.573.261	4.132.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(19.222)
US-Dollar	Australischer Dollar	8.259.005	11.550.000	7. Feb. 22	Morgan Stanley	(145.063)
US-Dollar	Euro	2.572.478	2.280.000	8. Feb. 22	Bank of America Merrill Lynch	(20.159)
US-Dollar	Euro	7.584.676	6.689.000	8. Feb. 22	Morgan Stanley	(36.198)
US-Dollar	Euro	35.719.147	31.356.000	8. Feb. 22	Morgan Stanley	(5.194)
US-Dollar	Euro	2.713.754	2.395.000	8. Feb. 22	Morgan Stanley	(14.904)
US-Dollar	Euro	1.996.193	1.769.000	8. Feb. 22	UBS AG	(19.254)
US-Dollar	Euro	1.544.556	1.363.000	8. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(8.330)
US-Dollar	Euro	5.698.581	5.034.000	8. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(36.727)
US-Dollar	Euro	2.377.248	2.102.000	8. Feb. 22	Morgan Stanley	(17.591)
US-Dollar	Euro	2.135.264	1.888.000	8. Feb. 22	Morgan Stanley	(15.762)
US-Dollar	Euro	4.449.756	3.916.000	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	(12.634)
US-Dollar	Euro	103.655.625	91.614.000	18. Feb. 22	Toronto Dominion Bank	(741.051)

**USD (1.319.898)**

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	9.073	9.879	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	81
Schweizer Franken	US-Dollar	25.685	27.900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	296
Schweizer Franken	US-Dollar	7.882	8.535	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	117
Schweizer Franken	US-Dollar	73.383	79.925	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	631
Schweizer Franken	US-Dollar	18.234	19.745	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	272
Schweizer Franken	US-Dollar	3.387	3.685	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33
Schweizer Franken	US-Dollar	902.133	976.712	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13.598

**USD 15.028**

**CHF 13.694**

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	463.833	525.020	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.054
Euro	US-Dollar	17.014	19.261	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	110
Euro	US-Dollar	155.067	175.864	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	717
Euro	US-Dollar	35.000	39.702	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	154
Euro	US-Dollar	739.106	834.482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.165
Euro	US-Dollar	640.487	722.833	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.512
Euro	US-Dollar	56.845	63.927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	804
Euro	US-Dollar	87.650	99.432	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	378
Euro	US-Dollar	211.099	238.555	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.830
Euro	US-Dollar	108.291	122.017	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.298

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	15.979	18.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	144
Euro	US-Dollar	69.300	78.525	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	390
Euro	US-Dollar	160.092	181.254	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.049
Euro	US-Dollar	26.470	30.016	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	126
Euro	US-Dollar	85.906.251	97.219.018	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	605.568
Euro	US-Dollar	70.437	79.756	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	453

**USD 629.752**

**EUR 553.141**

US-Dollar	Euro	181.211	160.092	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.054)
US-Dollar	Euro	79.739	70.437	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(455)
US-Dollar	Euro	22.134	19.516	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(90)
US-Dollar	Euro	433.630	382.272	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.678)
US-Dollar	Euro	74.324	65.829	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(638)
US-Dollar	Euro	100.128	89.035	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.259)
US-Dollar	Euro	22.160	19.534	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(84)
US-Dollar	Euro	221.499	196.005	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.699)
US-Dollar	Euro	2.254	2.001	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Euro	82.755	73.034	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(411)
US-Dollar	Euro	11.313	10.006	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Euro	219.778	193.445	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(505)
US-Dollar	Euro	19.265	17.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(109)
US-Dollar	Euro	525.145	463.833	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.038)
US-Dollar	Euro	731.640	645.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.076)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	8	9	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	95	108	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	1.812.743	2.051.458	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12.778
Euro	US-Dollar	238	270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	250.000	283.492	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.192
US-Dollar	Euro	9	8	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	145	127	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-

**USD 13.973**

**EUR 12.273**

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	4.903	5.514	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	69
------	-----------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	2.101	2.383	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	10.301.860	11.658.485	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	72.620
					<b>USD</b>	<b>72.698</b>
					<b>EUR</b>	<b>63.854</b>
US-Dollar	Euro	16.977	15.036	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(146)
					<b>USD</b>	<b>(146)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(128)</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	2.688.470	3.042.508	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18.951
					<b>USD</b>	<b>18.951</b>
					<b>EUR</b>	<b>16.646</b>
US-Dollar	Euro	33.076	29.159	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(128)
					<b>USD</b>	<b>(128)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(112)</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	43.139	48.829	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	284
Euro	US-Dollar	6.613	7.487	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	43
Euro	US-Dollar	46.848	53.131	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	217
Euro	US-Dollar	1.316.457	1.490.474	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8.623
Euro	US-Dollar	21.408	24.241	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	138
Euro	US-Dollar	104.265.714	117.996.190	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	734.987
Euro	US-Dollar	35.217	40.010	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	92
Euro	US-Dollar	18.995	21.523	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	107
Euro	US-Dollar	50.761	57.346	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	457
Euro	US-Dollar	67.769	76.583	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	588
Euro	US-Dollar	33.353	37.836	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	144
Euro	US-Dollar	24.015	27.007	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	340
Euro	US-Dollar	24.276	27.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	247
Euro	US-Dollar	135.250	152.702	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.311
Euro	US-Dollar	25.369	28.777	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Euro	US-Dollar	1.537.915	1.732.850	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18.430
Euro	US-Dollar	7.984	9.054	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	38
					<b>USD</b>	<b>766.157</b>
					<b>EUR</b>	<b>672.952</b>
US-Dollar	Euro	1.490.119	1.316.457	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8.668)
US-Dollar	Euro	24.235	21.408	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(138)
US-Dollar	Euro	7.488	6.613	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(43)
US-Dollar	Euro	24.050	21.169	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(55)
US-Dollar	Euro	22.639	20.022	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(161)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	26.286	23.198	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(131)
US-Dollar	Euro	248.367	219.847	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.981)
US-Dollar	Euro	6.381	5.663	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(68)
US-Dollar	Euro	12.861	11.380	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)
US-Dollar	Euro	61.572	54.276	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(234)
US-Dollar	Euro	18.179	16.108	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(164)
US-Dollar	Euro	219.886	194.754	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.888)
US-Dollar	Euro	36.531	32.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(141)
US-Dollar	Euro	132.915	117.198	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(542)
US-Dollar	Euro	48.841	43.139	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(283)
US-Dollar	Euro	83.507	74.255	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.050)
US-Dollar	Euro	221.426	195.267	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(931)
					<b>USD</b>	<b>(16.577)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(14.560)</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)</b>						
Euro	US-Dollar	795.982	900.803	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.611
					<b>USD</b>	<b>5.611</b>
					<b>EUR</b>	<b>4.928</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	11.435	15.337	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	141
Pfund Sterling	US-Dollar	3.255	4.392	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13
Pfund Sterling	US-Dollar	50.534	67.821	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	577
Pfund Sterling	US-Dollar	25.193	34.002	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	98
Pfund Sterling	US-Dollar	43.749.236	57.795.851	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.419.509
Pfund Sterling	US-Dollar	22.987	30.421	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	692
Pfund Sterling	US-Dollar	22.658	29.970	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	698
Pfund Sterling	US-Dollar	28.639	38.023	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	740
Pfund Sterling	US-Dollar	30.456	40.256	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	967
Pfund Sterling	US-Dollar	17.004	22.493	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	522
Pfund Sterling	US-Dollar	29.268	38.832	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	783
Pfund Sterling	US-Dollar	22.723	30.289	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	468
Pfund Sterling	US-Dollar	85.614	113.337	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.543
Pfund Sterling	US-Dollar	39.201	51.776	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.283
Pfund Sterling	US-Dollar	31.144	41.333	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	820
Pfund Sterling	US-Dollar	23.933	31.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	408
Pfund Sterling	US-Dollar	17.225	23.104	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	211
Pfund Sterling	US-Dollar	62.121	83.383	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	698
					<b>USD</b>	<b>1.431.171</b>
					<b>GBP</b>	<b>1.057.346</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	23.103	17.225	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(213)
US-Dollar	Pfund Sterling	34.001	25.193	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)
US-Dollar	Pfund Sterling	174.002	129.650	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.482)



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	15.337	11.435	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(140)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.393	3.255	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.167	6.926	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(208)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.469	6.408	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(204)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.535	10.233	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(315)
US-Dollar	Pfund Sterling	14.653	11.037	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(285)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.250	13.807	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(439)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.490.924	1.123.716	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30.046)
US-Dollar	Pfund Sterling	388.589	291.527	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.999)
US-Dollar	Pfund Sterling	114.798	86.718	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.576)
US-Dollar	Pfund Sterling	21.041	15.931	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(521)
US-Dollar	Pfund Sterling	24.875	18.742	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(494)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.883	17.122	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(292)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.723.439	4.326.672	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(132.789)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.500	13.037	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(147)
<b>USD</b>						<b>(176.262)</b>
<b>GBP</b>						<b>(130.222)</b>

**BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	981	1.316	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11
Pfund Sterling	US-Dollar	17.894	23.915	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	305
Pfund Sterling	US-Dollar	2.501	3.319	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	66
Pfund Sterling	US-Dollar	54.907	72.521	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.797
Pfund Sterling	US-Dollar	313	415	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Pfund Sterling	US-Dollar	5.372	7.161	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Pfund Sterling	US-Dollar	1.006	1.331	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	31
Pfund Sterling	US-Dollar	5.870	7.758	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	186
Pfund Sterling	US-Dollar	4.127	5.479	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	107
Pfund Sterling	US-Dollar	2.972	3.932	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	92
Pfund Sterling	US-Dollar	1.110	1.469	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	33
Pfund Sterling	US-Dollar	3.648.550	4.817.352	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	118.318
Pfund Sterling	US-Dollar	2.743	3.702	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11
Pfund Sterling	US-Dollar	27.530	36.952	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	309
<b>USD</b>						<b>121.386</b>
<b>GBP</b>						<b>89.680</b>

US-Dollar	Pfund Sterling	3.702	2.743	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.785	8.035	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(90)
US-Dollar	Pfund Sterling	469	354	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.866	3.684	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(121)
US-Dollar	Pfund Sterling	551	416	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Pfund Sterling	47.581	35.696	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(735)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	28.804	21.775	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(668)
<b>USD</b>						<b>(1.646)</b>
<b>GBP</b>						<b>(1.216)</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	25.096.283	33.153.974	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	814.286
<b>USD</b>						<b>814.286</b>
<b>GBP</b>						<b>601.593</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	8.858.476	11.702.676	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	287.426
<b>USD</b>						<b>287.426</b>
<b>GBP</b>						<b>212.350</b>

**BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	4.051	5.468	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16
Pfund Sterling	US-Dollar	11.324	15.029	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	298
Pfund Sterling	US-Dollar	15.743	20.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	421
Pfund Sterling	US-Dollar	4.355	5.761	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	134
Pfund Sterling	US-Dollar	6.408	8.470	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	203
Pfund Sterling	US-Dollar	2.807.272	3.708.606	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	91.086
<b>USD</b>						<b>92.158</b>
<b>GBP</b>						<b>68.086</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	5.468	4.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.618	6.420	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(72)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.356	4.791	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(128)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.534	17.035	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(523)
US-Dollar	Pfund Sterling	215	162	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
<b>USD</b>						<b>(743)</b>
<b>GBP</b>						<b>(549)</b>

**BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	22.825	30.613	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	282
Pfund Sterling	US-Dollar	25.402	34.282	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	100
Pfund Sterling	US-Dollar	49.936	67.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	571
Pfund Sterling	US-Dollar	23.172	31.080	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	284
Pfund Sterling	US-Dollar	9.478	12.792	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	37
Pfund Sterling	US-Dollar	90.617.487	119.712.144	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.940.218
Pfund Sterling	US-Dollar	111.217	147.188	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.347
Pfund Sterling	US-Dollar	63.660	84.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.960
Pfund Sterling	US-Dollar	58.691	77.923	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.517
Pfund Sterling	US-Dollar	37.787	49.946	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.200

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

## Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	32.730	43.426	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	875
Pfund Sterling	US-Dollar	78.108	104.113	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.607
Pfund Sterling	US-Dollar	36.939	48.900	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.097
Pfund Sterling	US-Dollar	57.078	75.388	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.868
Pfund Sterling	US-Dollar	72.135	95.736	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.900
Pfund Sterling	US-Dollar	43.900	58.671	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	748
Pfund Sterling	US-Dollar	139.381	184.377	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.278
Pfund Sterling	US-Dollar	29.065	39.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	327
<b>USD</b>						<b>2.962.216</b>
<b>GBP</b>						<b>2.188.479</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	31.079	23.172	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(286)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.792	9.478	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(37)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.475	45.550	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.177)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.219.367	922.540	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(29.307)
US-Dollar	Pfund Sterling	7.376.409	5.576.246	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(171.139)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.061.924	800.377	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21.400)
US-Dollar	Pfund Sterling	83.648	62.754	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.291)
US-Dollar	Pfund Sterling	178.211	134.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.999)
US-Dollar	Pfund Sterling	165.660	125.425	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.105)
US-Dollar	Pfund Sterling	95.340	71.837	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.892)
US-Dollar	Pfund Sterling	103.905	77.746	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.325)
US-Dollar	Pfund Sterling	121.522	90.547	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.035)
US-Dollar	Pfund Sterling	34.283	25.402	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)
US-Dollar	Pfund Sterling	85.608	63.779	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(717)
US-Dollar	Pfund Sterling	30.615	22.825	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(280)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.143	16.740	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(516)
US-Dollar	Pfund Sterling	49.286	37.241	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.121)
<b>USD</b>						<b>(239.726)</b>
<b>GBP</b>						<b>(177.109)</b>

# BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
<b>Norwegen - 203.942</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 230.907)</b>			
176.652	Aquila European Renewables Income Fund Plc/ The Fund	203.942	0,63
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
		<b>203.942</b>	<b>0,63</b>
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 535.292</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 619.570)</b>			
280.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	227.080	0,70
380.000	Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029	308.212	0,94
<b>Österreich - 339.714</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 539.886)</b>			
190.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 3.150% 20-Jun-2044	339.714	1,04
<b>Kaiman-Inseln - 185.294</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 207.958)</b>			
200.000	Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030	185.294	0,57
<b>Kolumbien - 148.726</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 205.357)</b>			
608.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.500% 26-Aug-2026	148.726	0,46
<b>Deutschland - 241.446</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 260.659)</b>			
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	117.741	0,36
100.000	Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028	123.705	0,38
<b>Japan - 103.912</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 111.651)</b>			
11.555.838	Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	103.912	0,32
<b>Mexiko - 298.010</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 360.299)</b>			
3.790.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	184.042	0,57
2.200.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	113.968	0,35
<b>Neuseeland - 305.970</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 339.817)</b>			
320.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	305.970	0,94
<b>Spanien - 197.344</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 226.204)</b>			
130.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	197.344	0,61
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 3.079.027</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.819.641)</b>			
100.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	124.135	0,38
20.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	21.874	0,07
149.000	T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	152.123	0,47
47.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	51.429	0,16
404.564	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	431.553	1,32
487.756	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15-Apr-2032	725.334	2,23
100.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	101.156	0,31
280.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	281.422	0,86
625.900	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	644.799	1,98
332.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	354.047	1,09

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
165.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	191.155	0,59
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>			
		<b>5.434.735</b>	<b>16,70</b>
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 177.681</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 208.783)</b>			
57.328	Insurance Australia Group Ltd	177.681	0,55
<b>Kaiman-Inseln - 252.991</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 375.653)</b>			
16.600	Alibaba Group Holding Ltd	252.991	0,78
<b>China - 169.281</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 394.018)</b>			
23.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	169.281	0,52
<b>Dänemark - 199.331</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
2.429	Novozymes A/S	199.331	0,61
<b>Frankreich - 756.311</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 771.966)</b>			
6.586	Bureau Veritas SA	217.257	0,66
3.638	Legrand SA	422.576	1,30
8.646	Vivendi SE	116.478	0,36
<b>Deutschland - 678.022</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 845.494)</b>			
2.138	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	138.587	0,42
3.833	SAP SE	539.435	1,66
<b>Hongkong - 502.097</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 611.536)</b>			
49.800	AIA Group Ltd	502.097	1,54
<b>Indien - 277.455</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
4.288	HDFC Bank Ltd ADR	277.455	0,85
<b>Irland - 421.255</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 181.475)</b>			
126.106	Greencoat Renewables Plc	159.147	0,49
4.773	Smurfit Kappa Group Plc	262.108	0,81
<b>Japan - 1.909.502</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.053.902)</b>			
3.900	M3 Inc	196.406	0,60
6.300	Recruit Holdings Co Ltd	382.011	1,18
6.100	Sony Group Corp	767.666	2,36
9.800	Suzuki Motor Corp	377.460	1,16
12.900	Topcon Corp	185.959	0,57
<b>Niederlande - 319.324</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
11.368	Universal Music Group NV	319.324	0,98
<b>Neuseeland - 142.631</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 157.202)</b>			
67.133	SKYCITY Entertainment Group Ltd	142.631	0,44
<b>Republik Korea - 431.210</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.037.043)</b>			
782	Samsung SDI Co Ltd	431.210	1,33
<b>Schweiz - 1.081.752</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.190.104)</b>			
3.521	Alcon Inc	311.414	0,96
1.239	Roche Holding AG	514.565	1,58
583	Zurich Insurance Group AG	255.773	0,78

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Taiwan - 172.930</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 156.373)</b>		<b>172.930</b>	<b>0,53</b>
1.436	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	172.930	0,53
<b>Thailand - 121.785</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 108.008)</b>		<b>121.785</b>	<b>0,37</b>
28.700	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	121.785	0,37
<b>Vereinigtes Königreich - 3.971.896</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.961.874)</b>		<b>3.971.896</b>	<b>12,20</b>
7.500	Associated British Foods Plc	202.342	0,62
2.908	AstraZeneca Plc	337.705	1,04
59.772	Barclays Plc	150.658	0,46
5.346	CRH Plc	282.083	0,87
2.712	Ferguson Plc	478.491	1,47
12.386	GlaxoSmithKline Plc	267.763	0,82
103.266	Hays Plc	204.776	0,63
28.107	Informa Plc	194.385	0,60
1.332	Linde Plc	458.694	1,41
12.419	National Grid Plc	178.337	0,55
25.479	Prudential Plc	435.889	1,34
8.608	RELX Plc	277.534	0,85
10.633	Travis Perkins Plc	225.396	0,69
2.337	Unilever Plc	123.777	0,38
107.147	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	154.066	0,47
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 9.580.897</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.080.502)</b>		<b>9.580.897</b>	<b>29,43</b>
4.544	Abbott Laboratories	640.727	1,97
1.559	Accenture Plc - Class A	645.356	1,98
1.465	Albemarle Corp	343.520	1,05
324	Alphabet Inc - Class A	947.441	2,91
126	Amazon.com Inc	425.108	1,31
5.757	Apple Inc	1.026.070	3,15
3.953	Applied Materials Inc	624.455	1,92
7.625	Citigroup Inc	460.741	1,42
2.382	CME Group Inc	544.561	1,67
1.834	Ecolab Inc	429.238	1,32
868	Goldman Sachs Group Inc/The	334.605	1,03
31.050	Laureate Education Inc - Class A	375.705	1,15
1.634	Mastercard Inc	590.103	1,81
3.179	Medtronic Plc	332.189	1,02
3.182	Microsoft Corp	1.079.796	3,32
4.321	Otis Worldwide Corp	373.270	1,15
935	Texas Instruments Inc	177.080	0,54
3.217	Toll Brothers Inc	230.932	0,71
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>21.166.351</b>	<b>65,02</b>
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Guernsey - 166.788</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 146.003)</b>		<b>166.788</b>	<b>0,51</b>
92.294	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	166.788	0,51
<b>Vereinigtes Königreich - 1.241.232</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.056.564)</b>		<b>1.241.232</b>	<b>3,81</b>
219.434	Greencoat UK Wind Plc/Funds	415.767	1,28
488.862	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	825.465	2,53
<b>Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>		<b>1.408.020</b>	<b>4,32</b>
<b>Börsengehandelte Rohstoffe</b>			
<b>Irland - 1.499.596</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.563.620)</b>		<b>1.499.596</b>	<b>4,61</b>
42.260	iShares Physical Gold ETC	1.499.596	4,61
<b>Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe</b>		<b>1.499.596</b>	<b>4,61</b>

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 45.467 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 129.353)			
		45.467	0,14
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>29.758.111</b>	<b>91,42</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (136.007) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (128.731))			
		(136.007)	(0,42)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(136.007)</b>	<b>(0,42)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>2.928.997</b>	<b>9,00</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>32.551.101</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	90,89
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,14
Sonstiges Umlaufvermögen	8,97
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>							
US-Dollar	Pfund Sterling	1.038.118	761.000	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	10.618	
US-Dollar	Euro	530.310	456.811	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	12.803	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	292.092	409.232	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	12.707	
US-Dollar	Japanischer Yen	211.055	23.970.889	16. Mrz. 22	The Bank of New York Mellon	2.705	
					<b>USD</b>	<b>38.833</b>	
US-Dollar	Australischer Dollar	498.928	703.304	16. Mrz. 22	State Street Bank	(11.065)	
					<b>USD</b>	<b>(11.065)</b>	
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)</b>							
Kanadischer Dollar	US-Dollar	406.796	317.615	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.762	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	276.276	215.117	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.789	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	364.822	285.687	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	736	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	417.968	326.271	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.877	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	190.931	242.594	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	470	
					<b>USD</b>	<b>6.634</b>	
					<b>CAD</b>	<b>8.450</b>	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	41.208.879	32.468.305	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(115.094)	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	431.303	558.204	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6.944)	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	280.625	361.135	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.904)	
					<b>USD</b>	<b>(124.942)</b>	
					<b>CAD</b>	<b>(159.139)</b>	

# BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Kommunikationsdienstleistungen - 2.614.136.450</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.904.433.200)</b>			
222.600	Atrae Inc	541.697.100	2,57
347.200	Direct Marketing MiX Inc	579.303.200	2,74
251.300	Fibergate Inc/Japan	320.030.550	1,52
520.800	Vector Inc	613.762.800	2,91
482.400	Vision Inc/Tokyo Japan	559.342.800	2,65
<b>Nicht-Basiskonsumgüter - 2.379.315.850</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.070.457.500)</b>			
33.000	Arata Corp	145.447.500	0,69
234.400	Nifco Inc/Japan	846.184.000	4,01
397.100	Resorttrust Inc	745.952.350	3,53
728.000	Yonex Co Ltd	641.732.000	3,04
<b>Basiskonsumgüter - 771.730.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 486.668.000)</b>			
134.800	Ain Holdings Inc	771.730.000	3,66
<b>Finanzwerte - 2.239.146.500</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.501.076.650)</b>			
917.100	Anicom Holdings Inc	761.193.000	3,61
230.600	Premium Group Co Ltd	872.244.500	4,13
120.900	Zenkoku Hoshu Co Ltd	605.709.000	2,87
<b>Gesundheitswesen - 532.681.200</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 407.575.650)</b>			
284.400	Japan Medical Dynamic Marketing Inc	532.681.200	2,52
<b>Industrie - 3.042.274.100</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.292.191.500)</b>			
327.800	Aida Engineering Ltd	351.073.800	1,66
212.900	Insource Co Ltd	600.803.800	2,85
230.800	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	630.314.800	2,99
252.000	Totetsu Kogyo Co Ltd	632.268.000	3,00
466.900	TRE Holdings Corp	827.813.700	3,92
<b>Informationstechnologie - 6.697.386.850</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.601.586.300)</b>			
314.900	Anritsu Corp	559.577.300	2,65
204.600	BrainPad Inc	312.321.900	1,48
771.800	MCJ Co Ltd	837.017.100	3,97
859.200	m-up Holdings Inc	886.694.400	4,20
357.600	Optorun Co Ltd	849.657.600	4,03
149.600	RS Technologies Co Ltd	1.018.028.000	4,82
108.200	Sanken Electric Co Ltd	683.824.000	3,24
441.700	TechMatrix Corp	842.984.450	4,00
771.300	Wacom Co Ltd	707.282.100	3,35
<b>Grundstoffe - 1.532.297.200</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.214.171.300)</b>			
170.000	Dowa Holdings Co Ltd	821.950.000	3,89
713.200	Sakata INX Corp	710.347.200	3,37

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Versorger - 700.434.000</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 526.300.000)</b>			
459.000	Nippon Gas Co Ltd	700.434.000	3,32
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>20.509.402.150</b>	<b>97,19</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 149.024.725 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.683.437)		149.024.725	0,71
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>20.658.426.875</b>	<b>97,90</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (10.069.632) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (41.410.420))		(10.069.632)	(0,05)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(10.069.632)</b>	<b>(0,05)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>454.211.108</b>	<b>2,15</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>21.102.568.351</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,90	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,70	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,40	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	Japanischer Yen	2.183.048	267763.441	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.969.847
Schweizer Franken	Japanischer Yen	18.574	2.314.495	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	23.007
Schweizer Franken	Japanischer Yen	15.004	1.863.715	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	24.551
Schweizer Franken	Japanischer Yen	28.429	3.512.087	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	65.667
Schweizer Franken	Japanischer Yen	19.025	2.348.030	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	46.198
Schweizer Franken	Japanischer Yen	21.058	2.647.594	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.511
<b>JPY</b>						<b>7.131.781</b>
<b>CHF</b>						<b>56.683</b>
Japanischer Yen	Schweizer Franken	6.437.903	52.184	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(129.374)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	5.822.178	47.291	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(129.360)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	2.432.335	19.760	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(54.370)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	3.859.101	31.319	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(82.375)
<b>JPY</b>						<b>(395.479)</b>
<b>CHF</b>						<b>(3.143)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)**

Euro	Japanischer Yen	1.794.642	230.017.254	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.029.336
Euro	Japanischer Yen	15.233	1.973.551	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13.069
Euro	Japanischer Yen	12.281	1.589.089	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12.491
Euro	Japanischer Yen	23.257	2.992.432	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40.597
Euro	Japanischer Yen	15.611	2.008.166	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	27.781
Euro	Japanischer Yen	17.423	2.272.116	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	140
<b>JPY</b>						<b>4.123.414</b>
<b>EUR</b>						<b>31.622</b>
Japanischer Yen	Euro	5.509.232	42.971	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(94.794)
Japanischer Yen	Euro	4.984.825	38.910	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(89.595)
Japanischer Yen	Euro	2.120.943	16.557	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38.381)
Japanischer Yen	Euro	3.297.904	25.701	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(53.877)
<b>JPY</b>						<b>(276.647)</b>
<b>EUR</b>						<b>(2.122)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)**

Euro	Japanischer Yen	1.986	255.212	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.790
Euro	Japanischer Yen	5.108.475	654.747.402	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11.469.564
Euro	Japanischer Yen	29.086	3.765.515	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	27.681
Euro	Japanischer Yen	43.025	5.574.168	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36.911
Euro	Japanischer Yen	34.841	4.508.306	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	35.436
Euro	Japanischer Yen	66.102	8.505.223	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	115.386
Euro	Japanischer Yen	44.191	5.684.532	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	78.643
Euro	Japanischer Yen	1.986	255.376	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.626
Euro	Japanischer Yen	5.986	777.499	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.160

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.</b>						
Euro	Japanischer Yen	48.842	6.369.298	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	393
<b>JPY</b>						<b>11.774.590</b>
<b>EUR</b>						<b>90.299</b>
Japanischer Yen	Euro	777.283	5.986	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.288)
Japanischer Yen	Euro	3.194.697	24.740	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(31.688)
Japanischer Yen	Euro	15.743.061	122.793	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(270.883)
Japanischer Yen	Euro	14.215.657	110.963	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(255.506)
Japanischer Yen	Euro	6.109.490	47.695	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(110.558)
Japanischer Yen	Euro	9.409.210	73.327	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(153.715)
<b>JPY</b>						<b>(825.638)</b>
<b>EUR</b>						<b>(6.332)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)**

Euro	Japanischer Yen	6.004.533	769.594.160	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13.481.397
Euro	Japanischer Yen	50.901	6.594.589	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	43.668
Euro	Japanischer Yen	41.036	5.309.918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	41.736
Euro	Japanischer Yen	77.688	9.996.023	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	135.612
Euro	Japanischer Yen	1.798	230.790	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.722
Euro	Japanischer Yen	52.148	6.708.009	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	92.801
Euro	Japanischer Yen	58.220	7.592.242	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	468
<b>JPY</b>						<b>13.799.404</b>
<b>EUR</b>						<b>105.828</b>
Japanischer Yen	Euro	18.403.202	143.542	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(316.655)
Japanischer Yen	Euro	16.651.465	129.976	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(299.285)
Japanischer Yen	Euro	1.212.295	9.428	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(17.214)
Japanischer Yen	Euro	7.096.259	55.398	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(128.415)
Japanischer Yen	Euro	11.034.162	85.991	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(180.262)
<b>JPY</b>						<b>(941.831)</b>
<b>EUR</b>						<b>(7.223)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	Japanischer Yen	762.665	97.749.950	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.712.338
Euro	Japanischer Yen	6.486	840.282	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.564
Euro	Japanischer Yen	5.224	676.005	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.313
Euro	Japanischer Yen	744	96.070	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	953
Euro	Japanischer Yen	9.889	1.272.418	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	17.282
Euro	Japanischer Yen	6.645	854.757	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11.825
Euro	Japanischer Yen	7.443	970.607	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	60
<b>JPY</b>						<b>1.763.315</b>
<b>EUR</b>						<b>13.446</b>
Japanischer Yen	Euro	2.339.437	18.247	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(40.253)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.**

Japanischer Yen	Euro	2.117.824	16.531	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38.065)
Japanischer Yen	Euro	898.724	7.016	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(16.264)
Japanischer Yen	Euro	1.400.831	10.917	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(22.885)
					<b>JPY</b>	<b>(117.467)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(901)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)**

Norwegische Krone	Japanischer Yen	77.350	974.693	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	35.427
Norwegische Krone	Japanischer Yen	660	8.541	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	73
Norwegische Krone	Japanischer Yen	521	6.697	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	108
Norwegische Krone	Japanischer Yen	991	12.618	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	328
Norwegische Krone	Japanischer Yen	666	8.419	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	285
					<b>JPY</b>	<b>36.221</b>
					<b>NOK</b>	<b>2.773</b>
Japanischer Yen	Norwegische Krone	23.078	1.842	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(981)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	21.214	1.684	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(782)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	9.029	725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(437)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	14.222	1.124	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(459)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	753	9.833	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)
					<b>JPY</b>	<b>(2.665)</b>
					<b>NOK</b>	<b>(204)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)**

Norwegische Krone	Japanischer Yen	79.560	1.002.534	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36.439
Norwegische Krone	Japanischer Yen	681	8.822	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	74
Norwegische Krone	Japanischer Yen	539	6.923	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Norwegische Krone	Japanischer Yen	1.023	13.016	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	338
Norwegische Krone	Japanischer Yen	691	8.727	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	295
					<b>JPY</b>	<b>37.257</b>
					<b>NOK</b>	<b>2.852</b>
Japanischer Yen	Norwegische Krone	23.645	1.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.005)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	21.786	1.730	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(804)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	9.149	735	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(443)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	14.595	1.154	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(471)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	791	10.332	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)
					<b>JPY</b>	<b>(2.730)</b>
					<b>NOK</b>	<b>(209)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)**

Schwedische Krone	Japanischer Yen	80.980	1.012.812	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	17.887
Schwedische Krone	Japanischer Yen	689	8.672	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	97
Schwedische Krone	Japanischer Yen	549	6.906	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	88

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged) Forts.**

Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.047	13.066	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	261
Schwedische Krone	Japanischer Yen	700	8.798	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Schwedische Krone	Japanischer Yen	752	9.555	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	15
					<b>JPY</b>	<b>18.459</b>
					<b>SEK</b>	<b>1.450</b>
Japanischer Yen	Schwedische Krone	24.218	1.951	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(612)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	22.327	1.788	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(432)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	9.338	751	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(221)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	14.542	1.161	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(231)
					<b>JPY</b>	<b>(1.496)</b>
					<b>SEK</b>	<b>(118)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)**

Schwedische Krone	Japanischer Yen	83.130	1.039.697	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18.362
Schwedische Krone	Japanischer Yen	710	8.940	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	100
Schwedische Krone	Japanischer Yen	567	7.128	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	91
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.078	13.448	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	269
Schwedische Krone	Japanischer Yen	724	9.103	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	115
Schwedische Krone	Japanischer Yen	789	10.023	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16
					<b>JPY</b>	<b>18.953</b>
					<b>SEK</b>	<b>1.489</b>
Japanischer Yen	Schwedische Krone	24.765	1.995	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(626)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	22.888	1.833	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(443)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	9.445	760	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(224)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	14.894	1.189	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(236)
					<b>JPY</b>	<b>(1.529)</b>
					<b>SEK</b>	<b>(120)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)**

Singapur-Dollar	Japanischer Yen	463.604	38.509.469	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	937.662
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	3.937	331.332	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.683
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	3.179	266.409	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.106
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	5.986	500.053	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9.270
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	4.100	341.563	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.270
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	4.420	375.781	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	306
					<b>JPY</b>	<b>962.297</b>
					<b>SGD</b>	<b>11.308</b>
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	908.088	10.945	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(23.187)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	831.032	9.990	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18.975)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	361.063	4.357	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9.645)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	215.274	2.587	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.827)



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged) Forts.**

Japanischer Yen	Singapur-Dollar	551.317	6.635	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13.251)
					<b>JPY</b>	<b>(69.885)</b>
					<b>SGD</b>	<b>(821)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)**

US-Dollar	Japanischer Yen	36.981.750	4.195.890.465	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	61.604.913
US-Dollar	Japanischer Yen	318.524	36.438.257	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	231.528
US-Dollar	Japanischer Yen	255.609	29.187.349	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	239.403
US-Dollar	Japanischer Yen	482.870	55.095.515	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	494.504
US-Dollar	Japanischer Yen	330.656	37.568.453	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	498.106
US-Dollar	Japanischer Yen	364.941	41.958.253	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	55.301
					<b>JPY</b>	<b>63.123.755</b>
					<b>USD</b>	<b>548.230</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	98.979.156	872.729	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.493.047)
Japanischer Yen	US-Dollar	90.752.965	799.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.295.633)
Japanischer Yen	US-Dollar	39.052.781	343.878	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(535.924)
Japanischer Yen	US-Dollar	59.561.761	525.737	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(963.269)
					<b>JPY</b>	<b>(4.287.873)</b>
					<b>USD</b>	<b>(37.240)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged)**

US-Dollar	Japanischer Yen	611.947	69.430.553	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.019.394
US-Dollar	Japanischer Yen	5.245	599.975	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.812
US-Dollar	Japanischer Yen	4.205	480.113	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.938
US-Dollar	Japanischer Yen	7.964	908.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8.156
US-Dollar	Japanischer Yen	5.423	616.144	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8.169
US-Dollar	Japanischer Yen	5.895	677.734	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	893
					<b>JPY</b>	<b>1.044.362</b>
					<b>USD</b>	<b>9.070</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	1.645.266	14.507	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(24.818)
Japanischer Yen	US-Dollar	1.504.055	13.251	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21.472)
Japanischer Yen	US-Dollar	657.029	5.785	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9.016)
Japanischer Yen	US-Dollar	988.334	8.724	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15.984)
					<b>JPY</b>	<b>(71.290)</b>
					<b>USD</b>	<b>(619)</b>

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged)**

US-Dollar	Japanischer Yen	26.482.751	3.004.690.715	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	44.115.477
US-Dollar	Japanischer Yen	2.277.46	26.053.505	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	165.544
US-Dollar	Japanischer Yen	182.706	20.862.794	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	171.123
US-Dollar	Japanischer Yen	345.428	39.413.431	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	353.751
US-Dollar	Japanischer Yen	236.132	26.828.855	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	355.714

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Japanischer Yen	259.400	29.823.912	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39.308
					<b>JPY</b>	<b>45.200.917</b>
					<b>USD</b>	<b>392.570</b>
Japanischer Yen	US-Dollar	70.979.090	625.844	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.070.681)
Japanischer Yen	US-Dollar	65.019.897	572.843	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(928.255)
Japanischer Yen	US-Dollar	28.111.034	247.531	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(385.769)
Japanischer Yen	US-Dollar	42.689.265	376.807	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(690.397)
					<b>JPY</b>	<b>(3.075.102)</b>
					<b>USD</b>	<b>(26.707)</b>

# BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Australien - 31.626.986</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 30.770.731)</b>			
170.351	CSL Ltd	31.626.986	1,98
<b>Kanada - 55.033.648</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 44.974.227)</b>			
972.135	Alimentation Couche-Tard Inc	35.783.073	2,24
178.534	Canadian National Railway Co	19.250.575	1,20
<b>Dänemark - 48.942.571</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 36.016.968)</b>			
492.855	Novo Nordisk A/S	48.942.571	3,06
<b>Finnland - 20.904.778</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 25.722.648)</b>			
331.296	Kone Oyj - Class B	20.904.778	1,31
<b>Frankreich - 94.660.281</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 80.243.745)</b>			
455.443	Dassault Systemes SE	23.821.946	1,49
83.624	L'Oreal SA	34.864.936	2,18
49.499	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	35.973.399	2,24
<b>Hongkong - 48.098.811</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 73.331.586)</b>			
3.092.200	AIA Group Ltd	27.386.510	1,71
428.200	Jardine Matheson Holdings Ltd	20.712.301	1,29
<b>Japan - 126.833.203</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 140.699.748)</b>			
109.600	FANUC Corp	20.428.376	1,27
99.300	Keyence Corp	54.847.047	3,43
208.600	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	31.749.112	1,98
33.400	SMC Corp	19.808.668	1,24
<b>Spanien - 21.162.698</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 31.311.885)</b>			
741.900	Industria de Diseno Textil SA	21.162.698	1,32
<b>Schweiz - 92.625.483</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 125.538.351)</b>			
262.602	Nestle SA	32.267.024	2,02
105.130	Roche Holding AG	38.425.477	2,40
7.465	SGS SA	21.932.982	1,37
<b>Taiwan - 47.044.026</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 54.187.855)</b>			
445.162	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	47.044.026	2,94
<b>Vereinigtes Königreich - 131.463.563</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 111.867.866)</b>			
1.721.081	Compass Group Plc	33.777.213	2,11
699.471	Experian Plc	30.207.622	1,89
132.301	Linde Plc	40.252.126	2,51
1.796.500	Prudential Plc	27.226.602	1,70
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 854.936.136</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 780.633.656)</b>			
87.010	Adobe Inc	43.351.351	2,71
19.018	Alphabet Inc	48.349.196	3,02
560.894	Amphenol Corp - Class A	43.078.201	2,69
185.817	Automatic Data Processing Inc	40.255.421	2,51
12.452	Booking Holdings Inc	26.253.520	1,64
601.968	Cisco Systems Inc/Delaware	33.508.732	2,09
233.951	Cognex Corp	15.979.960	1,00
419.943	Cognizant Technology Solutions Corp	32.724.913	2,04
233.211	Colgate-Palmolive Co	17.480.057	1,09
396.890	Edwards Lifesciences Corp	45.144.676	2,82
659.669	Fastenal Co	37.126.269	2,32
94.466	Fortinet Inc	29.830.820	1,86
57.473	Illumina Inc	19.216.967	1,20
127.116	Intuitive Surgical Inc	40.102.637	2,51

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
153.762	Johnson & Johnson	23.099.396	1,44
112.765	Mastercard Inc	35.592.508	2,22
237.719	Microsoft Corp	70.212.135	4,39
296.060	NIKE Inc	43.346.686	2,71
403.073	Oracle Corp	30.873.915	1,93
179.867	Paychex Inc	21.569.014	1,35
126.016	Stryker Corp	29.603.498	1,85
203.779	Texas Instruments Inc	33.745.668	2,11
561.287	TJX Cos Inc/The	37.438.824	2,34
192.587	Walt Disney Co/The	26.203.483	1,64
94.260	Waters Corp	30.848.289	1,93
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>1.573.332.184</b>	<b>98,29</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 40.171 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.227)		40.171	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>1.573.372.355</b>	<b>98,29</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (76.616) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (42.170))		(76.616)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(76.616)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>27.488.308</b>	<b>1,71</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>1.600.784.047</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
<b>% des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			98,11
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,00
Sonstiges Umlaufvermögen			1,89
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund**

Euro	US-Dollar	118.780	135.275	3. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38)
						<b>EUR (38)</b>

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse JPY J (Acc) (Hedged)**

Euro	Japanischer Yen	162	20.860	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Euro	Japanischer Yen	61	7.789	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	Japanischer Yen	116	14.890	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Japanischer Yen	Euro	9.801	75	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>EUR 6</b>
						<b>JPY 786</b>

Japanischer Yen	Euro	7.235	56	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Japanischer Yen	Euro	9.311	72	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Japanischer Yen	Euro	20.510	159	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
Japanischer Yen	Euro	9.401	73	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Japanischer Yen	Euro	7.667	60	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
Japanischer Yen	Euro	1.058.420	8.244	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(163)
						<b>EUR (169)</b>
						<b>JPY (22.133)</b>

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)**

Singapur-Dollar	Euro	50.198	32.662	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	47
Singapur-Dollar	Euro	64.396	41.853	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	108
Singapur-Dollar	Euro	141.758	91.815	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	556
Singapur-Dollar	Euro	64.875	41.930	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	343
Singapur-Dollar	Euro	53.091	34.357	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	238
Singapur-Dollar	Euro	7.329.640	4.743.826	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	32.230
						<b>EUR 33.522</b>
						<b>SGD 51.431</b>

Euro	Singapur-Dollar	93.097	143.396	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(341)
Euro	Singapur-Dollar	34.131	52.729	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(228)
Euro	Singapur-Dollar	66.943	103.341	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(395)
Singapur-Dollar	Euro	68.047	44.385	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(45)
						<b>EUR (1.009)</b>
						<b>SGD (1.548)</b>

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged)**

Singapur-Dollar	Euro	3.886	2.528	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Singapur-Dollar	Euro	4.981	3.238	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8
Singapur-Dollar	Euro	10.951	7.093	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	43
Singapur-Dollar	Euro	5.017	3.243	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	27
Singapur-Dollar	Euro	4.120	2.666	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged) Forts.**

Singapur-Dollar	Euro	565.506	366.002	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.487
						<b>EUR 2.587</b>
						<b>SGD 3.969</b>

Euro	Singapur-Dollar	7.154	11.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(26)
Euro	Singapur-Dollar	2.626	4.057	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(18)
Euro	Singapur-Dollar	5.135	7.927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30)
Singapur-Dollar	Euro	5.322	3.471	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
						<b>EUR (78)</b>
						<b>SGD (120)</b>

**BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse USD W (Hedged)**

Euro	US-Dollar	215.769	243.430	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.997
Euro	US-Dollar	80.205	90.767	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	497
Euro	US-Dollar	155.407	175.189	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.562
						<b>EUR 4.056</b>
						<b>USD 4.618</b>

US-Dollar	Euro	121.970	107.592	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(482)
US-Dollar	Euro	90.776	80.334	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(617)
US-Dollar	Euro	150.000	132.384	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(659)
US-Dollar	Euro	12.370.985	10.932.754	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(68.971)
US-Dollar	Euro	88.415	78.039	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(396)
US-Dollar	Euro	200.000	176.313	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(680)
US-Dollar	Euro	111.757	98.768	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(627)
US-Dollar	Euro	245.463	216.934	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.376)
US-Dollar	Euro	140.000	124.058	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.115)
US-Dollar	Euro	110.998	97.874	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(399)

						<b>EUR (75.322)</b>
						<b>USD (85.754)</b>

# BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Kanada - 19.407.454</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
239.761	Magna International Inc (Units)	19.407.454	1,95
<b>China - 54.781.649</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 23.640.802)</b>			
6.296.000	Geely Automobile Holdings Ltd	17.178.139	1,73
48.068	NXP Semiconductors NV	10.952.775	1,10
1.065.770	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	12.466.533	1,25
281.852	XPeng Inc ADR - Class A	14.184.202	1,43
<b>Frankreich - 19.247.064</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.022.230)</b>			
388.702	Alstom SA	13.807.173	1,39
209.108	Cie Plastic Omnium SA	5.439.891	0,55
<b>Deutschland - 68.096.501</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 30.594.133)</b>			
222.958	Daimler AG	17.181.017	1,73
111.795	Daimler Truck Holding AG	4.112.375	0,41
443.549	Infineon Technologies AG	20.540.100	2,07
100.726	KION Group AG	11.046.801	1,11
87.836	Siemens AG	15.216.208	1,53
<b>Japan - 61.659.728</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 28.444.156)</b>			
376.200	Anritsu Corp	5.811.592	0,59
294.300	Denso Corp	24.396.224	2,46
204.100	East Japan Railway Co	12.552.425	1,26
328.400	Taiyo Yuden Co Ltd	18.899.487	1,90
<b>Niederlande - 11.419.845</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.495.101)</b>			
113.887	Alfen Beheer BV '144A'	11.419.845	1,15
<b>Republik Korea - 30.201.896</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 32.206.841)</b>			
978.856	Hanon Systems	11.095.760	1,12
34.649	Samsung SDI Co Ltd	19.106.136	1,92
<b>Singapur - 23.356.036</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
472.853	STMicroelectronics NV	23.356.036	2,35
<b>Schweiz - 19.421.610</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 24.063.596)</b>			
269.036	ABB Ltd	10.305.862	1,03
134.297	Landis+Gyr Group AG	9.115.748	0,92
<b>Taiwan - 28.628.420</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.190.494)</b>			
667.000	MediaTek Inc	28.628.420	2,88
<b>Vereinigtes Königreich - 28.094.875</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.332.120)</b>			
1.446.698	CNH Industrial NV	28.094.875	2,83
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 605.883.321</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 276.162.501)</b>			
12.480	Alphabet Inc	36.122.050	3,64
105.721	Amphenol Corp - Class A	9.244.244	0,93
90.518	ANSYS Inc	36.295.455	3,65
121.601	Aptiv Plc	20.056.869	2,02
36.112	CrowdStrike Holdings Inc	7.395.015	0,74
187.999	Diodes Inc	20.663.910	2,08
110.478	Eaton Corp Plc	19.097.780	1,92
183.876	Everbridge Inc	12.397.839	1,25
170.970	General Motors Co	10.022.261	1,01
82.496	Hubbell Inc - Class B	17.186.804	1,73
203.909	Lumentum Holdings Inc	21.558.279	2,17
330.987	Lyft Inc	14.139.765	1,42
368.433	Marvell Technology Inc	32.248.941	3,25

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
792.831	MP Materials Corp	36.006.420	3,62
137.114	NVIDIA Corp	40.334.825	4,06
262.582	ON Semiconductor Corp	17.839.821	1,80
551.598	Plug Power Inc	15.568.854	1,57
88.559	QUALCOMM Inc	16.201.426	1,63
55.550	Rockwell Automation Inc	19.383.062	1,95
34.422	Roper Technologies Inc	16.930.977	1,70
135.467	Schneider Electric SE	26.596.843	2,68
333.961	Semtech Corp	29.682.454	2,99
84.547	Skyworks Solutions Inc	13.119.158	1,32
140.996	Splunk Inc	16.318.172	1,64
56.966	TE Connectivity Ltd	9.191.749	0,92
11.752	Tesla Inc	12.422.628	1,25
91.670	Twilio Inc - Class A	24.146.336	2,43
326.564	Uber Technologies Inc	13.696.094	1,38
148.593	Visteon Corp	16.526.514	1,66
108.135	Wolfspeed Inc	12.092.196	1,22
717.738	Zuora Inc	13.396.580	1,35
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>970.198.399</b>	<b>97,64</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 2.775.355 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.244.388)		2.775.355	0,28
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>972.973.754</b>	<b>97,92</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (284.872) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (55.097))		(284.872)	(0,03)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(284.872)</b>	<b>(0,03)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>20.921.207</b>	<b>2,11</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>993.610.089</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
<b>% des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,34	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,28	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,38	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	US-Dollar	1.633	1.776	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	15
Schweizer Franken	US-Dollar	33.125.990	35.864.511	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	499.318
Schweizer Franken	US-Dollar	282.929	308.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.465
Schweizer Franken	US-Dollar	23.060	25.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	205
Schweizer Franken	US-Dollar	284.866	310.191	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.519
Schweizer Franken	US-Dollar	751.179	815.288	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9.314
Schweizer Franken	US-Dollar	15.500	16.784	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	231
Schweizer Franken	US-Dollar	20.000	21.783	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	172
Schweizer Franken	US-Dollar	561.617	610.578	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.933
Schweizer Franken	US-Dollar	25.000	27.083	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	361
Schweizer Franken	US-Dollar	113.178	123.027	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.214
Schweizer Franken	US-Dollar	25.000	27.211	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	232
Schweizer Franken	US-Dollar	286.532	313.782	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	756
Schweizer Franken	US-Dollar	20.000	21.883	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	72
					<b>USD</b>	<b>522.807</b>
					<b>CHF</b>	<b>476.382</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	27.199	25.000	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(237)
US-Dollar	Schweizer Franken	21.876	20.000	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Schweizer Franken	531.648	489.844	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6.075)
US-Dollar	Schweizer Franken	49.537	45.525	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(437)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.777	1.633	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Schweizer Franken	562.149	519.081	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7.668)
US-Dollar	Schweizer Franken	177.646	163.557	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.898)
US-Dollar	Schweizer Franken	534.786	491.861	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.151)
US-Dollar	Schweizer Franken	14.851	13.715	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(204)
US-Dollar	Schweizer Franken	5.573	5.145	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(74)
US-Dollar	Schweizer Franken	442.255	409.028	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6.752)
US-Dollar	Schweizer Franken	9.789	9.020	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(113)
US-Dollar	Schweizer Franken	583.677	536.984	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.793)
US-Dollar	Schweizer Franken	238.706	219.869	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.853)
					<b>USD</b>	<b>(37.143)</b>
					<b>CHF</b>	<b>(33.845)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	US-Dollar	121.245	131.268	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.828
Schweizer Franken	US-Dollar	1.026	1.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Schweizer Franken	US-Dollar	1.034	1.126	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Schweizer Franken	US-Dollar	2.735	2.968	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	34
Schweizer Franken	US-Dollar	2.045	2.224	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22
Schweizer Franken	US-Dollar	1.016	1.113	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
					<b>USD</b>	<b>1.905</b>
					<b>CHF</b>	<b>1.736</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	1.954	1.800	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(22)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Schweizer Franken	2.065	1.907	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(28)
US-Dollar	Schweizer Franken	653	601	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.958	1.801	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.620	1.498	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Schweizer Franken	2.155	1.982	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Schweizer Franken	880	811	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
					<b>USD</b>	<b>(132)</b>
					<b>CHF</b>	<b>(120)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	US-Dollar	12.000	13.084	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	89
Schweizer Franken	US-Dollar	48.279	52.577	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	421
Schweizer Franken	US-Dollar	48.649	52.974	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	430
Schweizer Franken	US-Dollar	128.531	139.500	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.594
Schweizer Franken	US-Dollar	96.140	104.522	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.016
Schweizer Franken	US-Dollar	15.348	16.793	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	55
Schweizer Franken	US-Dollar	1.000	1.088	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Schweizer Franken	US-Dollar	48.238	52.825	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	127
Schweizer Franken	US-Dollar	5.823.158	6.304.557	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	87.774
					<b>USD</b>	<b>91.515</b>
					<b>CHF</b>	<b>83.388</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	1.088	1.000	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Schweizer Franken	16.788	15.348	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Schweizer Franken	96.783	89.368	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.320)
US-Dollar	Schweizer Franken	30.612	28.184	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(327)
US-Dollar	Schweizer Franken	91.887	84.512	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(885)
US-Dollar	Schweizer Franken	75.814	70.118	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.157)
US-Dollar	Schweizer Franken	123.019	113.178	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.221)
US-Dollar	Schweizer Franken	11.526	10.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(133)
US-Dollar	Schweizer Franken	103.249	94.990	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.025)
US-Dollar	Schweizer Franken	42.188	38.859	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(469)
US-Dollar	Schweizer Franken	93.759	86.386	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.071)
					<b>USD</b>	<b>(7.673)</b>
					<b>CHF</b>	<b>(6.992)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	US-Dollar	295	320	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	299	326	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Schweizer Franken	US-Dollar	4.629	5.041	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40
Schweizer Franken	US-Dollar	4.665	5.079	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	41
Schweizer Franken	US-Dollar	12.324	13.376	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	153
Schweizer Franken	US-Dollar	9.219	10.022	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	97
Schweizer Franken	US-Dollar	4.298	4.707	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged) Forts.**

Schweizer Franken	US-Dollar	545,446	590,538	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8,222	
						<b>USD</b>	<b>8,571</b>
						<b>CHF</b>	<b>7,810</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	34,823	31,984	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(287)	
US-Dollar	Schweizer Franken	9,280	8,569	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(127)	
US-Dollar	Schweizer Franken	2,935	2,703	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(31)	
US-Dollar	Schweizer Franken	8,811	8,104	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(85)	
US-Dollar	Schweizer Franken	7,288	6,740	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(111)	
US-Dollar	Schweizer Franken	9,682	8,907	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(96)	
US-Dollar	Schweizer Franken	3,956	3,644	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(44)	
US-Dollar	Schweizer Franken	8,787	8,096	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(100)	
						<b>USD</b>	<b>(881)</b>
						<b>CHF</b>	<b>(803)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	668,004	723,228	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	10,069	
Schweizer Franken	US-Dollar	9,789	10,661	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	85	
Schweizer Franken	US-Dollar	9,864	10,741	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	87	
Schweizer Franken	US-Dollar	26,025	28,246	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	323	
Schweizer Franken	US-Dollar	19,470	21,167	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	206	
Schweizer Franken	US-Dollar	465,580	505,270	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5,817	
Schweizer Franken	US-Dollar	9,868	10,806	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	26	
						<b>USD</b>	<b>16,613</b>
						<b>CHF</b>	<b>15,138</b>
US-Dollar	Schweizer Franken	10,741	9,897	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(123)	
US-Dollar	Schweizer Franken	19,512	18,017	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(266)	
US-Dollar	Schweizer Franken	6,170	5,681	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(66)	
US-Dollar	Schweizer Franken	18,566	17,075	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(179)	
US-Dollar	Schweizer Franken	15,323	14,172	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(234)	
US-Dollar	Schweizer Franken	11,804	10,859	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(117)	
US-Dollar	Schweizer Franken	4,826	4,445	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(54)	
						<b>USD</b>	<b>(1,039)</b>
						<b>CHF</b>	<b>(947)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	198,769	224,990	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1,309
Euro	US-Dollar	166,972	189,022	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1,079
Euro	US-Dollar	503,112	570,087	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2,825
Euro	US-Dollar	499,227	564,939	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3,548
Euro	US-Dollar	209,816	236,891	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2,034
Euro	US-Dollar	1,316,132	1,489,373	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9,354
Euro	US-Dollar	31,061	34,931	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	439
Euro	US-Dollar	249,296	282,807	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1,075

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) Forts.**

Euro	US-Dollar	992,027	1,125,153	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4,505	
Euro	US-Dollar	39,227	44,199	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	470	
Euro	US-Dollar	83,808	94,886	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	549	
Euro	US-Dollar	512,058	580,556	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2,543	
Euro	US-Dollar	10,760	12,225	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	28	
Euro	US-Dollar	59,047,495	66,823,303	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	416,236	
						<b>USD</b>	<b>445,994</b>
						<b>EUR</b>	<b>391,738</b>
US-Dollar	Euro	94,864	83,808	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(552)	
US-Dollar	Euro	16,177	14,328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(139)	
US-Dollar	Euro	225,043	198,769	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1,302)	
US-Dollar	Euro	189,063	166,972	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1,074)	
US-Dollar	Euro	445,405	394,167	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3,448)	
US-Dollar	Euro	15,630	13,794	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(78)	
US-Dollar	Euro	1,088,970	962,619	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7,199)	
US-Dollar	Euro	216,760	191,869	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1,729)	
US-Dollar	Euro	49,536	43,684	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(208)	
US-Dollar	Euro	820,220	727,677	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8,412)	
US-Dollar	Euro	56,715	50,187	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(435)	
US-Dollar	Euro	982,853	868,564	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6,213)	
US-Dollar	Euro	29,320	25,846	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(112)	
US-Dollar	Euro	328,602	290,638	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2,359)	
US-Dollar	Euro	90,099	80,117	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1,133)	
US-Dollar	Euro	1,038,863	920,927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9,831)	
US-Dollar	Euro	724,129	641,634	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6,524)	
US-Dollar	Euro	26,257	23,303	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(279)	
US-Dollar	Euro	989,679	875,865	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7,701)	
						<b>USD</b>	<b>(58,728)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(51,584)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	99,992	113,222	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	643	
Euro	US-Dollar	4,558	5,168	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	23	
Euro	US-Dollar	4,537	5,141	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	25	
Euro	US-Dollar	4,502	5,095	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	32	
Euro	US-Dollar	9,670	10,918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	94	
Euro	US-Dollar	11,694	13,233	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	83	
Euro	US-Dollar	8,729	9,901	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	40	
Euro	US-Dollar	518,400	586,667	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3,654	
						<b>USD</b>	<b>4,594</b>
						<b>EUR</b>	<b>4,035</b>
US-Dollar	Euro	113,197	99,992	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(646)	
US-Dollar	Euro	8,695	7,695	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(68)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	9.150	8.112	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(87)
US-Dollar	Euro	2.893	2.559	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	8.671	7.662	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(55)
US-Dollar	Euro	7.233	6.417	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(74)
US-Dollar	Euro	9.584	8.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Euro	3.918	3.467	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30)
<b>USD</b>						<b>(1.044)</b>
<b>EUR</b>						<b>(917)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	23.874	27.024	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	157
Euro	US-Dollar	10.162	11.504	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	66
Euro	US-Dollar	4.200	4.763	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	21.871	24.730	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	176
Euro	US-Dollar	22.100	25.061	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	105
Euro	US-Dollar	322.003	365.077	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.599
Euro	US-Dollar	281.790	319.038	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.846
Euro	US-Dollar	26.988	30.558	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	174
Euro	US-Dollar	400	453	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	77.036	87.029	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	694
Euro	US-Dollar	990	1.125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	900	1.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	65.387	73.892	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	567
Euro	US-Dollar	95.491	108.328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	412
Euro	US-Dollar	40.975	46.080	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	579
Euro	US-Dollar	17.375	19.609	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	177
Euro	US-Dollar	855.293	967.874	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.079
Euro	US-Dollar	34.573	39.035	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	335
Euro	US-Dollar	322.577	365.038	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.293
Euro	US-Dollar	37.411	42.437	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	164
Euro	US-Dollar	325.110	368.389	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.826
Euro	US-Dollar	635.530	720.815	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.886
Euro	US-Dollar	377.568.222	427.288.918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	266.154
<b>USD</b>						<b>286.324</b>
<b>EUR</b>						<b>251.492</b>

US-Dollar	Euro	318.962	281.790	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.855)
US-Dollar	Euro	30.552	26.988	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(174)
US-Dollar	Euro	286.584	253.617	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.219)
US-Dollar	Euro	701.741	620.320	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.639)
US-Dollar	Euro	39.096	34.607	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(312)
US-Dollar	Euro	528.733	469.078	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.423)
US-Dollar	Euro	24.627	21.856	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(262)
US-Dollar	Euro	634.345	560.582	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.010)
US-Dollar	Euro	7.659	6.752	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(29)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	212.856	188.264	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.528)
US-Dollar	Euro	59.839	53.210	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(753)
US-Dollar	Euro	672.868	596.481	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6.367)
US-Dollar	Euro	13.479	11.938	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(116)
US-Dollar	Euro	36.044	31.775	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(139)
US-Dollar	Euro	27.030	23.874	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(156)
US-Dollar	Euro	11.507	10.162	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(65)
US-Dollar	Euro	104	92	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	634.445	561.483	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.937)
<b>USD</b>						<b>(32.985)</b>
<b>EUR</b>						<b>(28.972)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	7.970	9.031	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	45
Euro	US-Dollar	7.909	8.950	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	56
Euro	US-Dollar	20.984	23.746	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	149
Euro	US-Dollar	15.661	17.763	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	71
Euro	US-Dollar	4.785	5.422	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	27
Euro	US-Dollar	7.889	8.944	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39
Euro	US-Dollar	947.975	1.072.811	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.682
<b>USD</b>						<b>7.069</b>
<b>EUR</b>						<b>6.209</b>
US-Dollar	Euro	16.516	14.641	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(156)
US-Dollar	Euro	5.223	4.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38)
US-Dollar	Euro	15.604	13.790	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)
US-Dollar	Euro	22.810	20.244	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(243)
US-Dollar	Euro	13.320	11.817	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(137)
US-Dollar	Euro	17.699	15.645	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(117)
US-Dollar	Euro	7.191	6.364	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Euro	15.929	14.097	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(124)
<b>USD</b>						<b>(970)</b>
<b>EUR</b>						<b>(652)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	10.535	11.945	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	52
Euro	US-Dollar	10.569	11.976	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	10.488	11.869	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	75
Euro	US-Dollar	27.802	31.461	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	198
Euro	US-Dollar	20.752	23.536	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	94
Euro	US-Dollar	1.233.393	1.395.816	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8.694
<b>USD</b>						<b>9.172</b>
<b>EUR</b>						<b>8.056</b>
US-Dollar	Euro	20.707	18.326	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(161)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	21.822	19.345	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(207)
US-Dollar	Euro	6.900	6.103	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(50)
US-Dollar	Euro	20.646	18.245	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(131)
US-Dollar	Euro	17.226	15.282	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(177)
US-Dollar	Euro	22.859	20.207	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(151)
US-Dollar	Euro	9.339	8.265	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(72)
						<b>USD (949)</b>
						<b>EUR (834)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	394.505	446.547	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.597
Euro	US-Dollar	257.826	292.148	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.448
Euro	US-Dollar	69.315	78.627	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	304
Euro	US-Dollar	255.237	288.834	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.814
Euro	US-Dollar	676.574	765.631	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.808
Euro	US-Dollar	24.985	28.098	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	353
Euro	US-Dollar	14.985	16.934	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	130
Euro	US-Dollar	508.159	576.352	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.307
Euro	US-Dollar	128.484	145.152	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.158
Euro	US-Dollar	112.329	127.281	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	632
Euro	US-Dollar	87.799	99.404	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	575
Euro	US-Dollar	257.419	291.855	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.278
Euro	US-Dollar	51.172	58.027	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	244
Euro	US-Dollar	149.985	170.402	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	392
Euro	US-Dollar	29.901.906	33.839.610	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	210.784
						<b>USD 228.824</b>
						<b>EUR 200.987</b>
US-Dollar	Euro	99.381	87.799	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(578)
US-Dollar	Euro	446.653	394.505	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.584)
US-Dollar	Euro	531.053	470.766	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.025)
US-Dollar	Euro	167.781	148.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.204)
US-Dollar	Euro	505.388	446.620	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.195)
US-Dollar	Euro	219.637	193.611	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(835)
US-Dollar	Euro	28.393	25.125	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(218)
US-Dollar	Euro	421.812	374.220	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.326)
US-Dollar	Euro	557.290	492.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.684)
US-Dollar	Euro	226.817	200.725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.756)
US-Dollar	Euro	502.892	445.059	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.913)
US-Dollar	Euro	110.580	97.331	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(254)
						<b>USD (27.572)</b>
						<b>EUR (24.218)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	6.952	7.878	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	39
------	-----------	-------	-------	-------------	-----------------------------	----

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	6.899	7.807	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	49
Euro	US-Dollar	18.288	20.695	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	130
Euro	US-Dollar	13.650	15.482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	62
Euro	US-Dollar	4.563	5.141	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	55
Euro	US-Dollar	499.985	566.076	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.275
Euro	US-Dollar	6.930	7.857	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	34
Euro	US-Dollar	806.509	912.716	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.685
						<b>USD 9.329</b>
						<b>EUR 8.194</b>

US-Dollar	Euro	565.941	499.985	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.292)
US-Dollar	Euro	14.354	12.725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(136)
US-Dollar	Euro	4.539	4.014	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Euro	13.580	12.001	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(86)
US-Dollar	Euro	11.264	9.993	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(116)
US-Dollar	Euro	14.947	13.213	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(99)
US-Dollar	Euro	6.107	5.404	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(47)
US-Dollar	Euro	13.540	11.983	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(105)
						<b>USD (3.914)</b>
						<b>EUR (3.438)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	17.499	19.807	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	115
Euro	US-Dollar	17.191	19.461	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Euro	US-Dollar	169.145	191.830	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	782
Euro	US-Dollar	4.705	5.320	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	38
Euro	US-Dollar	170.000	192.775	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	811
Euro	US-Dollar	694.264	787.136	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.447
Euro	US-Dollar	171.933	194.661	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.126
Euro	US-Dollar	46.538	52.695	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	299
Euro	US-Dollar	109.456	124.025	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	616
Euro	US-Dollar	46.303	52.310	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	417
Euro	US-Dollar	44.249	50.272	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	116
Euro	US-Dollar	101.660	114.546	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.218
Euro	US-Dollar	111.606	126.123	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	968
Euro	US-Dollar	78.220	88.734	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	337
Euro	US-Dollar	94.478	106.249	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.336
Euro	US-Dollar	941.776	1.062.859	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9.576
Euro	US-Dollar	1.802.466	2.039.724	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12.810
Euro	US-Dollar	101.467	114.561	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	984
Euro	US-Dollar	20.385	23.124	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	89
Euro	US-Dollar	680.792	770.404	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.839
Euro	US-Dollar	686.122	777.459	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.853
Euro	US-Dollar	1.324.504	1.502.246	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.014



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.**

Euro	US-Dollar	78.652.680	89.010.244	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	554.436	
						<b>USD</b>	<b>604.338</b>
						<b>EUR</b>	<b>530.819</b>
US-Dollar	Euro	194.614	171.933	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.132)	
US-Dollar	Euro	52.684	46.538	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(301)	
US-Dollar	Euro	19.465	17.191	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(111)	
US-Dollar	Euro	593.333	525.079	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.593)	
US-Dollar	Euro	156.088	137.752	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(775)	
US-Dollar	Euro	1.450.835	1.282.497	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9.592)	
US-Dollar	Euro	80.319	71.096	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(641)	
US-Dollar	Euro	1.095.152	971.588	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(11.232)	
US-Dollar	Euro	1.353	1.200	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(14)	
US-Dollar	Euro	2.596	2.297	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)	
US-Dollar	Euro	21.927	19.329	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(83)	
US-Dollar	Euro	25.871	23.005	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(325)	
US-Dollar	Euro	137.786	121.858	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(979)	
US-Dollar	Euro	439.266	388.518	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.153)	
US-Dollar	Euro	1.391.012	1.233.099	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13.163)	
US-Dollar	Euro	9.794	8.678	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(98)	
US-Dollar	Euro	127.875	113.260	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.098)	
US-Dollar	Euro	17.593	15.509	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(68)	
US-Dollar	Euro	3.622	3.193	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(15)	
US-Dollar	Euro	19.812	17.499	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(115)	
US-Dollar	Euro	1.316.582	1.163.486	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8.322)	
US-Dollar	Euro	1.319.507	1.167.764	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10.268)	
						<b>USD</b>	<b>(66.088)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(58.048)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	524	594	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	520	589	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	US-Dollar	1.377	1.558	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	10	
Euro	US-Dollar	1.028	1.166	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	528	599	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	61.031	69.068	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	430	
						<b>USD</b>	<b>455</b>
						<b>EUR</b>	<b>400</b>
US-Dollar	Euro	1.076	954	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)	
US-Dollar	Euro	340	301	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	1.020	902	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	851	755	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	1.127	997	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
US-Dollar	Euro	461	408	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)	

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	1.023	906	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
						<b>USD</b>	<b>(46)</b>
						<b>EUR</b>	<b>(40)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Acc) (Hedged)**

Singapur-Dollar	US-Dollar	17.412	12.875	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	45	
Singapur-Dollar	US-Dollar	17.437	12.855	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	84	
Singapur-Dollar	US-Dollar	17.444	12.828	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	115	
Singapur-Dollar	US-Dollar	45.804	33.570	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	417	
Singapur-Dollar	US-Dollar	34.210	25.077	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	308	
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.024.665	1.483.537	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	18.785	
						<b>USD</b>	<b>19.754</b>
						<b>SGD</b>	<b>26.620</b>
US-Dollar	Singapur-Dollar	23.214	31.695	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(303)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	7.072	9.665	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(100)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	21.638	29.536	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(278)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	18.250	24.992	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(294)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	24.338	33.310	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(378)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	10.036	13.725	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(148)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	21.812	29.776	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(283)	
						<b>USD</b>	<b>(1.784)</b>
						<b>SGD</b>	<b>(2.404)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged)**

Singapur-Dollar	US-Dollar	25.629	18.955	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	63	
Singapur-Dollar	US-Dollar	6.666	4.929	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	17	
Singapur-Dollar	US-Dollar	6.676	4.922	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	32	
Singapur-Dollar	US-Dollar	6.679	4.912	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	44	
Singapur-Dollar	US-Dollar	17.537	12.853	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	160	
Singapur-Dollar	US-Dollar	14.030	10.284	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	126	
Singapur-Dollar	US-Dollar	830.319	608.402	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.704	
						<b>USD</b>	<b>8.146</b>
						<b>SGD</b>	<b>10.978</b>
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.945	12.211	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(116)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.874	12.113	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(114)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	7.484	10.249	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(121)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	9.981	13.660	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(155)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	4.116	5.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(61)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	18.953	25.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(64)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.888	12.135	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(116)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.712	3.706	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38)	

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Singapur-Dollar	38.491	52.482	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(451)
						<b>USD (1.236)</b>
						<b>SGD (1.666)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	108.504	146.632	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	230
Pfund Sterling	US-Dollar	106.241	142.491	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.309
Pfund Sterling	US-Dollar	4.305	5.753	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	73
Pfund Sterling	US-Dollar	105.929	142.047	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.330
Pfund Sterling	US-Dollar	280.494	373.887	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.766
Pfund Sterling	US-Dollar	15.566	20.652	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	416
Pfund Sterling	US-Dollar	209.081	278.834	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.160
Pfund Sterling	US-Dollar	19.795	26.164	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	629
Pfund Sterling	US-Dollar	283.500	376.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.326
Pfund Sterling	US-Dollar	12.086.870	15.967.615	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	392.178
						<b>USD 413.415</b>
						<b>GBP 305.430</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	259.171	195.683	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.690)
US-Dollar	Pfund Sterling	80.408	60.796	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.881)
US-Dollar	Pfund Sterling	243.813	183.514	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.576)
US-Dollar	Pfund Sterling	201.472	152.329	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.708)
US-Dollar	Pfund Sterling	267.514	201.942	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.817)
US-Dollar	Pfund Sterling	107.111	80.717	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.141)
US-Dollar	Pfund Sterling	235.189	177.948	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.667)
						<b>USD (30.480)</b>
						<b>GBP (22.519)</b>

**BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	22.944	31.006	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	49
Pfund Sterling	US-Dollar	22.813	30.596	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	281
Pfund Sterling	US-Dollar	22.755	30.513	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	286
Pfund Sterling	US-Dollar	60.371	80.472	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.241
Pfund Sterling	US-Dollar	45.047	60.076	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	896
Pfund Sterling	US-Dollar	2.890.205	3.818.167	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	93.777
						<b>USD 96.530</b>
						<b>GBP 71.316</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	56.125	42.376	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.232)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.421	13.172	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(407)
US-Dollar	Pfund Sterling	52.636	39.618	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(988)
US-Dollar	Pfund Sterling	43.569	32.941	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.018)
US-Dollar	Pfund Sterling	58.094	43.854	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.263)
US-Dollar	Pfund Sterling	278.865	210.040	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5.428)
US-Dollar	Pfund Sterling	25.715	19.378	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(514)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Pfund Sterling	56.343	42.630	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.358)
						<b>USD (12.208)</b>
						<b>GBP (9.019)</b>

# BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Österreich - 977.395</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 817.709)</b>			
8.623	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	267.960	0,33
92.858	Telekom Austria AG - Class A	709.435	0,87
<b>Belgien - 1.560.866</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.812.212)</b>			
22.801	Bekaert SA	892.887	1,10
2.323	Cofinimmo SA (REIT)	326.962	0,40
1.996	D'ieteren Group	341.017	0,42
<b>Dänemark - 463.318</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.165.443)</b>			
8.347	GN Store Nord AS	463.318	0,57
<b>Finnland - 3.660.707</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.292.258)</b>			
156.191	Outokumpu Oyj	859.832	1,06
55.644	TietoEVRY Oyj	1.527.984	1,88
33.867	Valmet Oyj	1.272.891	1,57
<b>Frankreich - 24.258.807</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 15.128.444)</b>			
5.329	Alten SA	837.186	1,03
8.153	Arkema SA	1.014.845	1,25
22.111	Cie Plastic Omnium SA	502.362	0,62
19.797	Covivio (REIT)	1.427.364	1,76
29.845	Edenred	1.205.439	1,48
31.732	Eiffage SA	2.859.688	3,52
44.905	Elis SA	681.658	0,84
10.634	Eramet SA	760.863	0,94
105.254	Klepierre SA (REIT)	2.193.493	2,70
40.796	Korian SA	1.133.721	1,40
46.614	Maisons du Monde SA '144A'	949.993	1,17
58.199	Metropole Television SA	999.277	1,23
25.654	Nexity SA	1.058.484	1,30
36.004	Publicis Groupe SA	2.129.637	2,62
68.032	Rexel SA	1.232.059	1,52
8.758	Sopra Steria Group SACA	1.384.202	1,71
1.661	Teleperformance	651.444	0,80
4.616	Trigano SA	792.798	0,98
18.891	Ubisoft Entertainment SA	811.085	1,00
26.593	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	1.633.209	2,01
<b>Deutschland - 21.216.856</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 14.506.319)</b>			
22.957	AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	620.528	0,76
16.587	Bechtle AG	1.045.147	1,29
27.764	Brenntag SE	2.209.737	2,72
5.477	Cewe Stiftung & Co KGAA	699.413	0,86
24.274	Covestro AG '144A'	1.315.894	1,62
7.049	Dermapharm Holding SE	627.537	0,77
36.998	Deutsche EuroShop AG	539.616	0,66
122.891	Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	1.295.886	1,60
100.320	Deutz AG	655.842	0,81
30.620	DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	1.086.398	1,34
20.564	flatexDEGIRO AG	416.832	0,51
12.206	GFT Technologies SE	559.035	0,69
166.205	Heidelberger Druckmaschinen AG	436.288	0,54
6.360	Hella GmbH & Co KGaA	396.991	0,49
5.776	HelloFresh SE	392.710	0,48
19.949	HUGO BOSS AG	1.069.266	1,32
10.065	KION Group AG	969.561	1,19
14.007	Krones AG	1.346.423	1,66
12.117	Rheinmetall AG	1.007.407	1,24
1.260	Sartorius AG - Preference	753.228	0,93
146.869	Schaeffler AG - Preference	1.066.269	1,31
6.966	Siltronic AG	986.386	1,22
6.520	Sixt SE	1.014.512	1,25
289.918	Telefonica Deutschland Holding AG	705.950	0,87

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Irland - 1.156.726</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 981.984)</b>			
454	ICON Plc	124.120	0,15
3.777	ICON Plc	1.032.606	1,27
<b>Italien - 9.324.949</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.526.183)</b>			
339.914	Anima Holding SpA '144A'	1.526.214	1,88
63.294	Banca IFIS SpA	1.082.327	1,33
356.956	BPER Banca	650.820	0,80
16.423	Buzzi Unicem SpA	311.380	0,38
207.087	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT)	799.356	0,99
537.756	Iren SpA	1.425.054	1,76
356.264	Italgas SpA	2.155.041	2,66
288.058	Unipol Gruppo SpA	1.374.757	1,69
<b>Luxemburg - 1.979.440</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.323.288)</b>			
19.180	Corestate Capital Holding SA	215.104	0,27
15.990	Eurofins Scientific SE	1.764.336	2,17
<b>Malta - 462.917</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 676.871)</b>			
44.318	Kindred Group Plc SDR	462.917	0,57
<b>Niederlande - 8.864.172</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.448.342)</b>			
17.868	Aalberts NV	1.040.632	1,28
428.164	Aegon NV	1.880.068	2,32
15.676	Arcadis NV	663.252	0,82
23.661	BE Semiconductor Industries NV	1.757.776	2,17
20.008	OCI NV	462.785	0,57
29.471	SBM Offshore NV	385.112	0,47
38.016	Signify NV '144A'	1.559.796	1,92
20.398	TKH Group NV Dutch Cert	1.114.751	1,37
<b>Spanien - 4.311.762</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.171.213)</b>			
13.533	Acciona SA	2.275.574	2,80
71.844	Almirall SA	811.478	1,00
186.632	Gestamp Automocion SA '144A'	830.886	1,02
95.891	Mediaset Espana Comunicacion SA	393.824	0,49
<b>Schweden - 1.637.818</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
99.709	Nobina AB '144A'	1.040.767	1,28
168.197	Scandic Hotels Group AB '144A'	597.051	0,74

**Gesamtanlagen in Aktien** **79.875.733** **98,38**

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt** **79.875.733** **98,38**

**Nettoumlaufvermögen** **1.317.142** **1,62**

**Summe Nettovermögen** **81.192.875** **100,00**

**Portfolioanalyse** **% des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente 98,10

Sonstiges Umlaufvermögen 1,90

**Gesamtvermögen** **100,00**

# BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Deutschland - 389.077</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 281.841)</b>		<b>389.077</b>	<b>7,82</b>
997	Merck KGaA	259.083	5,21
191	Sartorius AG - Preference	129.994	2,61
<b>Irland - 151.499</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>151.499</b>	<b>3,04</b>
489	ICON Plc	151.499	3,04
<b>Niederlande - 107.485</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 130.827)</b>		<b>107.485</b>	<b>2,16</b>
5.175	uniQure NV	107.485	2,16
<b>Schweiz - 395.884</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 628.792)</b>		<b>395.884</b>	<b>7,96</b>
1.400	CRISPR Therapeutics AG	106.043	2,13
172	Lonza Group AG	143.780	2,89
351	Roche Holding AG	146.061	2,94
<b>Vereinigtes Königreich - 225.121</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>225.121</b>	<b>4,52</b>
1.917	AstraZeneca Plc	225.121	4,52
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 3.687.724</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.873.934)</b>		<b>3.687.724</b>	<b>74,10</b>
783	10X Genomics Inc (Units)	116.675	2,35
3.525	Adaptive Biotechnologies Corp	98.876	1,99
683	Alnylam Pharmaceuticals Inc	115.943	2,33
4.117	Avantor Inc	173.511	3,49
1.639	Beam Therapeutics Inc	130.571	2,62
2.146	BioMarin Pharmaceutical Inc	189.717	3,81
310	Bio-Techne Corp	160.472	3,23
1.658	Catalent Inc	212.299	4,27
396	Danaher Corp	130.306	2,62
2.692	Denali Therapeutics Inc	119.969	2,41
871	Eli Lilly & Co	240.487	4,83
1.855	Fate Therapeutics Inc	108.647	2,18
6.341	Generation Bio Co	44.989	0,90
1.710	Guardant Health Inc	171.145	3,44
195	Illumina Inc	74.232	1,49
1.317	Intellia Therapeutics Inc	155.795	3,13
2.750	Kymera Therapeutics Inc	174.763	3,51
7.236	MeiraGTx Holdings plc	171.638	3,45
267	Moderna Inc	67.839	1,36
1.732	NanoString Technologies Inc	73.177	1,47
1.056	Natera Inc	98.689	1,98
4.280	Pacific Biosciences of California Inc	87.483	1,76
2.718	PTC Therapeutics Inc	108.326	2,18
2.346	Quanterix Corp	99.517	2,00
2.043	REGENXBIO Inc	66.867	1,34
508	Repligen Corp	134.584	2,70
1.785	Sarepta Therapeutics Inc	160.784	3,23
901	Twist Bioscience Corp	69.760	1,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
1.552	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	130.663	2,63
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>4.956.790</b>	<b>99,60</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 6.800 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 6.080)		6.800	0,13
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>4.963.590</b>	<b>99,73</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (656) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (74))		(656)	(0,01)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(656)</b>	<b>(0,01)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>13.616</b>	<b>0,28</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>4.976.550</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse</b>			
		<b>% des Gesamtvermögens</b>	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		99,30	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,14	
Sonstiges Umlaufvermögen		0,56	
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	97.379	110.202	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		686
Euro	US-Dollar	865	980	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	2.023	2.289	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		14
Euro	US-Dollar	3.335	3.771	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		27
Euro	US-Dollar	3.400	3.856	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		15
Euro	US-Dollar	992	1.122	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		7
Euro	US-Dollar	1.178	1.336	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
					<b>USD</b>		<b>759</b>
					<b>EUR</b>		<b>667</b>
US-Dollar	Euro	3.148	2.786	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(24)
US-Dollar	Euro	2.246	1.981	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(10)
US-Dollar	Euro	800	709	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(8)
US-Dollar	Euro	3.405	3.009	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(21)
US-Dollar	Euro	2.265	2.010	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(23)
US-Dollar	Euro	863	764	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(7)
					<b>USD</b>		<b>(93)</b>
					<b>EUR</b>		<b>(82)</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	98.294	111.238	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		693
Euro	US-Dollar	1.192	1.352	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	879	996	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	2.045	2.314	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		15
Euro	US-Dollar	3.370	3.810	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		27
Euro	US-Dollar	3.435	3.896	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		16
Euro	US-Dollar	1.008	1.141	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		7
					<b>USD</b>		<b>768</b>
					<b>EUR</b>		<b>675</b>
US-Dollar	Euro	3.175	2.810	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(25)
US-Dollar	Euro	2.250	1.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(10)
US-Dollar	Euro	799	708	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(8)
US-Dollar	Euro	3.435	3.036	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(22)
US-Dollar	Euro	2.284	2.026	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(23)
US-Dollar	Euro	869	769	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(7)
					<b>USD</b>		<b>(95)</b>
					<b>EUR</b>		<b>(83)</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)</b>							
Euro	US-Dollar	98.487	111.457	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		694
Euro	US-Dollar	1.195	1.356	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	882	999	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	2.050	2.320	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		15
Euro	US-Dollar	3.377	3.819	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		27

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Euro	US-Dollar	3.442	3.904	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		16
Euro	US-Dollar	1.012	1.145	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		8
					<b>USD</b>		<b>770</b>
					<b>EUR</b>		<b>676</b>
US-Dollar	Euro	3.180	2.815	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(25)
US-Dollar	Euro	2.251	1.986	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(10)
US-Dollar	Euro	799	708	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(7)
US-Dollar	Euro	3.441	3.041	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(22)
US-Dollar	Euro	2.288	2.030	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(23)
US-Dollar	Euro	870	770	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(7)
					<b>USD</b>		<b>(94)</b>
					<b>EUR</b>		<b>(83)</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)</b>							
Singapur-Dollar	US-Dollar	98.614	72.258	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		915
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.217	902	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1
Singapur-Dollar	US-Dollar	896	660	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		4
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.057	1.508	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		19
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.379	2.473	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		35
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.452	2.530	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		31
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.003	733	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		11
					<b>USD</b>		<b>1.016</b>
					<b>SGD</b>		<b>1.369</b>
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.053	2.803	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(27)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.472	1.991	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(5)
US-Dollar	Singapur-Dollar	505	689	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(7)
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.217	3.026	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(28)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.479	2.025	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(24)
US-Dollar	Singapur-Dollar	570	780	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		(8)
					<b>USD</b>		<b>(99)</b>
					<b>SGD</b>		<b>(133)</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)</b>							
Pfund Sterling	US-Dollar	99.471	131.408	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		3.227
Pfund Sterling	US-Dollar	1.222	1.652	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		2
Pfund Sterling	US-Dollar	895	1.200	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		11
Pfund Sterling	US-Dollar	2.072	2.762	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		43
Pfund Sterling	US-Dollar	3.407	4.506	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		105
Pfund Sterling	US-Dollar	3.479	4.639	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		69

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	1.028	1.362	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	30
						<b>USD 3.487</b>
						<b>GBP 2.576</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	3.736	2.827	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(90)
US-Dollar	Pfund Sterling	925	699	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.686	1.987	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.085	3.074	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(77)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.700	2.041	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.031	777	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21)
						<b>USD (275)</b>
						<b>GBP (203)</b>

# BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Australischer Dollar - 14.135.342</b>				<b>Euro Forts.</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 16.502.504)</b>				<b>1.146.000</b> Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025			
3.340.000	Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025	3.196.933	0,97	1.115.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	1.138.738	0,35
9.440.000	Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	6.448.598	1,96	1.885.000	Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026	1.876.386	0,57
6.980.000	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	4.489.811	1,37	985.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 0.375% 03-Jan-2026	991.959	0,30
<b>Kanadischer Dollar - 21.638.320</b>				1.070.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.625% 09-Jun-2023	1.098.895	0,33
<b>(31. Dezember 2020: 7.363.521)</b>				1.220.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 0.500% 23-Feb-2024	1.240.121	0,38
18.020.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	12.766.727	3,88	2.350.000	Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026	2.309.521	0,70
4.920.000	Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	3.415.302	1,04	1.609.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	1.576.474	0,48
5.384.277	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	5.456.291	1,66	1.656.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	1.641.783	0,50
<b>Kolumbianischer Peso - 5.782.363</b>				985.000	Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028	989.822	0,30
<b>(31. Dezember 2020: 5.058.653)</b>				1.638.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028	1.648.434	0,50
14.798.500.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	2.912.693	0,89	1.050.000	Orsted AS 1.500% 26-Nov-2029	1.132.546	0,35
14.335.400.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	2.869.670	0,87	1.296.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	1.344.023	0,41
<b>Tschechische Krone - 7.971.697</b>				1.621.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	1.647.082	0,50
<b>(31. Dezember 2020: 2.584.228)</b>				700.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1.625% 17-Jun-2032	732.165	0,22
125.640.000	Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	4.771.551	1,45	2.580.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	2.669.191	0,81
84.870.000	Czech Republic Government Bond 1.250% 14-Feb-2025	3.200.146	0,98	1.553.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0.000% 07-Jul-2023	1.557.760	0,47
<b>Euro - 78.202.419</b>				1.660.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	1.615.102	0,49
<b>(31. Dezember 2020: 59.930.846)</b>				1.128.000	Sani/kos Financial Holdings 1 Sarl 'REGS' 5.625% 15-Dec-2026	1.144.796	0,35
2.180.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025	2.415.941	0,74	325.000	SELP Finance Sarl 1.250% 25-Oct-2023	331.518	0,10
2.189.000	Akelius Residential Property AB FRN 2.249% 17-May-2081	2.141.039	0,65	2.098.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	2.192.116	0,67
831.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029	815.593	0,25	700.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	753.795	0,23
2.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-May-2022	2.036.200	0,62	452.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	434.878	0,13
2.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023	2.310.110	0,70	1.259.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	1.263.085	0,38
2.171.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	2.184.970	0,67	1.775.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	1.702.669	0,52
753.000	BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	764.295	0,23	570.000	Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079	589.158	0,18
722.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028	704.654	0,21	1.400.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029	1.529.500	0,47
534.000	Cedacri Mergerco SPA 'REGS' FRN 4.625% 15-May-2028	538.889	0,16	1.445.000	Ziggo BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2030	1.443.931	0,44
2.100.000	Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029	2.091.642	0,64	<b>Indische Rupie - 3.086.932</b>			
2.271.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	2.303.067	0,70	<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
2.429.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	2.498.834	0,76	252.960.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	3.086.932	0,94
1.945.000	Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029	1.966.687	0,60	<b>Indonesische Rupiah - 4.819.858</b>			
890.000	Ecolab Inc 2.625% 08-Jul-2025	963.872	0,29	<b>(31. Dezember 2020: 3.141.286)</b>			
5.422.886	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	5.801.675	1,77	20.155.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022	1.272.066	0,39
750.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.000% 29-May-2026	773.831	0,24	54.061.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	3.547.792	1,08
445.000	Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029	454.999	0,14	<b>Japanischer Yen - 6.401.776</b>			
382.000	H&M Finance BV 'EMTN' 0.250% 25-Aug-2029	370.676	0,11	<b>(31. Dezember 2020: 14.344.499)</b>			
2.219.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	2.099.951	0,64	379.800.000	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022	2.916.271	0,89
1.200.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	1.248.300	0,38	267.750.000	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022	2.058.471	0,63
1.100.000	Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028	1.202.245	0,37	179.622.324	Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	1.427.034	0,43
1.273.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	1.311.063	0,40	<b>Malaysischer Ringgit - 3.276.698</b>			
1.263.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	1.223.973	0,37	<b>(31. Dezember 2020: 3.950.587)</b>			
1.100.000	Linde Finance BV 0.250% 19-May-2027	1.105.456	0,34	15.570.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	3.276.698	1,00
970.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 13-Jan-2023	1.023.291	0,31	<b>Mexikanischer neuer Peso - 5.322.496</b>			
				<b>(31. Dezember 2020: 3.878.558)</b>			
				52.900.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	2.313.184	0,70

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Mexikanischer neuer Peso Forts.</b>			
65.750.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	3.009.312	0,92
<b>Neuseeländischer Dollar - 8.464.480</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.133.593)</b>		<b>8.464.480</b>	<b>2,57</b>
2.480.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	1.536.227	0,47
4.490.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	3.793.030	1,15
2.620.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	1.582.491	0,48
2.460.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.500% 15-Apr-2023	1.552.732	0,47
<b>Norwegische Krone - 4.182.119</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.481.349)</b>		<b>4.182.119</b>	<b>1,27</b>
32.520.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.500% 12-May-2022	3.262.608	0,99
9.000.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS 5.000% 15-Jul-2022	919.511	0,28
<b>Pfund Sterling - 40.858.584</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 29.668.149)</b>		<b>40.858.584</b>	<b>12,43</b>
116.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	139.623	0,04
1.463.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	1.681.152	0,51
565.000	Clarion Funding Plc 'EMTN' 2.625% 18-Jan-2029	717.834	0,22
740.000	Close Brothers Finance Plc 'EMTN' 2.750% 19-Oct-2026	934.308	0,28
2.213.000	Coventry Building Society 'EMTN' 1.000% 21-Sep-2025	2.586.527	0,79
1.800.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024	2.341.606	0,71
525.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	650.846	0,20
1.292.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	1.544.046	0,47
1.624.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	1.928.236	0,59
1.135.000	European Investment Bank 'EMTN' 0.750% 15-Nov-2024	1.341.067	0,41
1.271.503	Gwyn t y Mor OFTO Plc 2.778% 17-Feb-2034	1.572.935	0,48
1.495.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	1.668.992	0,51
990.000	Informa Plc 'EMTN' 3.125% 05-Jul-2026	1.227.080	0,37
2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 0.500% 24-Jul-2023	2.726.946	0,83
1.400.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024	1.747.557	0,53
1.340.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024	1.652.815	0,50
517.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.500% 20-Jan-2041	566.167	0,17
370.000	National Express Group Plc 2.375% 20-Nov-2028	446.657	0,14
800.000	National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023	972.477	0,30
1.282.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	1.560.150	0,47
1.920.000	Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2024	2.471.745	0,75
1.700.000	Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026	1.978.084	0,60
542.000	Orsted AS 'EMTN' 4.875% 12-Jan-2032	832.565	0,25
262.000	Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021	305.391	0,09
268.000	Travis Perkins Plc 3.750% 17-Feb-2026	330.488	0,10
316.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	357.619	0,11
1.259.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	1.502.218	0,46
883.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	1.034.920	0,31
630.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	749.740	0,23
1.317.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078	1.661.906	0,51
1.355.000	Yorkshire Building Society FRN 0.739% 19-Nov-2023	1.626.887	0,50
<b>Schwedische Krone - 2.207.625</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.297.555)</b>		<b>2.207.625</b>	<b>0,67</b>
22.000.000	Stadshypotek AB 1.500% 01-Mar-2024	2.207.625	0,67

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>US-Dollar - 96.676.356</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 94.554.933)</b>		<b>96.676.356</b>	<b>29,42</b>
568.000	Apple Inc 1.125% 11-May-2025	500.643	0,15
1.872.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	1.645.800	0,50
3.780.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026	3.468.185	1,06
1.020.000	Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028	829.094	0,25
920.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	846.784	0,26
1.282.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026	1.165.149	0,35
2.920.000	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	2.628.734	0,80
1.827.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	1.664.767	0,51
1.400.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Sep-2025	1.359.404	0,41
1.000.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023	956.427	0,29
1.140.000	DNB Boligkreditt AS 'REGS' 2.500% 28-Mar-2022	1.012.320	0,31
1.850.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	1.665.563	0,51
770.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 7.450% 30-Apr-2044	805.716	0,24
1.427.000	Drax Finco Plc 'REGS' 6.625% 01-Nov-2025	1.301.414	0,40
81.087	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	40.477	0,01
283.750	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040	146.814	0,04
619.125	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035	360.338	0,11
1.440.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 2.750% 07-Mar-2023	1.305.018	0,40
3.300.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	2.919.370	0,89
1.640.000	Guatemala Government Bond 'REGS' 4.875% 13-Feb-2028	1.562.712	0,48
2.290.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023	2.027.490	0,62
904.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	791.700	0,24
1.760.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	1.652.551	0,50
3.020.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 5.875% 15-Jan-2024	2.927.066	0,89
3.252.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	2.874.966	0,87
2.070.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 15-Jan-2025	1.860.337	0,57
2.790.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.440% 17-Jun-2024	2.482.448	0,76
3.350.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027	2.993.273	0,91
2.248.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	1.957.667	0,60
1.476.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	1.320.360	0,40
2.500.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	2.240.886	0,68
2.346.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026	2.145.196	0,65
316.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	283.726	0,09
2.195.000	Lumen Technologies Inc 5.800% 15-Mar-2022	1.956.300	0,59
1.785.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	1.593.575	0,48
1.643.000	Mexico Government International Bond 4.500% 22-Apr-2029	1.617.734	0,49
1.452.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	1.294.433	0,39
1.880.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027	1.567.472	0,48
636.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024	620.940	0,19
1.891.000	Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029	1.665.703	0,51
2.022.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Dec-2025	1.959.420	0,60
350.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 10-Aug-2025	360.010	0,11



## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>US-Dollar Forts.</b>				
2.653.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027	2.401.962	0,73	
2.420.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Dec-2023	2.327.847	0,71	
1.270.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	1.684.970	0,51	
1.405.000	Sprint Corp 7.875% 15-Sep-2023	1.369.920	0,42	
2.390.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	2.222.360	0,68	
1.466.000	T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	1.322.372	0,40	
2.480.000	UBS Group AG FRN (Perpetual) 5.000% 31-Jan-2023	2.197.183	0,67	
640.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024	619.505	0,19	
5.630.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023	4.975.322	1,51	
3.518.063	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	3.494.398	1,06	
3.695.890	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	3.416.438	1,04	
1.412.000	Verizon Communications Inc FRN 0.840% 20-Mar-2026	1.263.466	0,38	
226.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	216.531	0,07	
950.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	1.015.619	0,31	
1.888.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	1.653.911	0,50	
1.420.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	1.332.342	0,41	
865.000	Ziggo BV '144A' 5.500% 15-Jan-2027	784.228	0,24	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>303.027.065</b>	<b>92,21</b>	
<b>Optionen auf Futures - 167.604 (31. Dezember 2020: 28.720)</b>				
324	U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000	84.982	0,03	
133	U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000	82.622	0,02	
<b>Optionen auf Futures insgesamt</b>		<b>167.604</b>	<b>0,05</b>	
<b>Offene Terminkontrakte - 311.972 (31. Dezember 2020: (5.487))</b>				
(78)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022 (11.466.780)	138.331	0,04	
(41)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 (7.026.170)	102.438	0,03	
(124)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 (23.896.709)	21.596	0,01	
(29)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 (4.312.881)	49.607	0,01	
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>		<b>311.972</b>	<b>0,09</b>	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.546.746 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 4.971.038)		1.546.746	0,47	
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>305.053.387</b>	<b>92,82</b>	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (4.219.461) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.744.706))		(4.219.461)	(1,28)	
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(4.219.461)</b>	<b>(1,28)</b>	
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>27.788.917</b>	<b>8,46</b>	
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>328.622.843</b>	<b>100,00</b>	

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	90,87
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,14
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,46
Sonstiges Umlaufvermögen	8,53
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>						
Euro	Australischer Dollar	6.472.286	10.084.028	18. Feb. 22	State Street Bank	18.045
Euro	Kanadischer Dollar	3.424.209	4.920.000	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	14.746
Euro	Kanadischer Dollar	18.357.226	26.487.301	18. Feb. 22	State Street Bank	2.046
Euro	Neuseeländischer Dollar	15.126.156	24.763.543	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	202.805
Euro	Norwegische Krone	4.220.475	4.1944.042	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	28.473
Euro	Sudafrikanischer Rand	343.335	6.220.000	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	1.270
Euro	Sudafrikanischer Rand	4.710.936	84.303.810	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	74.708
Euro	Schwedische Krone	7.247.909	71.957.139	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	235.485
Euro	US-Dollar	4.352.590	4.890.000	18. Feb. 22	State Street Bank	36.114
Euro	US-Dollar	208.656	236.000	18. Feb. 22	State Street Bank	335
Euro	US-Dollar	1.225.706	1.385.763	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	2.473
Ungarischer Forint	Euro	122.078.917	327.875	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	500
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	6.313.830	1.493.055	18. Feb. 22	State Street Bank	19.818
Mexikanischer Peso	Euro	4.898.075	203.413	18. Feb. 22	UBS AG	6.464
Neuseeländischer Dollar	Euro	8.064.183	4.833.544	18. Feb. 22	State Street Bank	26.207
Polnischer Zloty	Euro	15.560.000	3.320.901	18. Feb. 22	State Street Bank	52.341
Pfund Sterling	Euro	222.779	261.221	18. Feb. 22	State Street Bank	3.741
Pfund Sterling	Euro	534.124	630.761	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	4.500
Pfund Sterling	Euro	393.302	467.306	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	468
Pfund Sterling	Euro	8.362.861	9.929.111	18. Feb. 22	State Street Bank	17.270
Pfund Sterling	Euro	834.691	999.744	18. Feb. 22	State Street Bank	2.997
Pfund Sterling	Euro	643.969	755.064	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	10.842
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.807.692	7080.547.701	18. Feb. 22	State Street Bank	68.045
US-Dollar	Euro	4.318.333	3.793.777	18. Feb. 22	State Street Bank	18.080
US-Dollar	Euro	2.393.532	2.102.217	18. Feb. 22	State Street Bank	10.590
US-Dollar	Euro	1.984.659	1.750.476	18. Feb. 22	State Street Bank	1.413
US-Dollar	Euro	587.392	517.825	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	675
US-Dollar	Koreanischer Won	3.431.089	4.063.370.000	18. Feb. 22	State Street Bank	13.027
US-Dollar	Philippinischer Peso	5.547.252	281.456.457	18. Feb. 22	State Street Bank	73.891
						<b>EUR 947.369</b>
Euro	Australischer Dollar	7.710.647	12.090.641	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(27.918)
Euro	Tschechische Krone	8.107.030	207.270.404	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(187.567)
Euro	Japanischer Yen	6.329.323	832.556.567	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(56.784)
Euro	Mexikanischer Peso	1.495.814	36.231.454	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(56.662)
Euro	Pfund Sterling	58.022.474	49.943.135	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.377.465)
Euro	US-Dollar	3.357.100	3.803.539	18. Feb. 22	State Street Bank	(241)
Euro	US-Dollar	4.944.652	5.628.987	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(24.139)
Euro	US-Dollar	3.073.024	3.490.000	18. Feb. 22	State Street Bank	(7.851)
Euro	US-Dollar	4.749.112	5.381.147	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(908)
Euro	US-Dollar	774.615	882.763	18. Feb. 22	State Street Bank	(4.613)
Euro	US-Dollar	93.019.023	107.534.828	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.903.582)
Euro	US-Dollar	979.120	1.136.132	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(23.761)
Ungarischer Forint	Euro	1.710.680.774	4.721.248	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(119.769)
Japanischer Yen	US-Dollar	634.781.063	5.630.656	18. Feb. 22	State Street Bank	(101.191)
Koreanischer Won	US-Dollar	4.063.372.000	3.420.059	18. Feb. 22	State Street Bank	(3.289)
Neuseeländischer Dollar	Euro	10.816.119	6.655.152	18. Feb. 22	State Street Bank	(136.991)
Schwedische Krone	Euro	48.945.823	4.835.609	18. Feb. 22	HSBC Bank plc	(65.702)
US-Dollar	Euro	559.853	496.698	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(2.507)
US-Dollar	Indische Rupie	3.571.103	268.064.824	18. Feb. 22	State Street Bank	(15.039)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	4.872.941	70.296.560.000	18. Feb. 22	State Street Bank	(50.152)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	735.759	10.646.429.000	18. Feb. 22	State Street Bank	(9.581)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts.</b>						
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	5.226.681	21.910.247	18. Feb. 22	State Street Bank	(28.622)
						<b>EUR (4.204.234)</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	Euro	3.025	2.915	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	12
Schweizer Franken	Euro	4.150	3.994	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22
Schweizer Franken	Euro	5.749	5.508	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	56
Schweizer Franken	Euro	13.464.366	12.889.896	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	140.299
Schweizer Franken	Euro	60.592	58.175	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	464
						<b>EUR 140.853</b>
						<b>CHF 145.555</b>
Euro	Schweizer Franken	2.915	3.025	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)
Euro	Schweizer Franken	3.763	3.927	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(38)
Euro	Schweizer Franken	1.420	1.478	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(10)
Euro	Schweizer Franken	13.530	14.100	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(115)
						<b>EUR (176)</b>
						<b>CHF (182)</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	Euro	720.262	689.532	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.505
						<b>EUR 7.505</b>
						<b>CHF 7.756</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)</b>						
Schweizer Franken	Euro	1.950	1.879	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8
Schweizer Franken	Euro	687	663	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	Euro	403	388	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	1.673	1.612	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7
Schweizer Franken	Euro	446	429	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	Euro	4.974	4.766	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	48
Schweizer Franken	Euro	41.155.284	39.399.354	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	428.841
Schweizer Franken	Euro	49.060	47.098	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	380
Schweizer Franken	Euro	10.087	9.674	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	88
Schweizer Franken	Euro	1.552	1.492	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	10
Schweizer Franken	Euro	20.211	19.419	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	140
Schweizer Franken	Euro	366	350	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	Euro	36.279	34.832	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	278
Schweizer Franken	Euro	6.987	6.716	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	46
Schweizer Franken	Euro	17.541	16.834	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	141
Schweizer Franken	Euro	90.274	86.629	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	734
						<b>EUR 430.730</b>
						<b>CHF 445.107</b>
Euro	Schweizer Franken	1.612	1.673	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
Euro	Schweizer Franken	388	403	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
Euro	Schweizer Franken	663	687	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)	
Euro	Schweizer Franken	1.878	1.950	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
Euro	Schweizer Franken	1.424	1.480	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(8)	
Euro	Schweizer Franken	13.490	14.080	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(136)	
Euro	Schweizer Franken	795	828	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
Euro	Schweizer Franken	1.540	1.606	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(14)	
Euro	Schweizer Franken	19.064	19.838	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(134)	
Euro	Schweizer Franken	1.768	1.840	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(13)	
Euro	Schweizer Franken	2.906	3.024	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(21)	
Euro	Schweizer Franken	49.366	51.595	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(565)	
Euro	Schweizer Franken	25.523	26.584	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(203)	
Euro	Schweizer Franken	46.584	48.464	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(318)	
Euro	Schweizer Franken	4.896	5.102	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(41)	
Euro	Schweizer Franken	3.569	3.719	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30)	
						<b>EUR</b>	<b>(1.508)</b>
						<b>CHF</b>	<b>(1.558)</b>

**BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	Euro	516.335	603.292	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	11.324	
						<b>EUR</b>	<b>11.324</b>
						<b>GBP</b>	<b>9.511</b>

**BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)**

Euro	Pfund Sterling	40	34	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	Euro	34	40	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	Euro	396.179	462.901	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	8.689	
Pfund Sterling	Euro	200	234	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4	
						<b>EUR</b>	<b>8.693</b>
						<b>GBP</b>	<b>7.301</b>

**BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	29.687	33.558	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	38
Euro	US-Dollar	249	282	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	3.889	4.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	7.072	7.998	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	79.402	89.659	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	204
Euro	US-Dollar	1.684	1.904	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	43	49	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	282	249	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	569	502	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Euro	1.463	1.291	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Euro	391	346	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	20.842	18.397	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged) Forts.</b>							
US-Dollar	Euro	1.155	1.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1	
						<b>EUR</b>	<b>272</b>
						<b>USD</b>	<b>308</b>
US-Dollar	Euro	4.397	3.890	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)	
Euro	US-Dollar	1.042	1.180	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	33.558	29.683	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(41)	
US-Dollar	Euro	2.938	2.602	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(7)	
US-Dollar	Euro	2.742	2.431	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	5.597	4.949	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	969	859	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Euro	13.566	12.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(36)	
US-Dollar	Euro	6.414	5.685	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(20)	
US-Dollar	Euro	6.168.172	5.460.520	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(12.002)	
						<b>EUR</b>	<b>(12.130)</b>
						<b>USD</b>	<b>(13.729)</b>

**BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD Z (Inc) (Hedged)**

US-Dollar	Euro	726.108	642.804	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.413)	
						<b>EUR</b>	<b>(1.413)</b>
						<b>USD</b>	<b>(1.599)</b>

# BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Guernsey - 256.829</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
72.541	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	89.392	0,12	
124.452	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	167.437	0,21	
<b>Irland - 357.694</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
4.062	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	357.694	0,46	
<b>Jersey - 1.638.289</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
31.606	Wisdomtree Carbon	866.953	1,11	
22.260	WisdomTree Copper - ETF	771.336	0,98	
<b>Vereinigtes Königreich - 827.999</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 474.230)</b>				
150.703	Aquila European Renewables Income Fund Plc/The Fund	153.717	0,19	
185.427	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	287.556	0,37	
456.429	US Solar Fund Plc/Fund	386.726	0,49	
<b>Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		<b>3.080.811</b>	<b>3,93</b>	
<b>Anleihen</b>				
<b>Kaiman-Inseln - 181.075</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 173.921)</b>				
200.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027	181.075	0,23	
<b>Frankreich - 199.086</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 99.239)</b>				
200.000	Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026	199.086	0,25	
<b>Irland - 569.989</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 438.760)</b>				
200.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024	212.034	0,27	
300.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	357.955	0,46	
<b>Luxemburg - 208.972</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 212.086)</b>				
200.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	208.972	0,27	
<b>Spanien - 425.706</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 215.574)</b>				
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Mar-2024	215.696	0,27	
200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023	210.010	0,27	
<b>Vereinigtes Königreich - 701.771</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 765.579)</b>				
300.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	334.915	0,43	
200.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024	249.651	0,32	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	117.205	0,15	
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 41.129</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 105.433)</b>				
31.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	41.129	0,05	
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>2.327.728</b>	<b>2,97</b>	
<b>Aktien</b>				
<b>Bermudas - 137.998</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
1.248	Credicorp Ltd	137.998	0,18	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Aktien Forts.</b>				
<b>Kaiman-Inseln - 804.697</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.192.566)</b>				
15.030	Alibaba Group Holding Ltd	202.380	0,26	
8.020	Tencent Holdings Ltd	414.967	0,53	
30.934	Tencent Music Entertainment Group ADR	187.350	0,24	
<b>China - 1.490.124</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 674.348)</b>				
91.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	408.010	0,52	
31.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	370.414	0,47	
23.100	Sungrow Power Supply Co Ltd	466.904	0,60	
6.900	Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	244.796	0,31	
<b>Zypern - 515.030</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
11.246	HeadHunter Group Plc ADR	515.030	0,66	
<b>Dänemark - 870.000</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 420.125)</b>				
1.077	Chr Hansen Holding A/S	74.640	0,10	
4.541	Novozymes A/S	329.239	0,42	
4.149	Orsted AS '144A'	466.121	0,59	
<b>Finnland - 301.801</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
6.970	Neste Oyj	301.801	0,38	
<b>Frankreich - 2.343.317</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.276.277)</b>				
24.042	Bureau Veritas SA	700.704	0,89	
3.696	Legrand SA	379.302	0,49	
1.631	L'oreal SA	683.511	0,87	
800	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	579.800	0,74	
<b>Deutschland - 1.615.206</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 410.737)</b>				
8.084	Continental AG	753.025	0,96	
4.859	Volkswagen AG - Preference	862.181	1,10	
<b>Hongkong - 1.065.040</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 695.802)</b>				
76.200	AIA Group Ltd	678.772	0,87	
49.700	Link REIT (Units) (REIT)	386.268	0,49	
<b>Ungarn - 99.207</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
2.207	OTP Bank Nyrt	99.207	0,13	
<b>Indien - 711.563</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 341.511)</b>				
12.447	HDFC Bank Ltd ADR	711.563	0,91	
<b>Indonesien - 125.927</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
277.800	Bank Central Asia Tbk PT	125.927	0,16	
<b>Irland - 3.499.984</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 1.588.135)</b>				
1.659	Accenture Plc - Class A	606.751	0,77	
173	Kerry Group Plc	19.730	0,02	
4.943	Linde Plc	1.503.906	1,92	
9.690	Medtronic Plc	894.603	1,14	
2.677	Trane Technologies Plc	474.994	0,61	
<b>Japan - 2.262.105</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 822.611)</b>				
6.400	Advantest Corp	535.385	0,68	
3.900	Ebara Corp	191.261	0,24	
8.300	Sony Group Corp	922.851	1,18	
48.100	Topcon Corp	612.608	0,78	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Jersey - 390.172</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 177.863)</b>			
2.503	Ferguson Plc	390.172	0,50
<b>Niederlande - 1.304.677</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 275.888)</b>			
1.347	ASML Holding NV	954.552	1,22
14.108	Universal Music Group NV	350.125	0,44
<b>Norwegen - 286.471</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
4.534	TOMRA Systems ASA	286.471	0,36
<b>Republik Korea - 532.005</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 306.391)</b>			
1.092	Samsung SDI Co Ltd	532.005	0,68
<b>Südafrika - 69.404</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 186.087)</b>			
506	Naspers Ltd	69.404	0,09
<b>Schweiz - 3.626.931</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.598.984)</b>			
9.479	Alcon Inc	740.705	0,95
3.186	Chubb Ltd	543.648	0,69
595	Lonza Group AG	438.572	0,56
6.062	Nestle SA	747.763	0,95
8.147	TE Connectivity Ltd	1.156.243	1,48
<b>Taiwan - 637.875</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 414.313)</b>			
55.000	Elite Material Co Ltd	489.144	0,62
3.000	Voltronic Power Technology Corp	148.731	0,19
<b>Vereinigtes Königreich - 11.898.698</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.387.454)</b>			
19.799	3i Group Plc	342.929	0,44
28.539	Ascential Plc	137.173	0,17
7.646	ASOS Plc	218.529	0,28
11.060	AstraZeneca Plc	1.134.772	1,45
136.036	Atrato Onsite Energy Plc	177.354	0,23
85.265	Barratt Developments Plc	758.339	0,97
19.824	Bodycote Plc	205.167	0,26
439.288	Harmony Energy Income Trust Plc	520.409	0,66
239.323	Hays Plc	419.292	0,53
391.350	Home Reit Plc (REIT)	599.908	0,77
13.673	IMI Plc	283.911	0,36
336.687	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	477.832	0,61
54.812	Informa Plc	334.915	0,43
194.840	National Express Group Plc	594.100	0,76
22.284	National Grid Plc	282.722	0,36
284.580	Pantheon Infrastructure Plc	355.767	0,45
16.783	Persimmon Plc	571.789	0,73
54.771	Prudential Plc	827.858	1,06
29.897	Relx Plc	851.616	1,09
150.711	Schroder Bsc Social Impact Trust Plc	187.514	0,24
59.552	Shaftesbury Plc (REIT)	434.639	0,55
199.464	Taylor Wimpey Plc	416.549	0,53
23.764	Travis Perkins Plc	445.062	0,57
12.848	Unilever Plc	601.608	0,77
160.450	Urban Logistics REIT Plc (REIT)	355.324	0,45
229.117	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	291.068	0,37
25.679	Wickes Group Plc	72.552	0,09
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 15.760.326</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.291.191)</b>			
5.703	Abbott Laboratories	710.475	0,91
443	Alphabet Inc - Class A	1.144.516	1,46
226	Amazon.com Inc	673.671	0,86
622	American Tower Corp (REIT)	160.016	0,20
16.004	Brixmor Property Group Inc (REIT)	357.946	0,46
6.514	CME Group Inc	1.315.720	1,68

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
<b>Aktien Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
2.770	Comerica Inc	212.978	0,27
3.714	Ecolab Inc	767.984	0,98
10.251	Elanco Animal Health Inc	259.886	0,33
930	Eli Lilly & Co	227.868	0,29
3.789	Eversource Energy	305.085	0,39
2.560	Fidelity National Information Services Inc	248.807	0,32
14.320	First Horizon Corp	207.174	0,26
1.993	Hubbell Inc - Class B	365.144	0,47
739	IDEXX Laboratories Inc	431.984	0,55
8.822	JPMorgan Chase & Co	1.234.893	1,57
10.268	KeyCorp	210.422	0,27
17.070	Laureate Education Inc - Class A	182.486	0,23
1.815	Mastercard Inc	579.113	0,74
3.417	Microsoft Corp	1.024.466	1,31
6.501	Morgan Stanley	567.448	0,72
5.591	NIKE Inc	827.424	1,05
2.930	Norfolk Southern Corp	763.001	0,97
11.368	Otis Worldwide Corp	867.628	1,11
1.798	salesforce.com Inc	405.572	0,52
1.283	Sherwin-Williams Co/The	397.199	0,51
1.479	Thermo Fisher Scientific Inc	869.870	1,11
2.039	Zoetis Inc	441.550	0,56
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>50.348.558</b>	<b>64,22</b>
<b>Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>			
<b>Guernsey - 2.469.415</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.356.101)</b>			
442.654	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	660.371	0,84
310.388	International Public Partnerships Ltd	627.132	0,80
171.119	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	214.535	0,27
605.891	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	967.377	1,24
<b>Luxemburg - 350.668</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 176.730)</b>			
167.535	BBGI Global Infrastructure SA	350.668	0,45
<b>Vereinigtes Königreich - 2.598.672</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.098.050)</b>			
642.240	BioPharma Credit Plc/The Fund	549.835	0,70
894.933	Greencoat UK Wind Plc/Funds	1.498.125	1,91
394.493	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	550.712	0,70
<b>Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente</b>		<b>5.418.755</b>	<b>6,91</b>
<b>Optionsscheine</b>			
<b>Luxemburg - 1.002.608</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
7.238	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	1.002.608	1,28
<b>Vereinigtes Königreich - 2.765.737</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.031.439)</b>			
15.177	Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	1.401.345	1,79
15.177	Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	1.364.392	1,74
<b>Gesamtanlagen in Optionsscheinen</b>		<b>3.768.345</b>	<b>4,81</b>
<b>Indexoptionen - 618.875</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 196.328)</b>			
18	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000	96.214	0,12
18	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000	423.501	0,54
185	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000	99.160	0,13
<b>Indexoptionen insgesamt</b>		<b>618.875</b>	<b>0,79</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 25.814</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 3.603)</b>				
7	Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022	1.546,141	25.814	0,03

**Offene Terminkontrakte insgesamt 25.814 0,03**

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 53.265 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 678.689) 53.265 0,07

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 65.642.151 83,73**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
<b>Indexoptionen - (431.344)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (91.148))</b>				
(18)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000		(61.386)	(0,08)
(18)	CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000		(307.058)	(0,39)
(185)	EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000		(62.900)	(0,08)

**Indexoptionen insgesamt (431.344) (0,55)**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (53.523)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>				
(13)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(2.740.612)	(53.523)	(0,07)

**Offene Terminkontrakte insgesamt (53.523) (0,07)**

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (993.467) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (204.318)) (993.467) (1,27)

**Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (1.478.334) (1,89)**

**Nettoumlaufvermögen 14.232.986 18,16**

**Summe Nettovermögen 78.396.803 100,00**

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

**Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	81,22
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,81
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,07
Sonstiges Umlaufvermögen	17,90
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund**

Euro	Pfund Sterling	300.216	252.194	14. Jan. 22	UBS AG	18
Euro	Pfund Sterling	6.423	5.395	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	1
Indische Rupie	US-Dollar	79.469.294	1.055.986	14. Jan. 22	State Street Bank	10.463
Pfund Sterling	Euro	404.774	475.023	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	6.798
Pfund Sterling	Euro	87.971	103.354	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	1.361
Euro	Japanischer Yen	37.891	4.867.500	18. Feb. 22	State Street Bank	555
Euro	Japanischer Yen	9.860	1.265.985	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	149
Euro	Japanischer Yen	552.994	71.428.046	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	5.106
Euro	US-Dollar	17.871	20.193	18. Feb. 22	State Street Bank	47
Euro	US-Dollar	102.863	116.315	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	190
Hongkong-Dollar	Euro	960.613	108.612	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	131
Schweizer Franken	Euro	34.559	33.007	18. Feb. 22	State Street Bank	445
Schweizer Franken	Euro	81.756	77.928	18. Feb. 22	State Street Bank	1.207
Schweizer Franken	Euro	53.375	50.931	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	733
Schweizer Franken	Euro	87.596	83.649	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	1.139
Schweizer Franken	Euro	158.133	151.074	18. Feb. 22	State Street Bank	1.990
Schweizer Franken	Euro	58.405	55.470	18. Feb. 22	State Street Bank	1.063
Schweizer Franken	Euro	105.424	100.027	18. Feb. 22	State Street Bank	2.018
Schweizer Franken	Euro	59.156	56.187	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	1.073
Schweizer Franken	Euro	51.301	48.599	18. Feb. 22	State Street Bank	1.057
Schweizer Franken	Euro	70.671	67.036	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	1.369
Schweizer Franken	Euro	60.536	57.369	18. Feb. 22	State Street Bank	1.226
Schweizer Franken	Euro	59.912	56.644	18. Feb. 22	State Street Bank	1.348
Schweizer Franken	Euro	60.372	57.063	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	1.374
Schweizer Franken	Euro	125.650	119.587	18. Feb. 22	State Street Bank	2.036
Schweizer Franken	Euro	103.485	99.057	18. Feb. 22	State Street Bank	1.111
US-Dollar	Euro	332.063	291.176	18. Feb. 22	State Street Bank	1.941

**EUR 45.949**

Euro	Pfund Sterling	139.845	119.073	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(1.893)
Euro	Pfund Sterling	297.864	254.166	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(4.681)
Euro	Pfund Sterling	87.908	74.743	14. Jan. 22	State Street Bank	(1.062)
Euro	Pfund Sterling	227.670	193.887	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(3.123)
Euro	Pfund Sterling	14.253	12.113	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(165)
Euro	Pfund Sterling	13.280	11.301	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(172)
Euro	Pfund Sterling	7.223	6.143	14. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(89)
Euro	Pfund Sterling	14.658.225	12.510.429	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(233.503)
Euro	Pfund Sterling	57.857	48.621	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(18)
Euro	Pfund Sterling	79.432	66.787	14. Jan. 22	State Street Bank	(67)
Euro	Pfund Sterling	12.243	10.315	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(36)
Euro	Pfund Sterling	16.443	13.930	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(138)
Euro	Pfund Sterling	45.531	38.601	14. Jan. 22	Canadian Imperial Bank	(418)
Euro	Pfund Sterling	56.796	48.361	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(770)
Euro	Pfund Sterling	315.948	269.390	14. Jan. 22	State Street Bank	(4.719)
Euro	Pfund Sterling	34.761	29.307	14. Jan. 22	State Street Bank	(124)
Euro	Pfund Sterling	495.240	424.827	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(10.451)
Schwedische Krone	Euro	9.925.008	978.654	14. Jan. 22	Royal Bank of Scotland	(11.023)
US-Dollar	Indische Rupie	209.729	15.963.334	14. Jan. 22	State Street Bank	(4.214)
US-Dollar	Indische Rupie	839.904	63.505.960	14. Jan. 22	State Street Bank	(11.861)
Australischer Dollar	US-Dollar	1.283.366	950.647	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(17.738)
Euro	Hongkong-Dollar	2.223.662	20.069.646	18. Feb. 22	Citigroup Global Markets Limited	(48.257)
Euro	Japanischer Yen	2.101.138	275.910.236	18. Feb. 22	State Street Bank	(15.225)
Euro	Schweizer Franken	169.064	175.906	18. Feb. 22	State Street Bank	(1.202)
Euro	Schweizer Franken	130.974	136.163	18. Feb. 22	State Street Bank	(823)
Euro	Schweizer Franken	2.503.560	2.648.819	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(60.342)
Euro	US-Dollar	164.455	187.214	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(802)
Euro	US-Dollar	6.727	7.650	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(26)
Euro	US-Dollar	25.210	28.574	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(13)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Forts.</b>						
Euro	US-Dollar	153.548	174.610	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(584)
Euro	US-Dollar	79.344	91.054	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(1.031)
Euro	US-Dollar	150.788	172.963	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(1.889)
Euro	US-Dollar	15.753	18.080	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(207)
Euro	US-Dollar	21.162	24.555	18. Feb. 22	State Street Bank	(514)
Euro	US-Dollar	20.798.968	24.145.418	18. Feb. 22	Barclays Bank PLC	(514.555)
Euro	US-Dollar	45.367	51.438	18. Feb. 22	UBS AG	(39)
Hongkong-Dollar	Euro	165.413	18.728	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(3)
Hongkong-Dollar	Euro	238.322	26.989	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(10)
Hongkong-Dollar	Euro	262.226	29.812	18. Feb. 22	Royal Bank of Scotland	(127)
Hongkong-Dollar	Euro	583.896	66.181	18. Feb. 22	Canadian Imperial Bank	(83)
Ungarischer Forint	Euro	507.885.652	1.402.120	18. Feb. 22	State Street Bank	(35.982)
Japanischer Yen	Euro	15.686.208	122.412	18. Feb. 22	State Street Bank	(2.091)
						<b>EUR (990.070)</b>

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	Euro	2.432	2.890	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5
Pfund Sterling	Euro	1.759	2.084	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
Pfund Sterling	Euro	312.568	365.209	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.855
Pfund Sterling	Euro	2.233	2.630	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	28
						<b>EUR 6.897</b>
						<b>GBP 5.793</b>
Euro	Pfund Sterling	4.178	3.572	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(74)
Euro	Pfund Sterling	3.116	2.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(46)
						<b>EUR (120)</b>
						<b>GBP (101)</b>

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	Euro	103	123	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	Euro	75	89	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	Euro	13.278	15.514	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	291
Pfund Sterling	Euro	95	112	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
						<b>EUR 292</b>
						<b>GBP 245</b>
Euro	Pfund Sterling	177	152	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	Pfund Sterling	132	113	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2)
						<b>EUR (5)</b>
						<b>GBP (4)</b>

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	15.274	12.268	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	21
Euro	US-Dollar	11.818	13.331	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	42
US-Dollar	Euro	12.419	10.951	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	19

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged) Forts.</b>						
US-Dollar	Euro	11.530	10.176	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	9
						<b>EUR 91</b>
						<b>USD 103</b>
US-Dollar	Euro	9.003	7.956	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	1.579.650	1.398.422	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(3.074)
						<b>EUR (3.077)</b>
						<b>USD (3.483)</b>

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	21.663	24.487	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	28
Euro	US-Dollar	695	786	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	487	550	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Euro	681	600	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Euro	494	437	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	7.280	6.426	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4
US-Dollar	Euro	613	541	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
						<b>EUR 36</b>
						<b>USD 41</b>
US-Dollar	Euro	24.487	21.660	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Euro	57.550	50.948	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(112)
US-Dollar	Euro	8.442	7.477	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Euro	8.670	7.688	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Euro	4.707	4.162	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(5)
						<b>EUR (195)</b>
						<b>USD (221)</b>

# BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Belgien - 150.744</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 388.766)</b>			
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040	150.744	0,16
<b>Brasilien - 756.534</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 663.809)</b>			
200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	233.431	0,26
200.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	191.576	0,21
300.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	287.364	0,31
38.000	Vale Overseas Ltd 6.250% 10-Aug-2026	44.163	0,05
<b>Kanada - 879.265</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 493.810)</b>			
140.000	Canadian Government Bond 1.250% 01-Jun-2030	108.913	0,12
280.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0.450% 22-Jun-2023	278.215	0,30
65.000	Nutrien Ltd 1.900% 13-May-2023	65.851	0,07
425.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 0.530% 27-Jan-2023	426.286	0,47
<b>Kaiman-Inseln - 2.850.497</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.550.000)</b>			
475.000	AIMCO CLO Series 2017-A '2017-AXAR' FRN 1.182% 20-Apr-2034	475.356	0,52
450.000	Allegro CLO XII Ltd '2020-1X B' FRN 1.830% 21-Jan-2032	450.355	0,49
450.000	Bain Capital Credit CLO 2020-5 Ltd '2020-5X B1' FRN 1.682% 20-Jan-2032	449.063	0,49
475.000	Invesco CLO Ltd '2021-1X A1' FRN 1.124% 15-Apr-2034	475.063	0,52
250.000	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 40 Ltd '2021- 40X A' FRN 1.182% 16-Apr-2033	250.348	0,27
350.000	RIN IV Ltd '2021-1X A' FRN 1.432% 20-Apr-2033	349.685	0,38
400.000	Symphony CLO XXIV Ltd '2020-24X A' FRN 1.324% 23-Jan-2032	400.627	0,44
<b>Chile - 207.364</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 469.449)</b>			
203.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028	207.364	0,23
<b>China - 221.938</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 884.468)</b>			
225.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031	221.938	0,24
<b>Kolumbien - 354.011</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
375.000	Ecopetrol SA 5.875% 02-Nov-2051	354.011	0,39
<b>Elfenbeinküste - 147.434</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 676.544)</b>			
135.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	147.434	0,16
<b>Ägypten - 207.501</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 697.477)</b>			
225.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033	207.501	0,23
<b>Frankreich - 2.920.424</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.823.201)</b>			
250.000	Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040	318.015	0,35
475.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN 4.375% 01-Mar-2033	515.662	0,56
250.000	Credit Agricole SA 'REGS' 3.250% 14-Jan-2030	259.151	0,28
400.000	Electricité de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Dec-2027	457.268	0,50
100.000	Engie SA 'EMTN' 1.750% 27-Mar-2028	122.183	0,13
100.000	Orange SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2032	123.520	0,13
100.000	Orano SA 'EMTN' 4.875% 23-Sep-2024	125.886	0,14
500.000	Sanofi 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030	617.784	0,68

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Frankreich Forts.</b>			
300.000	TotalEnergies Capital International SA 'EMTN' 1.994% 08-Apr-2032	380.955	0,42
<b>Deutschland - 12.647.302</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 10.037.598)</b>			
4.225.000	Bundessobligation 0.000% 05-Apr-2024	4.857.146	5,31
750.000	Bundessobligation 0.000% 10-Oct-2025	868.158	0,95
3.550.000	Bundessobligation 0.000% 10-Apr-2026	4.105.140	4,48
2.250.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	2.590.122	2,83
200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0.250% 20-Feb-2029	226.736	0,25
<b>Ghana - 183.429</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
225.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034	183.429	0,20
<b>Ungarn - 348.077</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 777.993)</b>			
225.000	Hungary Government International Bond 1.625% 28-Apr-2032	266.198	0,29
50.000	Hungary Government International Bond 7.625% 29-Mar-2041	81.879	0,09
<b>Indonesien - 434.327</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 484.752)</b>			
400.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 1.875% 05-Nov-2031	434.327	0,47
<b>Irland - 578.681</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 362.735)</b>			
570.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.000% 29-Oct-2028	578.681	0,63
<b>Italien - 3.752.041</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.547.029)</b>			
400.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 17-Jun-2027	451.137	0,49
2.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022	3.300.904	3,61
<b>Japan - 1.509.401</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 174.711)</b>			
167.500.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	1.356.223	1,48
125.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.000% 09-Jul-2040	153.178	0,17
<b>Kuwait - 200.754</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>			
200.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	200.754	0,22
<b>Mexiko - 4.465.671</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.709.248)</b>			
700.000	Alsea SAB de CV 'REGS' 7.750% 14-Dec-2026	725.322	0,79
150.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	164.160	0,18
200.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	201.080	0,22
57.500.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	2.845.846	3,11
523.000	Petroleos Mexicanos 6.700% 16-Feb-2032	529.263	0,58
<b>Niederlande - 639.784</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 828.181)</b>			
200.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 3.000% 11-Apr-2028	234.463	0,26
325.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 1.875% 07-Apr-2032	405.321	0,44
<b>Philippinen - 591.658</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.109.890)</b>			
350.000	Philippine Government International Bond 0.000% 03-Feb-2023	395.450	0,43



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Philippinen Forts.</b>			
175.000	Philippine Government International Bond 0.700% 03-Feb-2029	196.208	0,22
<b>Katar - 471.144</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 530.249)</b>		<b>471.144</b>	<b>0,51</b>
475.000	Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	471.144	0,51
<b>Republik Korea - 1.031.512</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>1.031.512</b>	<b>1,13</b>
1.349.400.000	Korea Treasury Bond 1.875% 10-Mar-2051	1.031.512	1,13
<b>Republik Serbien - 496.912</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 716.795)</b>		<b>496.912</b>	<b>0,54</b>
275.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	285.448	0,31
175.000	Serbia International Bond 'REGS' 3.125% 15-May-2027	211.464	0,23
<b>Rumänien - 285.433</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 638.292)</b>		<b>285.433</b>	<b>0,31</b>
100.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.750% 14-Apr-2041	101.242	0,11
150.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	184.191	0,20
<b>Russland - 1.451.277</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.385.813)</b>		<b>1.451.277</b>	<b>1,59</b>
113.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030	1.451.277	1,59
<b>Senegal - 268.829</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 224.595)</b>		<b>268.829</b>	<b>0,29</b>
250.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 5.375% 08-Jun-2037	268.829	0,29
<b>Südafrika - 205.174</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 1.769.294)</b>		<b>205.174</b>	<b>0,22</b>
175.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026	205.174	0,22
<b>Spanien - 1.306.577</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 2.124.063)</b>		<b>1.306.577</b>	<b>1,43</b>
100.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0.550% 30-Apr-2030	114.139	0,13
300.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 0.875% 16-Jun-2025	349.419	0,38
275.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	317.886	0,35
400.000	Repsol International Finance BV 'EMTN' 2.625% 15-Apr-2030	525.133	0,57
<b>Supranational - 658.342</b>			
<b>(31. Dezember 2020: -)</b>		<b>658.342</b>	<b>0,72</b>
200.000	Africa Finance Corp 'REGS' 2.875% 28-Apr-2028	198.730	0,22
450.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031	459.612	0,50
<b>Vereinigte Arabische Emirate - 421.836</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 428.718)</b>		<b>421.836</b>	<b>0,46</b>
200.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2.125% 30-Sep-2024	204.935	0,22
200.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	216.901	0,24
<b>Vereinigtes Königreich - 5.834.577</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 3.659.763)</b>		<b>5.834.577</b>	<b>6,38</b>
80.000	Astrazeneca Finance LLC 2.250% 28-May-2031	80.648	0,09
150.000	AstraZeneca Plc 3.000% 28-May-2051	157.175	0,17
375.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030	442.851	0,48
375.000	BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032	501.935	0,55
325.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029	396.084	0,43
241.056	Brass No 10 Plc FRN 0.669% 16-Apr-2069	239.927	0,26
400.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	444.256	0,49

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
352.150	Gemgarto 2021-1 Plc '2021-1X A' FRN 0.639% 16-Dec-2067	475.178	0,52
400.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	445.981	0,49
180.000	Unilever Finance Netherlands BV 1.750% 25-Mar-2030	224.770	0,25
1.925.000	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	2.425.772	2,65
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 44.439.072</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 40.207.176)</b>		<b>44.439.072</b>	<b>48,56</b>
400.000	7-Eleven Inc 'REGS' 2.800% 10-Feb-2051	370.863	0,41
225.000	Air Lease Corp 3.375% 01-Jul-2025	234.973	0,26
130.000	Air Lease Corp 'MTN' 2.875% 15-Jan-2026	134.211	0,15
120.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	135.474	0,15
300.000	Ally Financial Inc FRN (Perpetual) 4.700% 15-May-2026	312.187	0,34
100.000	AT&T Inc 2.050% 19-May-2032	123.155	0,13
100.000	AT&T Inc 2.350% 05-Sep-2029	126.073	0,14
425.000	AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031	433.130	0,47
175.000	Bank of America Corp FRN 3.366% 23-Jan-2026	184.234	0,20
135.000	Bank of America Corp FRN (Perpetual) 5.125% 20-Jun-2024	141.328	0,15
140.000	Bank of America Corp FRN (Perpetual) 6.250% 05-Sep-2024	150.762	0,16
200.000	Berkshire Hathaway Inc 0.000% 12-Mar-2025	226.119	0,25
125.000	Berry Global Inc 1.570% 15-Jan-2026	122.329	0,13
225.000	Cameron LNG LLC 'REGS' 2.902% 15-Jul-2031	234.543	0,26
475.000	Capital One Financial Corp FRN 2.359% 29-Jul-2032	450.188	0,49
155.000	Carrier Global Corp 2.493% 15-Feb-2027	159.352	0,17
50.000	Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030	51.118	0,06
375.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 15-Aug-2030	386.719	0,42
79.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS' 4.500% 15-Aug-2030	81.054	0,09
135.000	Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030	137.259	0,15
85.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	87.054	0,10
40.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	40.967	0,04
125.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	133.180	0,15
170.000	Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031	178.744	0,20
200.000	CIT Group Inc 6.125% 09-Mar-2028	241.776	0,26
400.000	Citigroup Inc FRN (Perpetual) 4.000% 10-Dec-2025	404.000	0,44
150.000	Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032	169.205	0,19
135.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	138.553	0,15
225.000	CVS Health Corp 2.625% 15-Aug-2024	233.102	0,25
315.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 1.450% 22-Jan-2027	362.926	0,40
100.000	Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030	129.758	0,14
200.000	DataBank Issuer '2021-1X A2' 2.060% 27-Feb-2051	196.659	0,21
490.000	DaVita Inc 'REGS' 3.750% 15-Feb-2031	476.525	0,52
200.000	Dell International LLC / EMC Corp 6.020% 15-Jun-2026	231.247	0,25
250.000	Diamondback Energy Inc 3.125% 24-Mar-2031	257.882	0,28
225.000	Diamondback Energy Inc 3.250% 01-Dec-2026	237.385	0,26
200.000	Digital Dutch Finco BV 1.500% 15-Mar-2030	235.014	0,26
425.000	Edison International 3.550% 15-Nov-2024	446.440	0,49
365.000	Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028	426.338	0,47
175.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	181.265	0,20
175.000	Energy Transfer LP 4.000% 01-Oct-2027	188.189	0,21
65.000	Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049	84.415	0,09
225.000	Energy Transfer LP FRN (Perpetual) 6.250% 15-Feb-2023	196.045	0,21
175.000	Enterprise Products Operating LLC 2.800% 31-Jan-2030	182.820	0,20
235.000	EQT Corp 3.000% 01-Oct-2022	237.382	0,26
475.000	EQT Corp 'REGS' 3.125% 15-May-2026	488.188	0,53
180.000	Exelon Generation Co LLC 3.250% 01-Jun-2025	189.036	0,21
70.000	Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040	82.555	0,09
1.350.000	Fannie Mae or Freddie Mac '2.0 / 1/2' TBA 2.000% 31-Dec-2049	1.380.533	1,51
1.875.000	Fannie Mae or Freddie Mac '2.0 / 1/2' TBA 2.000% 31-Dec-2049	1.865.405	2,04

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
2.250.000	Fannie Mae or Freddie Mac '2.5 1/22' TBA 2.500% 31-Dec-2049	2.292.187	2,50
1.600.000	Fannie Mae or Freddie Mac '3.0 1/22' TBA 3.000% 31-Dec-2049	1.654.687	1,81
406.861	Fannie Mae Pool 'BQ7549' 2.000% 01-Nov-2050	405.533	0,44
250.000	First Republic Bank/CA 'BKNT' FRN 1.912% 12-Feb-2024	253.082	0,28
225.000	Florida Power & Light Co 2.850% 01-Apr-2025	235.503	0,26
425.000	Ford Credit Auto Lease Trust 2020-A '2020-A B' 2.050% 15-Jun-2023	428.167	0,47
150.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	154.050	0,17
175.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	193.686	0,21
382.981	Freddie Mac Pool 'QB6059' 2.000% 01-Dec-2050	381.480	0,42
685.723	Freddie Mac Pool 'RA3605' 2.500% 01-Oct-2050	700.204	0,77
281.190	Freddie Mac REMICS 4.000% 15-Mar-2036	297.205	0,32
225.000	General Electric Co FRN (Perpetual) 3.533% 15-Mar-2022	223.875	0,24
200.000	General Motors Co 5.400% 02-Oct-2023	214.172	0,23
200.000	GLP Capital LP / GLP Financing III Inc 5.375% 15-Apr-2026	222.974	0,24
225.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 16-Nov-2026	239.978	0,26
128.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	134.932	0,15
275.000	HCA Inc 5.875% 01-Feb-2029	328.119	0,36
225.000	Healthcare Trust of America Holdings LP 3.500% 01-Aug-2026	240.155	0,26
225.000	Hewlett Packard Enterprise Co 2.250% 01-Apr-2023	228.482	0,25
325.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2032	323.680	0,35
475.000	JBS Finance Luxembourg Sarl 'REGS' 3.625% 15-Jan-2032	477.608	0,52
350.000	John Deere Cash Management SARL 'EMTN' 2.200% 02-Apr-2032	458.414	0,50
144.000	JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 5.000% 01-Aug-2024	147.690	0,16
250.000	Keurig Dr Pepper Inc 0.750% 15-Mar-2024	248.223	0,27
225.000	KeyCorp 'MTN' 2.250% 06-Apr-2027	228.664	0,25
55.000	Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-May-2027	59.556	0,07
40.000	Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049	50.131	0,05
200.000	Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049	250.654	0,27
155.000	Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027	175.841	0,19
45.000	Lennar Corp 5.250% 01-Jun-2026	50.519	0,06
35.000	Level 3 Financing Inc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2029	33.569	0,04
410.000	Level 3 Financing Inc 'REGS' 4.250% 01-Jul-2028	409.738	0,45
200.000	Marathon Petroleum Corp 3.625% 15-Sep-2024	210.602	0,23
14.000	Marriott International Inc/MD 5.750% 01-May-2025	15.754	0,02
325.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.750% 14-Mar-2026	353.017	0,39
50.000	Mastercard Inc 3.300% 26-Mar-2027	54.069	0,06
100.000	Mastercard Inc 3.350% 26-Mar-2030	110.121	0,12
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032	113.322	0,12
365.000	MetLife Inc 6.400% 15-Dec-2036	449.680	0,49
100.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01-May-2024	106.998	0,12
200.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.750% 01-Feb-2027	225.736	0,25
134.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 'REGS' 3.875% 15-Feb-2029	141.412	0,15
425.000	Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033	481.782	0,53
425.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 0.749% 20-Jan-2023	425.075	0,46
625.000	Mozart Debt Merger Sub Inc 'REGS' 3.875% 01-Apr-2029	623.125	0,68
325.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026	366.540	0,40
475.000	NRG Energy Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2031	463.937	0,51
350.000	Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025	387.329	0,42
75.000	Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030	101.379	0,11
120.000	Pioneer Natural Resources Co 0.550% 15-May-2023	119.572	0,13
90.000	Pioneer Natural Resources Co 1.900% 15-Aug-2030	85.579	0,09
115.000	Prologis LP 2.250% 15-Apr-2030	115.710	0,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
425.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	442.324	0,48
180.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc 'REGS' 3.625% 01-Mar-2029	180.708	0,20
465.000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2021-3 '2021-3 C' 0.950% 15-Sep-2027	460.871	0,50
55.000	SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025	57.739	0,06
170.000	Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081	186.931	0,20
125.000	Spirit Realty LP 3.200% 15-Feb-2031	129.352	0,14
75.000	Spirit Realty LP 4.000% 15-Jul-2029	82.472	0,09
162.500	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 'REGS' 4.738% 20-Mar-2025	170.229	0,19
200.000	Stellantis Finance US Inc 'REGS' 2.691% 15-Sep-2031	196.890	0,22
235.000	Taylor Morrison Communities Inc 'REGS' 5.125% 01-Aug-2030	261.174	0,29
175.000	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2025	185.645	0,20
115.000	T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027	124.553	0,14
130.000	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	137.050	0,15
400.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	412.926	0,45
2.900.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	2.899.430	3,17
4.300.000	United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	4.270.102	4,67
1.100.000	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Aug-2051-	1.117.961	1,22
500.000	Verizon Communications Inc 2.100% 22-Mar-2028	501.450	0,55
100.000	Verizon Communications Inc 3.150% 22-Mar-2030	105.907	0,12
50.000	Verizon Communications Inc 4.016% 03-Dec-2029	56.000	0,06
129.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 3.500% 15-Feb-2025	131.701	0,14
325.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 4.250% 01-Dec-2026	338.691	0,37
175.000	Visa Inc 1.900% 15-Apr-2027	177.387	0,19
90.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Dec-2030	99.270	0,11
450.000	World Omni Automobile Lease Securitization Trust 2021-A '2021-A B' 0.750% 16-Nov-2026	444.983	0,49
300.000	WPC Eurobond BV 2.250% 19-Jul-2024	356.837	0,39
300.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	319.333	0,35

**Gesamtanlagen in Anleihen 90.917.522 99,34**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 470.392</b>				
<b>(31. Dezember 2020: 151.689)</b>				
(60)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(9.048.465)	64.441	0,07
(15)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(3.509.981)	185.724	0,20
(39)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(4.945.247)	7.251	0,01
(4)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(5.267.199)	14.927	0,02
195	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	16.137.982	22.636	0,02
(5)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.090.625)	757	0,00
(7)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.368.938)	4.538	0,00
(80)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(13.466.306)	170.118	0,19
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>470.392</b>	<b>0,51</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.951.732 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.763.033)			1.951.732	2,13
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>93.339.646</b>	<b>101,98</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (122.825)</b>				
<b>(31. Dezember 2020: (48.837))</b>				
(1)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(111.777)	(2.671)	(0,00)
5	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022	969.826	(5.673)	(0,01)
22	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022	2.219.720	(5.381)	(0,01)
(94)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(12.258.187)	(31.023)	(0,03)
(117)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(14.146.031)	(48.914)	(0,05)
(51)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(8.153.625)	(29.163)	(0,03)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(122.825)</b>	<b>(0,13)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (162.053) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (332.738))			(162.053)	(0,17)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(284.878)</b>	<b>(0,30)</b>
<b>Kurzfristige Nettoverbindlichkeiten</b>			<b>(1.531.655)</b>	<b>(1,68)</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>91.523.113</b>	<b>100,00</b>

- Ein Teil der Beteiligung wird von Goldman Sachs als Sicherheit in Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Devisenterminkontrakten gehalten. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	91,28
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,47
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,96
Sonstiges Umlaufvermögen	6,29
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	US-Dollar	60.000	43.444	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC		61
Kanadischer Dollar	US-Dollar	140.000	109.106	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank		802
US-Dollar	Japanischer Yen	1.381.391	158.509.752	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank		4.018
Indische Rupie	US-Dollar	28.030.000	367.698	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited		6.148
Mexikanischer Peso	US-Dollar	1.693.801	80.331	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		1.505
US-Dollar	Ungarischer Forint	220.793	72.420.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		733
US-Dollar	Koreanischer Won	1.050.105	1.235.690.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		11.804
US-Dollar	Koreanischer Won	35.964	42.790.000	16. Mrz. 22	Goldman Sachs		9
US-Dollar	Russischer Rubel	1.483.404	111.730.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		12.612
US-Dollar	Taiwan-Dollar	381.918	10.510.000	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		369
<b>USD</b>							<b>38.061</b>
US-Dollar	Euro	33.676.386	29.740.000	16. Feb. 22	JPMorgan Chase Bank		(13.850)
US-Dollar	Euro	237.618	210.000	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC		(276)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.038.352	2.265.000	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC		(13.500)
US-Dollar	Schwedische Krone	217.822	1.980.000	16. Feb. 22	Barclays Bank PLC		(769)
Ungarischer Forint	US-Dollar	72.420.000	220.921	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		(861)
US-Dollar	Indische Rupie	504.184	38.560.000	16. Mrz. 22	Citigroup Global Markets Limited		(10.104)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	2.865.261	61.843.801	16. Mrz. 22	Barclays Bank PLC		(122.693)
<b>USD</b>							<b>(162.053)</b>

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	67.735.570	89.364.687	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon		1.913.671
<b>USD</b>							<b>1.913.671</b>
<b>GBP</b>							<b>1.420.059</b>

# BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Aktien</b>			
<b>Irland - 6.783.855</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 7.874.711)</b>		<b>6.783.855</b>	<b>2,28</b>
65.573	Medtronic Plc	6.783.855	2,28
<b>Schweiz - 5.483.006</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.608.112)</b>		<b>5.483.006</b>	<b>1,84</b>
28.366	Chubb Ltd	5.483.006	1,84
<b>Vereinigtes Königreich - 9.364.482</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 5.536.118)</b>		<b>9.364.482</b>	<b>3,15</b>
319.759	Vodafone Group Plc ADR	4.772.403	1,61
19.331	Willis Towers Watson Plc	4.592.079	1,54
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 259.142.915</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 200.224.743)</b>		<b>259.142.915</b>	<b>87,03</b>
104.167	AbbVie Inc	14.104.733	4,74
163.161	AES Corp/The	3.965.628	1,33
16.935	Ameriprise Financial Inc	5.108.527	1,72
20.598	Applied Materials Inc	3.240.992	1,09
43.643	Assurant Inc	6.802.416	2,28
126.440	Bank of America Corp	5.624.683	1,89
105.689	CF Industries Holdings Inc	7.480.139	2,51
64.351	Charles Schwab Corp/The	5.409.989	1,82
172.411	Cisco Systems Inc/Delaware	10.926.547	3,67
136.747	Clearway Energy Inc	4.927.678	1,66
12.906	CME Group Inc	2.949.086	0,99
94.698	Comcast Corp	4.768.044	1,60
51.492	Comerica Inc	4.478.774	1,50
29.448	ConocoPhillips	2.125.704	0,71
74.094	Corning Inc	2.758.890	0,93
98.664	CVS Health Corp	10.176.698	3,42
165.588	Devon Energy Corp	7.293.323	2,45
20.168	Eaton Corp Plc	3.486.341	1,17
13.520	Eli Lilly & Co	3.732.940	1,25
140.746	EQT Corp	3.071.781	1,03
218.313	Exelon Corp	12.618.491	4,24
84.113	Exxon Mobil Corp	5.146.454	1,73
122.628	Freeport-McMoRan Inc	5.116.653	1,72
70.288	General Motors Co	4.120.283	1,38
38.626	Hess Corp	2.859.483	0,96
25.282	Hubbell Inc - Class B	5.267.125	1,77
119.928	International Game Technology Plc	3.467.718	1,16
65.268	JPMorgan Chase & Co	10.334.209	3,47
24.287	L3Harris Technologies Inc	5.179.081	1,74
120.453	Marathon Petroleum Corp	7.707.185	2,59
213.287	Medical Properties Trust Inc (REIT)	5.038.905	1,69
50.328	Merck & Co Inc	3.857.390	1,30
92.375	Morgan Stanley	9.065.683	3,04
95.779	Newell Brands Inc	2.091.335	0,70
67.765	NextEra Energy Partners LP (Units)	5.720.383	1,92
14.293	Norfolk Southern Corp	4.255.312	1,43
14.143	Northrop Grumman Corp	5.474.897	1,84
114.339	Organon & Co	3.481.623	1,17
13.328	PepsiCo Inc	2.315.340	0,78
26.114	Philip Morris International Inc	2.480.961	0,83
37.706	QUALCOMM Inc	6.898.124	2,32
44.774	State Street Corp	4.163.758	1,40
19.309	UnitedHealth Group Inc	9.696.787	3,26
202.766	US Bancorp	11.388.352	3,82
190.917	Vistra Corp	4.348.135	1,46
69.586	Voya Financial Inc	4.616.335	1,55
<b>Gesamtanlagen in Aktien</b>		<b>280.774.258</b>	<b>94,30</b>

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
<b>Vorzugsanleihen</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 3.992.998</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 4.225.889)</b>		<b>3.992.998</b>	<b>1,34</b>
75.711	Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	3.992.998	1,34
<b>Gesamtanlagen in Vorzugsanleihen</b>		<b>3.992.998</b>	<b>1,34</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 53.880 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 36.670)		53.880	0,02
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>284.821.136</b>	<b>95,66</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.338) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (10.554))		(1.338)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(1.338)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>12.932.671</b>	<b>4,34</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>297.752.469</b>	<b>100,00</b>

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,56
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,02
Sonstiges Umlaufvermögen	4,42
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

<b>Devisenterminkontrakte</b>						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)</b>						
Pfund Sterling	US-Dollar	22.778	30.782	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	48
Pfund Sterling	US-Dollar	1.623.145	2.144.289	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	52.665
Pfund Sterling	US-Dollar	8.439	11.318	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	104
Pfund Sterling	US-Dollar	13.117	17.590	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	165
Pfund Sterling	US-Dollar	31.390	41.842	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	645
Pfund Sterling	US-Dollar	12.697	16.933	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	253
<b>USD</b>						<b>53.880</b>
<b>GBP</b>						<b>39.806</b>
US-Dollar	Pfund Sterling	27.079	20.446	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(595)
US-Dollar	Pfund Sterling	21.739	16.437	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(508)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.799	8.152	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(235)
<b>USD</b>						<b>(1.338)</b>
<b>GBP</b>						<b>(989)</b>

# BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Fördermittel - 35.496.142</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 21.168.688)</b>			
7.240.000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031	7.591.502	0,75
11.450.000	Massachusetts School Building Authority 3.395% 15-Oct-2040	11.990.726	1,19
2.110.000	New Jersey Economic Development Authority 3.620% 15-Jun-2028	2.274.717	0,23
3.500.000	Pasco County School Board 5.000% 01-Aug-2035	4.511.622	0,45
7.395.000	Providence Public Building Authority 5.000% 15-Sep-2039	9.127.575	0,91
<b>Anleihebank - 28.433.730</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 8.975.967)</b>			
9.890.000	Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034	10.102.585	1,00
8.000.000	Indianapolis Local Public Improvement Bond Bank 4,000% 01-Jun-2040	9.542.200	0,95
1.000.000	Low Income Investment Fund 3.711% 01-Jul-2029	1.065.190	0,11
3.000.000	Michigan Finance Authority 2.366% 01-Sep-2049	3.054.510	0,30
4.500.000	Michigan Finance Authority 2.988% 01-Sep-2049	4.669.245	0,46
<b>Dedicated Tax - 163.839.058</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 80.021.955)</b>			
4.000.000	Alabama Federal Aid Highway Finance Authority 1.856% 01-Sep-2029	4.006.160	0,40
1.000.000	Atlanta & Fulton County Recreation Authority 3.379% 15-Dec-2027	1.091.155	0,11
1.330.000	Brentwood Infrastructure Financing Authority 3.478% 02-Sep-2025	1.421.384	0,14
8.750.000	California Community Choice Financing Authority 4,000% 01-Feb-2052	10.637.594	1,06
3.000.000	Camden County Improvement Authority/The 5,000% 01-Jul-2033	3.886.710	0,39
1.000.000	City of Fort Worth TX 3.755% 01-Mar-2030	1.043.925	0,10
2.740.000	District of Columbia 4.996% 01-Dec-2026	3.190.415	0,32
5.000.000	Inland Valley Development Agency 5.500% 01-Mar-2033	5.436.725	0,54
1.000.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,021% 01-Dec-2029	1.092.140	0,11
1.250.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,121% 01-Dec-2030	1.371.356	0,14
1.840.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,171% 01-Dec-2031	2.023.154	0,20
750.000	Maryland Economic Development Corp 4.580% 01-Jun-2033	771.109	0,08
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 4.790% 01-Jun-2038	1.031.740	0,10
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 5.050% 01-Jun-2043	1.032.600	0,10
1.000.000	Metropolitan Transportation Authority 5.989% 15-Nov-2030	1.245.365	0,12
2.825.000	Missouri Highway & Transportation Commission 5,445% 01-May-2033	3.553.695	0,35
2.000.000	Nassau County Interim Finance Authority 1.459% 15-Nov-2029	1.950.100	0,19
5.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.400% 01-Aug-2025	5.179.825	0,51
1.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3,080% 01-Feb-2026	1.063.355	0,11
3.235.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4,000% 01-Feb-2040	3.865.210	0,38
2.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4,000% 01-Feb-2041	2.384.100	0,24
1.470.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4,000% 01-Feb-2042	1.747.911	0,17
6.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4,000% 01-May-2043	7.017.270	0,70
10.000.000	New York State Urban Development Corp 2.840% 15-Mar-2032	10.370.250	1,03
5.000.000	New York State Urban Development Corp 2.970% 15-Mar-2034	5.193.675	0,52
3.500.000	New York State Urban Development Corp 3.270% 15-Mar-2028	3.771.495	0,37
9.510.000	New York State Urban Development Corp 4,000% 15-Mar-2046	11.074.918	1,10
1.750.000	New York State Urban Development Corp 5,000% 15-Mar-2036	2.274.825	0,23

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Dedicated Tax Forts.</b>			
2.685.000	Pomona Redevelopment Agency Successor Agency 4,506% 01-Feb-2041	2.953.661	0,29
1.365.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3,000% 01-Oct-2025	1.434.506	0,14
1.445.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3,125% 01-Oct-2026	1.533.066	0,15
1.500.000	Riverside County Transportation Commission 4,000% 01-Jun-2038	1.803.285	0,18
2.000.000	Sales Tax Securitization Corp 2,225% 01-Jan-2024	2.038.600	0,20
3.500.000	Sales Tax Securitization Corp 4,787% 01-Jan-2048	4.465.597	0,44
4.900.000	San Diego County Regional Transportation Commission 2,063% 01-Apr-2032	4.850.755	0,48
2.450.000	San Diego Redevelopment Agency Successor Agency 3,750% 01-Sep-2031	2.710.864	0,27
1.000.000	San Francisco City & County Redevelopment Agency Successor Agency 3,250% 01-Aug-2029	1.067.735	0,11
3.750.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3,250% 01-Aug-2029	3.981.562	0,40
10.000.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3,375% 01-Aug-2034	10.505.350	1,04
5.000.000	State Board of Administration Finance Corp 1,258% 01-Jul-2025	4.977.300	0,49
4.750.000	State Board of Administration Finance Corp 1,705% 01-Jul-2027	4.740.595	0,47
5.000.000	State Board of Administration Finance Corp 2,154% 01-Jul-2030	4.992.050	0,50
1.000.000	State of Connecticut Special Tax Revenue 5,459% 01-Nov-2030	1.183.500	0,12
5.000.000	State of Illinois Sales Tax Revenue 3,750% 15-Jun-2032	5.388.500	0,54
5.675.000	Village Center Community Development District 4,756% 01-Nov-2029	6.483.971	0,64
<b>Bildung - 123.768.896</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 94.564.563)</b>			
500.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,789% 01-Apr-2022	501.257	0,05
750.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,870% 01-Apr-2023	756.379	0,08
500.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,931% 01-Apr-2024	504.280	0,05
1.370.000	California Educational Facilities Authority 3,414% 01-Apr-2031	1.454.269	0,14
1.635.000	California Educational Facilities Authority 3,431% 01-Apr-2030	1.706.866	0,17
2.500.000	Delaware County Authority 5,000% 01-Jul-2042	2.731.700	0,27
2.500.000	Florida Higher Educational Facilities Financial Authority 5,000% 01-Mar-2037	2.919.825	0,29
3.000.000	Harris County Cultural Education Facilities Finance Corp 3,344% 15-Nov-2037	3.161.400	0,31
8.500.000	Illinois Finance Authority 4,000% 01-Apr-2050	9.829.315	0,98
1.000.000	Illinois Finance Authority 5,450% 01-Aug-2038	1.166.630	0,12
1.000.000	Kent State University 2,797% 01-May-2032	1.030.945	0,10
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3,860% 01-Jun-2025	1.069.245	0,11
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3,942% 01-Jun-2026	1.082.560	0,11
2.075.000	Louisiana Public Facilities Authority 5,000% 01-Jul-2042	2.403.078	0,24
3.350.000	Massachusetts Educational Financing Authority 2,305% 01-Jul-2029	3.335.059	0,33
2.730.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3,455% 01-Jul-2028	2.946.025	0,29
2.110.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3,505% 01-Jul-2029	2.294.941	0,23
1.250.000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 4,409% 01-Oct-2034	1.323.975	0,13
5.500.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3,736% 01-Sep-2030	5.920.475	0,59
5.000.000	New York State Dormitory Authority 2,412% 01-Jul-2031	5.060.625	0,50
2.385.000	New York State Dormitory Authority 4,000% 15-Feb-2038	2.821.133	0,28
10.000.000	New York State Dormitory Authority 4,000% 15-Mar-2044	11.789.700	1,17
3.370.000	New York State Dormitory Authority 4,850% 01-Jul-2048	3.858.364	0,38

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Bildung Forts.</b>			
775.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2037	906.630	0,09
1.250.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2039	1.457.144	0,14
2.870.000	Onondaga Civic Development Corp 5.000% 01-Dec-2029	3.743.499	0,37
4.965.000	Pennsylvania Higher Educational Facilities Authority 4.000% 15-Aug-2044	5.808.007	0,58
2.000.000	Red River Education Finance Corp 2.802% 15-Mar-2033	2.074.740	0,21
1.775.000	Red River Education Finance Corp 2.892% 15-Mar-2034	1.840.240	0,18
2.000.000	Rutgers The State University of New Jersey 2.013% 01-May-2032	1.961.100	0,19
4.185.000	Salvation Army/United States 3.801% 01-Sep-2027	4.585.420	0,46
9.500.000	Santa Monica-Malibu Unified School District 2.944% 01-Aug-2036	9.919.235	0,98
2.000.000	University of California 1.614% 15-May-2030	1.941.970	0,19
10.000.000	University of California 1.997% 15-May-2031	9.906.500	0,98
1.100.000	University of California 3.063% 01-Jul-2025	1.169.960	0,12
2.000.000	University of California 3.349% 01-Jul-2029	2.198.810	0,22
1.000.000	University of Oklahoma/The 3.466% 01-Jul-2028	1.099.230	0,11
2.515.000	University of Pittsburgh-of the Commonwealth System of Higher Education 3.646% 15-Sep-2036	2.918.834	0,29
2.500.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	2.569.531	0,26
<b>Gesundheitswesen - 103.212.683</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 88.050.098)</b>			
2.750.000	Adventist Health System/West 2.433% 01-Sep-2024	2.792.389	0,28
4.500.000	Adventist Health System/West 2.952% 01-Mar-2029	4.713.408	0,47
1.500.000	Advocate Health & Hospitals Corp 3.829% 15-Aug-2028	1.677.880	0,17
7.600.000	Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039	8.110.519	0,81
5.000.000	Baylor Scott & White Holdings 1.777% 15-Nov-2030	4.836.066	0,48
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 1.979% 01-Jun-2030	4.937.150	0,49
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031	5.233.400	0,52
5.000.000	City of Chillicothe OH 5.000% 01-Dec-2047	5.978.875	0,59
400.000	City of Tampa FL 4.000% 01-Jul-2038	469.392	0,05
2.270.000	Development Authority for Fulton County 5.000% 01-Apr-2047	2.706.612	0,27
1.000.000	Dignity Health 3.125% 01-Nov-2022	1.017.945	0,10
3.500.000	Geisinger Authority 5.000% 01-Apr-2043	4.167.272	0,41
3.775.000	Illinois Finance Authority 5.000% 15-Nov-2045	4.330.001	0,43
1.000.000	Louisiana Public Facilities Authority 5.000% 15-May-2046	1.182.045	0,12
2.000.000	Maricopa County Special Health Care District 4.000% 01-Jul-2035	2.425.410	0,24
1.095.000	Massachusetts Development Finance Agency 3.995% 01-Jun-2024	1.118.669	0,11
4.740.000	Massachusetts Development Finance Agency 4.740% 01-Jul-2038	5.284.199	0,52
4.000.000	Mercy Health/OH 4.302% 01-Jul-2028	4.502.428	0,45
2.000.000	Monroe County Hospital Authority/PA 5.000% 01-Jul-2041	2.316.490	0,23
1.185.000	Montana Facility Finance Authority 4.368% 15-Aug-2038	1.409.007	0,14
2.500.000	Montefiore Obligated Group 4.287% 01-Sep-2050	2.462.763	0,24
2.000.000	New Hampshire Health and Education Facilities Authority Act 5.000% 01-Jul-2044	2.315.040	0,23
5.925.000	Oklahoma Development Finance Authority 5.450% 15-Aug-2028	6.642.044	0,66
2.000.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.532% 01-Oct-2029	2.067.174	0,21
3.075.000	SSM Health Care Corp 3.688% 01-Jun-2023	3.165.743	0,31
6.360.000	SSM Health Care Corp 3.823% 01-Jun-2027	6.985.060	0,69
5.000.000	Sutter Health 2.294% 15-Aug-2030	5.003.829	0,50
3.000.000	Trinity Health Corp 2.632% 01-Dec-2040	2.955.693	0,29
2.000.000	Washington Health Care Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.406.180	0,24

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Wohnungsbau - 12.393.566</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 12.574.384)</b>			
1.107.078	Arizona Industrial Development Authority '2019-2 A' FRN 3.625% 20-May-2033	1.240.779	0,12
1.400.000	California Statewide Communities Development Authority 1.877% 01-Feb-2031	1.373.911	0,13
1.000.000	California Statewide Communities Development Authority 2.177% 01-Feb-2033	988.485	0,10
4.000.000	Chicago Housing Authority 4.322% 01-Jan-2033	4.712.360	0,47
500.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 4.125% 01-Jul-2023	512.443	0,05
2.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.016% 15-Apr-2027	2.289.094	0,23
1.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.216% 15-Apr-2028	1.276.494	0,13
<b>Wohnungsbaufinanzierung - 6.548.282</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 6.160.000)</b>			
2.967.804	California Housing Finance Agency '2021-1 A' 3.500% 20-Nov-2035	3.388.282	0,34
3.160.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 0.010% 15-Nov-2052	3.160.000	0,31
<b>Leasing - 11.118.768</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 11.400.213)</b>			
5.000.000	Commonwealth Financing Authority 4.014% 01-Jun-2033	5.700.750	0,57
1.840.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15-Dec-2028	2.155.293	0,21
3.000.000	Oklahoma City Economic Development Trust 3.313% 01-Aug-2027	3.262.725	0,32
<b>Kommunalverwaltung - 125.999.684</b>			
<b>(31. Dezember 2020: 66.919.913)</b>			
2.615.000	City of Glendale AZ 2.062% 01-Jul-2029	2.576.446	0,26
3.000.000	City of New Haven CT 4.834% 01-Aug-2033	3.411.975	0,34
1.000.000	City of New Haven CT 5.000% 01-Aug-2031	1.260.735	0,13
10.000.000	City of New York NY 2.173% 01-Aug-2034	9.533.150	0,95
2.380.000	City of New York NY 3.450% 01-Dec-2027	2.604.220	0,26
1.665.000	City of New York NY 3.750% 01-Jun-2028	1.799.590	0,18
1.000.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2038	1.200.025	0,12
2.750.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2040	3.285.109	0,33
1.400.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2047	1.648.304	0,16
11.000.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2050	12.722.215	1,26
2.500.000	City of Philadelphia PA 2.864% 15-Jul-2031	2.607.563	0,26
11.000.000	City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033	14.386.405	1,43
6.500.000	Clackamas County School District No 12 North Clackamas 0.000% 15-Jun-2039	3.461.770	0,34
1.000.000	Clark County School District 5.000% 15-Jun-2035	1.287.930	0,13
5.450.000	Contra Costa Community College District 2.926% 01-Aug-2038	5.640.777	0,56
2.350.000	County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033	3.064.564	0,31
10.000.000	County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029	9.790.700	0,97
5.125.000	County of New Castle DE 1.810% 15-Jul-2030	5.143.040	0,51
2.500.000	County of Tulare CA 3.859% 01-Jun-2026	2.757.750	0,27
1.000.000	Detroit City School District 6.645% 01-May-2029	1.306.945	0,13
3.000.000	El Paso Independent School District 1.872% 15-Aug-2031	2.977.320	0,30
2.500.000	Los Angeles Unified School District/CA 4.000% 01-Jul-2044	2.959.300	0,29
6.145.000	Palomar Community College District 1.986% 01-Aug-2030	6.164.265	0,61
4.880.000	San Juan Unified School District 1.666% 01-Aug-2028	4.870.020	0,48
5.435.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	6.470.014	0,64
1.750.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	2.043.484	0,20
800.000	Southwestern Community College District 2.294% 01-Aug-2032	804.320	0,08
1.000.000	Southwestern Community College District 2.394% 01-Aug-2033	1.007.020	0,10
1.000.000	Southwestern Community College District 2.494% 01-Aug-2034	1.009.625	0,10

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Kommunalverwaltung Forts.</b>				
4.080.000	Sycamore Community City School District 4.000% 01-Dec-2029	4.945.633	0,49	
3.000.000	Town of Hamden CT 3.881% 15-Aug-2026	3.259.470	0,32	
<b>Gemeinnützige Organisationen - 4.789.850</b>		<b>4.789.850</b>	<b>0,48</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 2.709.392)</b>				
2.500.000	Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3.474% 15-Dec-2029	2.643.694	0,26	
2.000.000	Jackson Laboratory/The 3.468% 01-Jul-2051	2.146.156	0,22	
<b>Energie - 37.904.970</b>		<b>37.904.970</b>	<b>3,76</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 15.169.231)</b>				
1.500.000	American Municipal Power Inc 6.973% 15-Feb-2024	1.680.622	0,17	
1.100.000	American Municipal Power Inc 7.334% 15-Feb-2028	1.364.413	0,13	
3.500.000	City of Austin TX Electric Utility Revenue 2.837% 15-Nov-2027	3.725.138	0,37	
1.500.000	City of Lubbock TX Electric Light & Power System Revenue 4.000% 15-Apr-2034	1.793.580	0,18	
3.750.000	Municipal Electric Authority of Georgia 2.257% 01-Jan-2029	3.745.594	0,37	
1.300.000	Municipal Electric Authority of Georgia 4.000% 01-Jan-2051	1.474.752	0,15	
1.250.000	Oklahoma Municipal Power Authority 1.951% 01-Jan-2029	1.250.463	0,12	
8.700.000	Piedmont Municipal Power Agency 5.000% 01-Jan-2030	11.106.768	1,10	
4.000.000	South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2036	4.841.380	0,48	
2.000.000	South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2042	2.357.220	0,23	
1.935.000	South Carolina Public Service Authority 5.125% 01-Dec-2043	2.103.480	0,21	
1.000.000	South Carolina Public Service Authority 5.784% 01-Dec-2041	1.383.140	0,14	
1.000.000	Southern California Public Power Authority 4.208% 01-Jul-2028	1.078.420	0,11	
<b>Prepaid Gas - 1.311.612</b>		<b>1.311.612</b>	<b>0,13</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 8.009.444)</b>				
1.160.000	Kentucky Public Energy Authority 4.000% 01-Dec-2050	1.311.612	0,13	
<b>Pre-Refunded - 9.978.047</b>		<b>9.978.047</b>	<b>0,99</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 5.015.403)</b>				
3.975.000	City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029	4.565.586	0,45	
5.485.000	City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029	5.412.461	0,54	
<b>Renten - 9.089.362</b>		<b>9.089.362</b>	<b>0,90</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 9.225.230)</b>				
725.000	Berks County Industrial Development Authority 3.950% 15-May-2024	740.424	0,07	
1.000.000	Montgomery County Industrial Development Authority/PA 5.000% 15-Nov-2036	1.171.255	0,11	
1.000.000	North Carolina Medical Care Commission 5.000% 01-Oct-2042	1.111.170	0,11	
1.000.000	North Carolina Medical Care Commission 5.000% 01-Oct-2047	1.111.170	0,11	
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2037	1.077.235	0,11	
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2042	1.074.170	0,11	
2.500.000	St Louis County Industrial Development Authority 5.000% 01-Sep-2048	2.803.938	0,28	
<b>Regierung Bundesstaaten - 25.274.063</b>		<b>25.274.063</b>	<b>2,51</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 7.213.525)</b>				
5.000.000	State of California 5.250% 01-Aug-2032	6.941.450	0,69	
10.000.000	State of New York 3.110% 15-Feb-2037	10.479.400	1,04	
7.500.000	State of New York 3.170% 15-Feb-2038	7.853.213	0,78	
<b>Transport - 217.211.637</b>		<b>217.211.637</b>	<b>21,57</b>	
<b>(31. Dezember 2020: 117.687.806)</b>				
2.000.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.174% 01-Jan-2029	2.023.220	0,20	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Transport Forts.</b>				
2.250.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.274% 01-Jan-2030	2.278.001	0,23	
2.750.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.354% 01-Jan-2031	2.759.254	0,27	
4.000.000	Central Texas Turnpike System 3.029% 15-Aug-2041	4.003.640	0,40	
1.250.000	Chicago Midway International Airport 3.655% 01-Jan-2025	1.322.062	0,13	
1.500.000	Chicago Midway International Airport 3.697% 01-Jan-2026	1.600.155	0,16	
1.200.000	Chicago Midway International Airport 3.747% 01-Jan-2027	1.290.342	0,13	
900.000	Chicago Midway International Airport 3.797% 01-Jan-2028	973.332	0,10	
5.000.000	Chicago O'Hare International Airport 4.472% 01-Jan-2049	6.590.875	0,65	
8.250.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028	8.387.445	0,83	
1.500.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 5.000% 01-Dec-2036	2.099.827	0,21	
2.150.000	City of Houston TX Airport System Revenue 1.716% 01-Jul-2026	2.159.148	0,21	
4.000.000	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2035	4.995.900	0,50	
5.110.000	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2036	6.370.228	0,63	
4.500.000	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2040	5.799.847	0,58	
1.500.000	City of Phoenix Civic Improvement Corp 5.000% 01-Jul-2029	1.898.258	0,19	
5.000.000	Colorado Bridge Enterprise 2.543% 31-Dec-2032	5.099.900	0,51	
2.000.000	Colorado High Performance Transportation Enterprise 5.000% 31-Dec-2047	2.252.070	0,22	
10.000.000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.384% 01-Oct-2026	10.287.800	1,02	
1.000.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 01-Oct-2029	1.069.890	0,11	
4.400.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.505% 01-Oct-2025	4.712.730	0,47	
3.000.000	Dallas Area Rapid Transit 2.078% 01-Dec-2031	3.013.905	0,30	
2.500.000	Dallas Fort Worth International Airport 4.000% 01-Nov-2034	3.027.375	0,30	
1.500.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 2.962% 15-Jan-2046	1.490.093	0,15	
2.500.000	Grand Parkway Transportation Corp 4.000% 01-Oct-2049	2.899.625	0,29	
2.470.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2031	3.185.435	0,32	
1.260.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2040	1.616.624	0,16	
2.500.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045	3.172.650	0,31	
2.000.000	Kenton County Airport Board 4.689% 01-Jan-2049	2.197.470	0,22	
1.750.000	Maryland Economic Development Corp 4.750% 01-Jun-2042	1.855.385	0,18	
5.000.000	Massachusetts Port Authority 1.879% 01-Jul-2033	4.784.200	0,48	
3.350.000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.411% 01-Jul-2033	3.356.583	0,33	
2.000.000	Metropolitan Nashville Airport Authority/The 5.000% 01-Jul-2049	2.470.740	0,25	
5.000.000	Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044	6.171.425	0,61	
3.500.000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4.000% 01-Oct-2049	3.965.955	0,39	
10.000.000	New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028	9.691.800	0,96	
4.300.000	New Jersey Turnpike Authority 1.813% 01-Jan-2030	4.162.035	0,41	
1.000.000	New Jersey Turnpike Authority 7.414% 01-Jan-2040	1.611.525	0,16	
3.000.000	New York State Thruway Authority 2.900% 01-Jan-2035	3.134.175	0,31	
5.000.000	New York State Thruway Authority 4.000% 01-Jan-2045	5.774.050	0,57	
2.500.000	New York Transportation Development Corp 5.250% 01-Jan-2050	2.759.688	0,27	
1.000.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 1.882% 01-Mar-2028	992.250	0,10	



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Transport Forts.</b>			
1.150.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.210% 01-Mar-2029	1.156.549	0,11
1.375.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.310% 01-Mar-2030	1.387.464	0,14
7.000.000	North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033	6.969.200	0,69
4.500.000	Pennsylvania Turnpike Commission 2.890% 01-Dec-2035	4.614.638	0,46
8.245.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.043% 01-Dec-2033	8.628.351	0,86
9.000.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.416% 01-Dec-2041	9.445.770	0,94
2.385.000	Pennsylvania Turnpike Commission 5.000% 01-Jun-2042	2.841.787	0,28
1.000.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.000% 15-Jul-2051	1.158.695	0,12
1.500.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.823% 01-Jun-2045	1.650.015	0,16
1.295.000	Port Authority of New York & New Jersey 5.310% 01-Aug-2046	1.417.695	0,14
1.080.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.699% 01-Dec-2026	1.174.943	0,12
1.135.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.799% 01-Dec-2028	1.259.895	0,13
500.000	Port of Oakland 2.099% 01-May-2030	498.005	0,05
10.000.000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5.000% 01-May-2049	12.243.800	1,22
1.250.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.174% 01-Jul-2026	1.301.394	0,13
750.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.431% 01-Jul-2028	793.778	0,08
2.290.000	State of Ohio 5.000% 31-Dec-2039	2.542.266	0,25
5.000.000	State of Oregon Department of Transportation 2.851% 15-Nov-2032	5.267.475	0,52
3.000.000	Virginia Small Business Financing Authority 5.000% 31-Dec-2052	3.553.005	0,35
<b>Wasser - 73.296.801</b>		<b>73.296.801</b>	<b>7,28</b>
<b>(31. Dezember 2020: 33.581.124)</b>			
1.650.000	City & County Honolulu HI Wastewater System Revenue 2.316% 01-Jul-2025	1.708.097	0,17
1.000.000	City of Chicago IL Wastewater Transmission Revenue 5.000% 01-Jan-2039	1.080.455	0,11
1.120.000	City of Corpus Christi TX Utility System Revenue 5.000% 15-Jul-2034	1.458.117	0,14
5.800.000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2.984% 15-Nov-2042	5.920.379	0,59
2.940.000	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 2.825% 01-Nov-2041	2.882.376	0,29
21.635.000	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 3.303% 01-Nov-2039	22.383.787	2,22
3.040.000	City of Springfield MO Public Utility Revenue 2.300% 01-Nov-2032	3.072.665	0,30
3.690.000	County of Fairfax VA Sewer Revenue 3.000% 15-Jul-2037	4.167.449	0,41
5.000.000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 2.911% 01-Oct-2032	5.249.725	0,52
4.000.000	East Baton Rouge Sewerage Commission 2.437% 01-Feb-2039	3.915.700	0,39
3.000.000	Florida Water Pollution Control Financing Corp 2.550% 15-Jan-2029	3.179.055	0,32
3.000.000	Great Lakes Water Authority Sewage Disposal System Revenue 3.056% 01-Jul-2039	3.169.665	0,31
3.000.000	Irvine Ranch Water District 6.622% 01-May-2040	4.522.065	0,45
5.000.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 2.534% 01-Dec-2032	5.052.372	0,50
1.810.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 5.720% 01-Dec-2038	2.495.646	0,25
2.250.000	Ohio Water Development Authority 4.817% 01-Dec-2030	2.683.305	0,27

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Wasser Forts.</b>			
330.000	State of California Department of Water Resources 3.127% 01-Dec-2029	355.943	0,04
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>989.667.151</b>	<b>98,27</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.695.769 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.183.004)		3.695.769	0,36
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>993.362.920</b>	<b>98,63</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (29.655) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (77.833))		(29.655)	(0,00)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>		<b>(29.655)</b>	<b>(0,00)</b>
<b>Nettoumlaufvermögen</b>		<b>13.749.459</b>	<b>1,37</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>1.007.082.724</b>	<b>100,00</b>
<b>Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens</b>			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			98,06
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,37
Sonstiges Umlaufvermögen			1,57
<b>Gesamtvermögen</b>			<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Acc) (Hedged)**

Australischer Dollar	US-Dollar	9.939	7.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	122
						<b>USD 122</b>
						<b>AUD 168</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Inc) (Hedged)**

Australischer Dollar	US-Dollar	9.939	7.109	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	122
						<b>USD 122</b>
						<b>AUD 168</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	4.971.986	5.383.019	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	74.944
						<b>USD 74.944</b>
						<b>CHF 68.289</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	14.675	15.888	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	221
						<b>USD 221</b>
						<b>CHF 201</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	1.960.875	2.132.216	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	20.321
Schweizer Franken	US-Dollar	30.591.899	33.120.928	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	461.121
						<b>USD 481.442</b>
						<b>CHF 438.690</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	7.206.499	7.802.259	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	108.626
						<b>USD 108.626</b>
						<b>CHF 98.980</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF Z (Acc) (Hedged)**

Schweizer Franken	US-Dollar	9.962	10.786	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	150
						<b>USD 150</b>
						<b>CHF 137</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	7.580.825	8.579.124	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	53.439
						<b>USD 53.439</b>
						<b>EUR 46.938</b>

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	8.412.656	9.520.496	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	59.302
						<b>USD 59.302</b>
						<b>EUR 52.088</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	856.335	969.300	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	5.638
Euro	US-Dollar	2.809	3.186	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	15.000	17.015	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	66
Euro	US-Dollar	45.000	50.607	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	636
Euro	US-Dollar	5.000	5.672	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	22
Euro	US-Dollar	22.903	25.882	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	199
Euro	US-Dollar	12.000	13.521	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	144
Euro	US-Dollar	500.000	564.864	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.505
Euro	US-Dollar	10.500	11.898	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	382.707	433.296	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2.507
Euro	US-Dollar	24.842.081	28.113.469	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	175.116

**USD 188.905**

**EUR 165.924**

US-Dollar Euro 433.193 382.707 4. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (2.520)

US-Dollar Euro 244.480 215.569 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (997)

US-Dollar Euro 1.896 1.495 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (6)

US-Dollar Euro 228.742 203.400 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (2.877)

US-Dollar Euro 96.935 85.778 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (744)

US-Dollar Euro 1.936 1.718 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (21)

US-Dollar Euro 16.930 14.941 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (84)

US-Dollar Euro 969.531 856.335 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (5.609)

US-Dollar Euro 39.678 35.092 14. Jan. 22 The Bank of New York Mellon (282)

**USD (13.140)**

**EUR (11.541)**

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	75	85	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	76	86	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	150	170	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	562.282	636.328	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.964
Euro	US-Dollar	75	85	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	75	85	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	75	84	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	274	310	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	75	85	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	-

**USD 3.970**

**EUR 3.487**

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	170	150	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1)
						<b>USD (1)</b>
						<b>EUR (1)</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	9.911	11.216	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	70
						<b>USD 70</b>
						<b>EUR 61</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	9.911	11.216	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	70
						<b>USD 70</b>
						<b>EUR 61</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	160.698	181.897	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.058
Euro	US-Dollar	59.898	67.809	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	387
Euro	US-Dollar	261.121	296.140	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.207
Euro	US-Dollar	847.708	958.508	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.808
Euro	US-Dollar	1.376.975	1.560.264	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	7.748
Euro	US-Dollar	42.171	47.751	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	271
Euro	US-Dollar	3.259	3.696	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	661.467	748.904	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.333
Euro	US-Dollar	32.985	37.264	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	297
Euro	US-Dollar	79.713	89.817	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	955
Euro	US-Dollar	12.819	14.487	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	111
Euro	US-Dollar	79.486	90.170	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	343
Euro	US-Dollar	52.409	58.939	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	741
Euro	US-Dollar	100.561	113.490	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.023
Euro	US-Dollar	128.839	145.465	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.249
Euro	US-Dollar	21.152	23.993	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	93
Euro	US-Dollar	13.617	15.470	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36
Euro	US-Dollar	204.537.636	231.472.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.441.821
						<b>USD 1.468.497</b>
						<b>EUR 1.289.851</b>
US-Dollar	Euro	748.726	661.467	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4.355)
US-Dollar	Euro	47741	42.171	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(272)
US-Dollar	Euro	94.870	83.651	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(387)
US-Dollar	Euro	67.823	59.898	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(385)
US-Dollar	Euro	19.265	16.989	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(81)
US-Dollar	Euro	181.940	160.698	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(1.053)
US-Dollar	Euro	114.131	100.724	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(567)
US-Dollar	Euro	37.056	32.772	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(263)

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	98.756	87.416	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(787)
US-Dollar	Euro	72.105	63.806	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(553)
US-Dollar	Euro	90.737	79.985	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(345)
US-Dollar	Euro	49.539	44.051	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(623)
US-Dollar	Euro	61.348	54.359	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(553)
US-Dollar	Euro	299.432	265.209	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(2.571)
US-Dollar	Euro	48.404	42.671	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(187)
US-Dollar	Euro	29.793	26.442	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(317)
US-Dollar	Euro	24.605	21.657	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(57)
						<b>USD (13.356)</b>
						<b>EUR (11.731)</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	5.477	6.199	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	36
Euro	US-Dollar	37.414	42.431	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	173
Euro	US-Dollar	10.000	11.343	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	44
Euro	US-Dollar	21.131	23.858	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	205
Euro	US-Dollar	621.985	701.953	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	6.324
Euro	US-Dollar	40.124	45.123	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	567
Euro	US-Dollar	27.552	31.256	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	119
Euro	US-Dollar	65.169	73.429	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	781
Euro	US-Dollar	23.512	26.641	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	132
Euro	US-Dollar	87.014	98.527	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	560
Euro	US-Dollar	98.983	112.067	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	648
Euro	US-Dollar	23.505	26.577	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	189
Euro	US-Dollar	175.537.579	198.653.659	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	1.237.395
						<b>USD 1.247.173</b>
						<b>EUR 1.095.452</b>
US-Dollar	Euro	112.040	98.983	4. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(652)
US-Dollar	Euro	98.506	87.014	5. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(562)
US-Dollar	Euro	3.395	2.993	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	6.324	5.575	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Euro	57.529	50.954	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(494)
US-Dollar	Euro	8.461	7.523	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(106)
US-Dollar	Euro	79.865	70.673	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(613)
US-Dollar	Euro	13.556	12.031	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(144)
US-Dollar	Euro	567	502	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	27.775	24.512	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(138)
US-Dollar	Euro	6.201	5.477	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Euro	47.556	42.058	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(338)

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

**Devisenterminkontrakte Forts.**

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
------	---------	------------	------------	------------------	------------	-------------------------------------

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.**

US-Dollar	Euro	14.193	12.493	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	(33)
					<b>USD</b>	<b>(3.158)</b>
					<b>EUR</b>	<b>(2.774)</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged)**

Euro	US-Dollar	508.019	574.918	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	3.581
					<b>USD</b>	<b>3.581</b>
					<b>EUR</b>	<b>3.145</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling G (Inc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	10.303	13.612	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	334
					<b>USD</b>	<b>334</b>
					<b>GBP</b>	<b>247</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	12.296	16.244	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	399
					<b>USD</b>	<b>399</b>
					<b>GBP</b>	<b>295</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	125.624	165.958	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	4.076
					<b>USD</b>	<b>4.076</b>
					<b>GBP</b>	<b>3.011</b>

**BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	10.050	13.277	14. Jan. 22	The Bank of New York Mellon	326
					<b>USD</b>	<b>326</b>
					<b>GBP</b>	<b>241</b>

# RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND\*

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Summe Nettowert mögen %
<b>Anleihen</b>			
<b>Australien - 14.444.187</b>			
1.142.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'REGS' 3.625% 28-Jan-2026	1.078.019	0,11
2.292.000	Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 4,750% 24-Sep-2080	2.117.849	0,22
3.767.000	Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 5,125% 24-Sep-2080	3.577.792	0,36
4.255.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1,750% 26-Apr-2028	4.453.805	0,45
2.530.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 2,750% 23-Apr-2024	2.665.674	0,27
521.000	Telstra Corp Ltd 'EMTN' 1,375% 26-Mar-2029	551.048	0,06
<b>Österreich - 4.420.418</b>			
4.400.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0,375% 25-Sep-2026	4.420.418	0,45
<b>Belgien - 20.889.913</b>			
2.300.000	Belfius Bank SA 'EMTN' 0,000% 28-Aug-2026	2.272.020	0,23
1.800.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 0,875% 28-Apr-2030	1.839.631	0,19
1.500.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 2,750% 30-Nov-2022	1.542.342	0,16
2.800.000	Groupe Bruxelles Lambert SA 0,125% 28-Jan-2031	2.678.328	0,27
2.100.000	Groupe Bruxelles Lambert SA 1,875% 19-Jun-2025	2.229.299	0,23
3.900.000	KBC Group NV 'EMTN' 0,750% 18-Oct-2023	3.969.069	0,40
2.900.000	KBC Group NV 'EMTN' 1,125% 25-Jan-2024	2.975.491	0,30
1.600.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0,125% 10-Sep-2026	1.589.358	0,16
1.800.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0,250% 01-Mar-2027	1.794.375	0,18
<b>Bermudas - 3.159.541</b>			
648.000	PartnerRe Ireland Finance DAC 1,250% 15-Sep-2026	670.194	0,07
2.267.000	XLIT Ltd FRN 3,250% 29-Jun-2047	2.489.347	0,25
<b>Kanada - 2.028.173</b>			
2.000.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 0,625% 20-Jul-2023	2.028.173	0,21
<b>Dänemark - 4.548.936</b>			
2.907.000	Nykredit Realkredit AS 'EMTN' 0,125% 10-Jul-2024	2.911.416	0,29
1.600.000	Nykredit Realkredit AS 'EMTN' FRN 2,750% 17-Nov-2027	1.637.520	0,17
<b>Finnland - 12.033.707</b>			
6.242.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0,125% 01-Jul-2024	6.282.332	0,64
2.161.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0,375% 26-Feb-2024	2.186.929	0,22
3.402.000	Sampo Oyj 'EMTN' FRN 2,500% 03-Sep-2052	3.564.446	0,36
<b>Frankreich - 167.753.787</b>			
1.500.000	Aeroports de Paris 2,750% 02-Apr-2030	1.743.096	0,18
2.900.000	ALD SA 'EMTN' 0,875% 18-Jul-2022	2.918.705	0,30
3.100.000	APRR SA 'EMTN' 1,250% 18-Jan-2028	3.277.552	0,33
1.200.000	Arkema SA 'EMTN' 0,125% 14-Oct-2026	1.202.562	0,12
1.339.000	AXA SA 'EMTN' FRN 3,250% 28-May-2049	1.503.923	0,15
1.740.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,941% 07-Nov-2024	1.907.982	0,19
1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1,250% 03-Jun-2030	1.039.117	0,11
3.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0,100% 08-Oct-2027	2.949.555	0,30
5.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0,125% 05-Feb-2024	5.125.508	0,52
1.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1,250% 26-May-2027	1.151.841	0,12
2.600.000	BNP Paribas Cardif SA 'EMTN' 1,000% 29-Nov-2024	2.653.216	0,27
100.000	BNP Paribas Cardif SA FRN (Perpetual) 4,032%	112.076	0,01
2.500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1,125% 11-Jun-2026	2.591.797	0,26
1.900.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 15-Jul-2025	1.920.572	0,20

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Summe Nettowert mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Frankreich Forts.</b>			
3.800.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 19-Feb-2028	3.778.153	0,38
2.800.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 19-Jan-2030	2.737.600	0,28
1.200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2,125% 23-Jan-2027	1.280.483	0,13
3.900.000	BNP Paribas SA FRN 0,500% 01-Sep-2028	3.859.356	0,39
1.000.000	BPCE SA 0,125% 04-Dec-2024	1.005.864	0,10
3.200.000	BPCE SA 0,250% 15-Jan-2026	3.196.096	0,33
4.700.000	BPCE SA 0,250% 14-Jan-2031	4.494.281	0,46
1.500.000	BPCE SA 'EMTN' 1,000% 01-Apr-2025	1.541.165	0,16
1.500.000	BPCE SA 'EMTN' 1,375% 23-Mar-2026	1.566.678	0,16
900.000	BPCE SA 'EMTN' FRN 2,750% 30-Nov-2027	922.957	0,09
3.600.000	BPCE SA FRN 1,500% 13-Jan-2042	3.578.760	0,36
1.500.000	Carrefour SA 'EMTN' 0,750% 26-Apr-2024	1.523.168	0,16
1.200.000	Carrefour SA 'EMTN' 0,875% 12-Jun-2023	1.215.306	0,12
2.700.000	Carrefour SA 'EMTN' 2,625% 15-Dec-2027	3.021.696	0,31
1.300.000	Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 0,875% 21-Sep-2023	1.325.665	0,13
2.900.000	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0,250% 02-Nov-2032	2.781.898	0,28
2.300.000	CNP Assurances 1,875% 20-Oct-2022	2.334.638	0,24
2.300.000	Credit Agricole Assurances SA 2,000% 17-Jul-2030	2.381.003	0,24
1.500.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0,375% 21-Oct-2025	1.512.330	0,15
3.100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0,375% 20-Apr-2028	3.053.175	0,31
700.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,750% 05-Mar-2029	753.753	0,08
1.300.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,875% 20-Dec-2026	1.398.322	0,14
3.000.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 0,875% 07-May-2027	3.075.982	0,31
3.200.000	Danone SA 'EMTN' 1,000% 26-Mar-2025	3.300.928	0,34
2.000.000	Danone SA 'EMTN' 1,125% 14-Jan-2025	2.063.926	0,21
1.800.000	Dassault Systemes SE 0,000% 16-Sep-2022	1.804.005	0,18
3.100.000	Dassault Systemes SE 0,125% 16-Sep-2026	3.099.070	0,32
1.300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1,000% 29-Nov-2033	1.290.543	0,13
1.500.000	Electricite de France SA 'EMTN' 2,000% 09-Dec-2049	1.597.140	0,16
1.600.000	Engie SA 'EMTN' 1,750% 27-Mar-2028	1.728.157	0,18
800.000	Engie SA 'EMTN' 2,125% 30-Mar-2032	905.190	0,09
490.000	Faurecia SE 2,375% 15-Jun-2029	495.400	0,05
2.520.000	Faurecia SE 3,750% 15-Jun-2028	2.642.195	0,27
2.900.000	Iliad SA 1,875% 11-Feb-2028	2.764.976	0,28
3.000.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0,875% 26-Jan-2031	2.966.850	0,30
1.500.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1,250% 13-Jun-2028	1.558.636	0,16
2.500.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2,125% 21-Jun-2052	2.513.250	0,26
3.300.000	Orange SA 1,200% 11-Jul-2034	3.405.947	0,35
1.400.000	Orange SA 9,000% 01-Mar-2031	1.897.316	0,19
1.900.000	Orange SA 'EMTN' 0,625% 16-Dec-2033	1.850.933	0,19
500.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 1,750% 15-Jul-2028	508.153	0,05
3.500.000	RCI Banque SA 'EMTN' 0,250% 08-Mar-2023	3.510.238	0,36
2.091.000	RCI Banque SA 'EMTN' 0,750% 26-Sep-2022	2.101.340	0,21
1.100.000	RCI Banque SA 'EMTN' 1,625% 11-Apr-2025	1.137.928	0,12
800.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 'EMTN' 1,000% 19-Oct-2026	828.876	0,08
1.300.000	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1,500% 29-May-2025	1.355.348	0,14
900.000	Societe Generale SA 0,750% 25-Jan-2027	907.300	0,09
5.000.000	Societe Generale SA 'EMTN' 0,125% 18-Feb-2028	4.898.384	0,50
3.900.000	Societe Generale SA FRN 0,625% 02-Dec-2027	3.890.250	0,40
370.000	Sodexo SA 2,500% 24-Jun-2026	407.921	0,04
1.800.000	TDF Infrastructure SASU 2,500% 07-Apr-2026	1.914.565	0,19
2.100.000	Terega SA 0,875% 17-Sep-2030	2.091.531	0,21
3.872.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1,750% 04-Apr-2024	3.953.495	0,40
395.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,369% 06-Oct-2026	430.975	0,04
1.660.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 18-May-2022	1.684.236	0,17
4.383.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1,625% 25-Oct-2027	4.351.004	0,44

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Frankreich Forts.</b>				
1.800.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030	1.777.950	0,18	
3.600.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	3.617.586	0,37	
2.400.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	2.460.060	0,25	
886.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.500% 22-Feb-2028	929.197	0,09	
400.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 2.250% 14-May-2038	425.480	0,04	
1.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN (Perpetual) 2.125% 25-Jul-2023	991.400	0,10	
1.900.000	Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028	1.850.971	0,19	
2.300.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	2.343.700	0,24	
1.165.000	WEA Finance LLC '144A' 3.500% 15-Jun-2029	1.065.606	0,11	
<b>Deutschland - 99.148.552</b>		<b>99.148.552</b>	<b>10,07</b>	
4.800.000	adidas AG 0.000% 09-Sep-2024	4.816.048	0,49	
1.200.000	adidas AG 0.000% 05-Oct-2028	1.190.059	0,12	
1.100.000	Allianz Finance II BV 'EMTN' 0.250% 06-Jun-2023	1.107.742	0,11	
4.800.000	Allianz SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 24-Oct-2023	5.186.916	0,53	
1.600.000	Allianz SE FRN 5.625% 17-Oct-2042	1.668.440	0,17	
2.400.000	Allianz SE FRN (Perpetual) 3.375% 18-Sep-2024	2.582.140	0,26	
1.700.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0.000% 11-Jan-2026	1.698.016	0,17	
739.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0.200% 11-Jan-2033	707.613	0,07	
2.284.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 28-Aug-2023	2.308.147	0,23	
1.500.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.875% 22-Jan-2027	1.511.195	0,15	
1.400.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.875% 28-Feb-2028	1.490.461	0,15	
700.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	710.662	0,07	
1.500.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030	1.638.945	0,17	
2.377.000	Continental AG 'EMTN' 2.500% 27-Aug-2026	2.605.367	0,26	
2.016.000	Daimler AG 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2033	2.028.983	0,21	
1.000.000	Daimler AG 'EMTN' 1.625% 22-Aug-2023	1.031.276	0,11	
956.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 1.375% 26-Jun-2026	1.013.693	0,10	
1.892.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 2.000% 22-Aug-2026	2.056.538	0,21	
1.121.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 0.625% 08-Dec-2050	974.259	0,10	
4.200.000	Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025	4.194.522	0,43	
2.800.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.000% 19-Nov-2025	2.850.305	0,29	
764.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	794.981	0,08	
2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032	2.297.585	0,23	
1.500.000	Deutsche Boerse AG 0.000% 22-Feb-2026	1.497.584	0,15	
1.100.000	Deutsche Boerse AG FRN 1.250% 16-Jun-2047	1.125.401	0,11	
481.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034	510.108	0,05	
2.500.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.625% 01-Dec-2022	2.523.201	0,26	
3.100.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.875% 30-Jan-2024	3.166.303	0,32	
297.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033	449.067	0,05	
3.100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	3.225.669	0,33	
600.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2028	638.775	0,07	
100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.625% 03-Nov-2023	102.875	0,01	
800.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.875% 10-Jun-2025	844.826	0,09	
5.500.000	Grand City Properties SA 'EMTN' 0.125% 11-Jan-2028	5.280.732	0,54	
1.400.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 0.750% 24-Jun-2023	1.417.277	0,14	
1.400.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.125% 24-Jun-2026	1.450.373	0,15	
2.000.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029	2.132.510	0,22	
800.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032	872.984	0,09	
1.000.000	Merck Financial Services GmbH 'EMTN' 0.005% 15-Dec-2023	1.004.865	0,10	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
<b>Anleihen Forts.</b>				
<b>Deutschland Forts.</b>				
2.000.000	Merck Financial Services GmbH 'EMTN' 0.125% 16-Jul-2025	2.011.073	0,20	
700.000	Merck KGaA FRN 1.625% 25-Jun-2079	720.488	0,07	
2.200.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049	2.492.320	0,25	
2.000.000	SAP SE 1.250% 10-Mar-2028	2.126.058	0,22	
900.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2.750% 12-Oct-2025	956.709	0,10	
1.500.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0.250% 20-Feb-2029	1.502.423	0,15	
2.800.000	Vonovia Finance BV 1.800% 29-Jun-2025	2.943.200	0,30	
1.000.000	Vonovia Finance BV 2.250% 07-Apr-2030	1.111.165	0,11	
700.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.625% 07-Oct-2027	700.913	0,07	
2.300.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.875% 03-Jul-2023	2.328.279	0,24	
2.800.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2024	2.892.943	0,29	
1.400.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Oct-2039	1.389.080	0,14	
500.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.750% 25-Jan-2027	532.262	0,05	
800.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.250% 15-Dec-2023	837.097	0,09	
2.100.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	2.033.944	0,21	
1.100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.750% 25-May-2027	1.131.003	0,12	
700.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.000% 21-Sep-2025	733.152	0,07	
<b>Hongkong - 2.095.235</b>		<b>2.095.235</b>	<b>0,21</b>	
2.119.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	2.095.235	0,21	
<b>Irland - 14.190.312</b>				
3.657.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	3.617.504	0,37	
811.000	CRH Funding BV 1.625% 05-May-2030	870.221	0,09	
4.027.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	4.007.389	0,40	
975.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	991.214	0,10	
2.592.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	2.636.777	0,27	
2.103.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029	2.067.207	0,21	
<b>Italien - 49.389.055</b>		<b>49.389.055</b>	<b>5,02</b>	
1.380.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.124% 01-Oct-2030	1.449.718	0,15	
3.957.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 28-May-2029	3.892.382	0,40	
3.306.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.875% 08-Jun-2030	3.211.779	0,33	
2.713.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	2.703.098	0,27	
1.007.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024	1.005.384	0,10	
1.900.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.125% 16-Nov-2023	1.903.460	0,19	
873.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 1.000% 21-Feb-2022	873.834	0,09	
2.820.000	Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 4.750% 18-Jan-2032	2.844.675	0,29	
1.120.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024	1.138.895	0,12	
3.075.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	3.072.340	0,31	
1.667.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.875% 27-Jun-2022	1.677.485	0,17	
2.920.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 22-Jul-2022	2.941.681	0,30	
2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 04-Jul-2024	2.246.987	0,23	
1.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 2.125% 30-Aug-2023	1.245.011	0,13	
2.515.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030	2.461.481	0,25	
1.315.000	Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024	1.313.521	0,13	
2.602.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Nov-2028	2.558.013	0,26	
1.551.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.750% 24-Jul-2032	1.546.009	0,16	
1.692.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 0.125% 25-Jul-2025	1.693.337	0,17	
1.368.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026	1.412.772	0,14	
1.500.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.375% 26-Jul-2027	1.579.205	0,16	
1.000.000	UniCredit SpA 1.800% 20-Jan-2030	1.027.598	0,10	
2.505.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	2.503.960	0,25	
2.070.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025	2.120.769	0,22	
957.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2.000% 23-Sep-2029	965.661	0,10	

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert- Zeitwert EUR	Summe Nettowert- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Japan - 7.934.700</b>			
3.516.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032	3.653.644	0,37
3.604.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	4.281.056	0,44
<b>Luxemburg - 19.127.141</b>			
8.311.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028	8.115.484	0,82
3.809.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	3.622.549	0,37
1.984.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	2.054.442	0,21
2.142.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 15-Jul-2027	2.222.272	0,22
3.000.000	SELP Finance Sarl 1.500% 20-Dec-2026	3.112.394	0,32
<b>Niederlande - 78.119.661</b>			
1.800.000	ABN AMRO Bank NV 0.600% 15-Jan-2027	1.819.141	0,18
3.584.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 17-Jul-2023	3.625.063	0,37
2.202.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 15-Apr-2026	2.239.921	0,23
1.400.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.250% 28-May-2025	1.451.405	0,15
1.700.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 2.875% 18-Jan-2028	1.747.879	0,18
1.700.000	ABN AMRO Bank NV FRN (Perpetual) 4.375% 22-Sep-2025	1.825.800	0,18
2.718.000	Achmea BV 'EMTN' FRN 6.000% 04-Apr-2043	2.916.819	0,30
1.295.000	Aegon Bank NV 0.625% 21-Jun-2024	1.316.844	0,13
1.300.000	ASML Holding NV 0.625% 07-May-2029	1.328.689	0,13
495.000	ASR Nederland NV FRN 3.375% 02-May-2049	546.139	0,05
3.305.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	3.303.348	0,34
1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN' 0.750% 29-Aug-2023	1.016.100	0,10
1.800.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024	1.807.472	0,18
2.500.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.750% 25-Jun-2023	2.535.113	0,26
2.251.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.375% 14-Apr-2033	2.169.570	0,22
1.832.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032	1.837.958	0,19
1.115.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.750% 02-Jul-2031	1.138.702	0,12
1.701.000	Euronext NV 1.000% 18-Apr-2025	1.748.585	0,18
2.460.000	Euronext NV 1.500% 17-May-2041	2.436.901	0,25
5.700.000	ING Groep NV 'EMTN' 1.000% 20-Sep-2023	5.817.128	0,59
900.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 1.625% 26-Sep-2029	924.888	0,09
3.000.000	ING Groep NV FRN 0.375% 29-Sep-2028	2.949.750	0,30
3.600.000	ING Groep NV FRN 1.000% 13-Nov-2030	3.618.153	0,37
3.736.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	3.705.869	0,38
1.200.000	Koninklijke KPN NV 'EMTN' 0.875% 14-Dec-2032	1.180.199	0,12
2.323.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	2.306.669	0,23
933.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	961.726	0,10
2.800.000	Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 0.375% 26-Feb-2025	2.832.237	0,29
1.590.000	Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 9.000% 29-Aug-2042	1.683.810	0,17
1.728.000	NN Group NV 'EMTN' 0.875% 13-Jan-2023	1.744.780	0,18
284.000	NN Group NV 'EMTN' 1.625% 01-Jun-2027	303.008	0,03
1.854.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 0.125% 30-Nov-2032	1.743.271	0,18
1.822.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 0.875% 03-Jun-2030	1.876.666	0,19
2.560.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 0.750% 18-Oct-2031	2.533.581	0,26
1.698.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 1.500% 24-May-2027	1.794.163	0,18
1.400.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 2.000% 10-Jul-2026	1.500.249	0,15
892.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	890.537	0,09
2.900.000	WP/AP Telecom Holdings IV BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	2.941.528	0,30
<b>Neuseeland - 3.708.335</b>			
2.500.000	BNZ International Funding Ltd/London 'GMTN' 0.375% 14-Sep-2024	2.521.863	0,26
1.161.000	Chorus Ltd 'EMTN' 1.125% 18-Oct-2023	1.186.472	0,12
<b>Norwegen - 2.689.852</b>			
2.676.000	DNB Bank ASA 'EMTN' 0.050% 14-Nov-2023	2.689.852	0,27
<b>Polen - 1.956.211</b>			
1.989.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	1.956.211	0,20

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert- Zeitwert EUR	Summe Nettowert- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Portugal - 6.251.225</b>			
4.900.000	Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031	5.266.422	0,54
918.000	Ren Finance BV 'EMTN' 1.750% 18-Jan-2028	984.803	0,10
<b>Republik Korea - 784.811</b>			
780.000	LG Chem Ltd 'REGS' 0.500% 15-Apr-2023	784.811	0,08
<b>Spanien - 73.504.699</b>			
6.700.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	6.582.214	0,67
2.300.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	2.344.591	0,24
500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 3.104% 15-Jul-2031	608.136	0,06
1.200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 0.875% 05-Mar-2023	1.212.808	0,12
1.800.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.625% 07-Mar-2024	1.853.072	0,19
2.600.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	2.511.158	0,26
2.000.000	Banco Santander SA 'EMTN' 0.200% 11-Feb-2028	1.966.118	0,20
1.500.000	Banco Santander SA 'EMTN' 0.300% 04-Oct-2026	1.501.042	0,15
1.900.000	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	1.896.570	0,19
1.000.000	Bankinter SA 0.875% 05-Mar-2024	1.019.071	0,10
6.200.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	6.236.146	0,63
900.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1.000% 25-Jun-2024	919.816	0,09
2.300.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1.750% 24-Oct-2023	2.371.946	0,24
3.500.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Nov-2026	3.485.895	0,35
3.400.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031	3.406.188	0,35
1.900.000	CaixaBank SA FRN 3.375% 15-Mar-2027	1.913.072	0,19
1.500.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033	1.428.458	0,15
2.000.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	1.923.890	0,20
2.609.000	FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027	2.862.243	0,29
2.700.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Nov-2027	2.706.750	0,28
2.900.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.450% 09-Nov-2026	2.908.159	0,30
1.400.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.874% 28-Jan-2026	1.429.680	0,15
1.800.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.875% 22-Feb-2023	1.839.435	0,19
2.100.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 2.250% 28-Jan-2029	2.145.780	0,22
500.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 3.250% 12-Nov-2024	537.938	0,05
1.800.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.350% 14-Oct-2028	1.859.294	0,19
600.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025	629.412	0,06
1.200.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 2.000% 17-Apr-2026	1.273.740	0,13
2.600.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	2.580.474	0,26
1.500.000	Red Electrica Financiaciones SAU 'EMTN' 0.375% 24-Jul-2028	1.519.568	0,15
400.000	Red Electrica Financiaciones SAU 'EMTN' 1.000% 21-Apr-2026	416.628	0,04
2.400.000	Santander Consumer Finance SA 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2024	2.419.752	0,25
2.400.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	2.288.160	0,23
2.700.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	2.907.495	0,30
<b>Schweden - 1.771.399</b>			
4.483.000	Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 1.000% 13-Apr-2028	4.468.632	0,46
1.500.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.000% 12-Aug-2027	1.486.900	0,15
2.714.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	2.640.594	0,27
1.545.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 0.750% 14-Dec-2028	1.478.707	0,15
3.562.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029	3.448.372	0,35
1.590.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'GMTN' 0.300% 17-Feb-2022	1.591.447	0,16

## Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Summe Nettowert mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Schweden Forts.</b>			
2.540.000	Swedbank AB 'EMTN' 0.750% 05-May-2025	2.597.747	0,26
<b>Schweiz - 30.574.033</b>			
2.044.000	Adecco International Financial Services BV 'EMTN' 0.500% 21-Sep-2031	1.972.000	0,20
3.100.000	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 17-Sep-2025	3.203.274	0,33
4.016.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.250% 05-Jan-2026	4.005.659	0,41
480.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	475.970	0,05
6.803.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	7.406.177	0,75
900.000	Givaudan Finance Europe BV 1.000% 22-Apr-2027	937.850	0,10
604.000	Givaudan Finance Europe BV 1.625% 22-Apr-2032	655.669	0,07
1.380.000	Nestle Finance International Ltd 0.000% 03-Dec-2025	1.379.043	0,14
1.840.000	Richemont International Holding SA 1.125% 26-May-2032	1.919.307	0,19
1.363.000	Swisscom Finance BV 0.375% 14-Nov-2028	1.375.519	0,14
2.776.000	UBS Group AG 0.875% 03-Nov-2031	2.771.225	0,28
4.340.000	UBS Group AG 1.500% 30-Nov-2024	4.472.340	0,45
<b>Vereinigtes Königreich - 134.957.479</b>			
2.400.000	Annington Funding Plc 'EMTN' 1.650% 12-Jul-2024	2.483.466	0,25
625.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.875% 03-Jul-2044	676.251	0,07
1.794.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 2.000% 07-Feb-2028	1.827.220	0,19
3.893.000	Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029	3.810.702	0,39
2.701.000	Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032	2.681.310	0,27
4.080.000	BP Capital Markets BV 1.467% 21-Sep-2041	3.975.776	0,40
1.778.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.250% 22-Mar-2026	1.884.769	0,19
1.895.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029	2.040.441	0,21
2.900.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2025	2.917.328	0,30
1.720.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.000% 21-Nov-2024	1.751.876	0,18
1.278.000	Cadent Finance Plc 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2032	1.242.954	0,13
6.112.000	CCEP Finance Ireland DAC 0.875% 06-May-2033	6.010.938	0,61
2.999.000	CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024	2.993.061	0,30
4.984.000	CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.625% 03-Jul-2029	5.240.601	0,53
4.949.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 0.750% 24-Feb-2022	4.952.984	0,50
2.233.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.125% 26-May-2024	2.289.750	0,23
2.862.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.750% 27-Mar-2026	3.033.838	0,31
4.170.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.250% 21-May-2026	4.381.053	0,45
652.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.750% 21-May-2030	719.309	0,07
4.718.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	4.647.560	0,47
4.404.000	Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025	4.568.732	0,46
1.400.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.125% 08-Oct-2030	1.386.546	0,14
2.232.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 23-May-2022	2.250.503	0,23
900.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.309% 13-Nov-2026	898.830	0,09
1.455.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029	1.447.289	0,15
4.800.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028	5.976.866	0,61
1.093.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 1.625% 08-Oct-2024	1.130.862	0,11
2.675.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027	2.836.987	0,29
2.162.000	London Stock Exchange Group Plc 'EMTN' 1.750% 06-Dec-2027	2.324.322	0,24
1.256.000	National Grid Electricity Transmission Plc 0.190% 20-Jan-2025	1.260.131	0,13
2.582.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN' 0.823% 07-Jul-2032	2.571.750	0,26
1.467.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 0.780% 26-Feb-2030	1.449.359	0,15

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Summe Nettowert mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigtes Königreich Forts.</b>			
4.691.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 1.043% 14-Sep-2032	4.621.339	0,47
3.289.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 0.125% 12-Nov-2025	3.274.940	0,33
500.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 1.000% 28-May-2024	512.459	0,05
1.533.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 4.375% 24-Jan-2029	1.781.154	0,18
5.361.000	RELX Finance BV 0.000% 18-Mar-2024	5.373.070	0,55
1.433.000	RELX Finance BV 0.500% 10-Mar-2028	1.438.277	0,15
3.599.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	3.591.370	0,36
2.505.000	Standard Chartered Plc FRN 2.500% 09-Sep-2030	2.626.872	0,27
2.496.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	2.401.452	0,24
3.180.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 1.375% 24-Oct-2023	3.253.092	0,33
990.000	Unilever Finance Netherlands BV 1.750% 25-Mar-2030	1.092.444	0,11
1.165.000	Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	1.235.354	0,13
1.464.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 0.375% 27-May-2024	1.471.122	0,15
3.140.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	3.736.800	0,38
635.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 2.200% 25-Aug-2026	693.056	0,07
956.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 2.500% 24-May-2039	1.083.518	0,11
860.000	Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080	869.494	0,09
3.570.000	Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079	3.689.988	0,37
4.584.000	Yorkshire Building Society 'EMTN' 0.500% 01-Jul-2028	4.548.314	0,46
<b>Vereinigte Staaten von Amerika - 178.049.187</b>			
1.096.000	Abbott Ireland Financing DAC 1.500% 27-Sep-2026	1.164.544	0,12
1.002.000	AbbVie Inc 0.750% 18-Nov-2027	1.019.037	0,10
1.970.000	American International Group Inc 1.875% 21-Jun-2027	2.094.545	0,21
2.140.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 2.000% 01-Sep-2028	2.119.017	0,22
2.123.000	AT&T Inc 0.250% 04-Mar-2026	2.118.552	0,21
2.853.000	AT&T Inc 1.950% 15-Sep-2023	2.942.222	0,30
7.325.000	AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036	8.730.604	0,89
1.145.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.580% 08-Aug-2029	1.136.575	0,12
3.132.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.808% 09-May-2026	3.190.315	0,32
1.280.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.379% 07-Feb-2025	1.316.683	0,13
400.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.381% 09-May-2030	417.844	0,04
2.298.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.667% 02-Jun-2029	2.703.343	0,27
3.580.000	Becton Dickinson and Co 1.000% 15-Dec-2022	3.619.865	0,37
2.400.000	Becton Dickinson and Co 1.401% 24-May-2023	2.448.276	0,25
1.387.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	1.364.031	0,14
1.289.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 04-Jun-2023	1.301.748	0,13
1.504.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026	1.556.927	0,16
776.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 12-Feb-2036	760.831	0,08
1.630.000	Berry Global Inc 'REGS' 1.500% 15-Jan-2027	1.663.594	0,17
916.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Jun-2027	938.151	0,10
1.580.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029	1.607.690	0,16
828.000	Chubb INA Holdings Inc 1.400% 15-Jun-2031	872.233	0,09
1.935.000	Chubb INA Holdings Inc 1.550% 15-Mar-2028	2.052.168	0,21
1.247.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0.500% 08-Oct-2027	1.248.291	0,13
5.941.000	Coca-Cola Co/The 0.800% 15-Mar-2040	5.617.598	0,57
1.150.000	Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.875% 12-Nov-2039	1.144.410	0,12
7.034.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	6.944.070	0,71
2.335.000	Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032	2.327.119	0,24
640.000	Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024	665.100	0,07
1.793.000	Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030	2.055.531	0,21
1.200.000	DH Europe Finance II Sarl 0.750% 18-Sep-2031	1.197.093	0,12



**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
<b>Anleihen Forts.</b>			
<b>Vereinigte Staaten von Amerika Forts.</b>			
870.000	DH Europe Finance II Sarl 1.350% 18-Sep-2039	871.124	0,09
588.000	Dow Chemical Co/The 1.125% 15-Mar-2032	588.812	0,06
2.248.000	Ecolab Inc 1.000% 15-Jan-2024	2.293.825	0,23
2.089.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	1.911.727	0,19
3.225.000	FedEx Corp 0.450% 04-May-2029	3.176.948	0,32
1.220.000	FedEx Corp 1.300% 05-Aug-2031	1.258.729	0,13
736.000	Fidelity National Information Services Inc 1.000% 03-Dec-2028	749.451	0,08
1.961.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	2.051.414	0,21
1.266.000	Fidelity National Information Services Inc 2.000% 21-May-2030	1.376.137	0,14
2.970.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	3.275.895	0,33
4.073.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	3.973.639	0,40
4.385.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	4.243.781	0,43
900.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 01-Nov-2028	979.097	0,10
6.041.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024	6.049.759	0,61
2.961.000	International Flavors & Fragrances Inc 1.800% 25-Sep-2026	3.138.761	0,32
4.303.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.389% 24-Feb-2028	4.275.569	0,43
2.962.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.597% 17-Feb-2033	2.859.041	0,29
1.990.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.090% 11-Mar-2027	2.049.994	0,21
1.300.000	McDonald's Corp 1.600% 15-Mar-2031	1.392.604	0,14
1.059.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032	1.060.281	0,11
1.270.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 07-Mar-2027	1.325.888	0,13
3.920.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 15-Oct-2040	3.926.836	0,40
1.720.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039	1.777.170	0,18
865.000	Mondelez International Inc 0.750% 17-Mar-2033	833.735	0,08
2.585.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 0.637% 26-Jul-2024	2.615.792	0,27
2.771.000	Morgan Stanley FRN 0.495% 26-Oct-2029	2.724.572	0,28
5.326.000	Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	5.163.717	0,52
2.723.000	Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033	2.727.221	0,28
760.000	Nasdaq Inc 1.750% 28-Mar-2029	813.515	0,08
4.082.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN' 0.875% 18-Jul-2025	4.206.052	0,43
1.880.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028	1.899.138	0,19
1.290.000	PepsiCo Inc 0.750% 18-Mar-2027	1.326.889	0,13
500.000	PepsiCo Inc 0.875% 16-Oct-2039	490.130	0,05
2.718.000	PepsiCo Inc 'EMTN' 0.500% 06-May-2028	2.749.554	0,28
1.070.000	Prologis Euro Finance LLC 0.500% 16-Feb-2032	1.021.002	0,10
1.243.000	Prologis Euro Finance LLC 1.000% 06-Feb-2035	1.208.918	0,12
2.307.000	Simon International Finance SCA 1.125% 19-Mar-2033	2.271.034	0,23
1.945.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031	1.691.703	0,17
1.100.000	Stellantis NV 2.750% 15-May-2026	1.202.588	0,12
2.170.000	Stellantis NV 3.875% 05-Jan-2026	2.446.770	0,25
781.000	Stellantis NV 'EMTN' 0.625% 30-Mar-2027	777.630	0,08
2.776.000	Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033	2.710.375	0,28
1.100.000	Stellantis NV 'EMTN' 2.000% 23-Mar-2024	1.145.942	0,12
3.155.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041	3.215.371	0,33
2.050.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032	2.352.027	0,24
2.688.000	Trinity Acquisition Plc 2.125% 26-May-2022	2.696.534	0,27
3.050.000	Verizon Communications Inc 1.850% 18-May-2040	3.209.131	0,33
3.005.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	3.605.358	0,37
<b>Gesamtanlagen in Anleihen</b>		<b>949.471.549</b>	<b>96,47</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
<b>Offene Terminkontrakte - 1.162.238</b>				
(173)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(29.647.010)	449.189	0,05
(77)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(15.918.980)	677.529	0,07
(61)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(9.071.922)	35.520	0,00
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>1.162.238</b>	<b>0,12</b>
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 34.951 (siehe unten)			34.951	0,00
<b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>950.668.738</b>	<b>96,59</b>

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
<b>Credit Default Swaps - (1.295.007)</b>			
50.000.000	CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026	(1.295.007)	(0,13)
<b>Credit Default Swaps insgesamt</b>			<b>(1.295.007)</b> <b>(0,13)</b>

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
<b>Offene Terminkontrakte - (206.623)</b>				
131	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022	17.454.440	(104.960)	(0,01)
45	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022	5.041.350	(5.329)	(0,00)
(15)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.728.226)	(13.586)	(0,00)
(52)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(6.715.497)	(78.684)	(0,01)
(13)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(1.388.683)	(3.439)	(0,00)
(1)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022	(141.251)	(625)	(0,00)
<b>Offene Terminkontrakte insgesamt</b>			<b>(206.623)</b>	<b>(0,02)</b>
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (605.016) (siehe unten)			(605.016)	(0,06)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt</b>			<b>(2.106.646)</b>	<b>(0,21)</b>

<b>Nettoumlaufvermögen</b>			<b>35.673.712</b>	<b>3,62</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>			<b>984.235.804</b>	<b>100,00</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.  
Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Credit Suisse AG.  
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Morgan Stanley.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,16
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,12
OTC-derivative Finanzinstrumente	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen	3,72
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021**

<b>Devisenterminkontrakte</b>						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
<b>BNY Mellon Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund</b>						
US-Dollar	Euro	1.373.000	1.185.993	7. Jan. 22	Barclays Bank PLC	26.990
US-Dollar	Euro	2.718.000	2.392.579	21. Jan. 22	JPMorgan Chase Bank	7.961
<b>EUR</b>						<b>34.951</b>
Euro	US-Dollar	13.624.526	15.854.000	7. Jan. 22	Barclays Bank PLC	(381.764)
US-Dollar	Euro	648.000	573.623	7. Jan. 22	UBS AG	(1.144)
Euro	US-Dollar	1.198.460	1.389.000	21. Jan. 22	RBC Capital Markets	(28.306)
Euro	Pfund Sterling	13.041.887	11.122.000	25. Jan. 22	Morgan Stanley	(193.802)
<b>EUR</b>						<b>(605.016)</b>



# GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund
	Erläute- rungen	EUR	GBP	EUR
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		744	820	82
Dividendenerträge		25	4.035.104	462.550
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	53.881	4.421	7.171
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		12.496.627	(6.389.825)	3.436.424
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		8.096.683	4.693.219	1.476.619
<b>Gesamtertrag</b>		<b>20.647.960</b>	<b>2.343.739</b>	<b>5.382.846</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	1.036.465	1.440.412	249.380
Performancegebühr	3	160	4.569	92.174
Verwahrstellengebühr	5	163.661	49.667	21.955
Betriebliche Aufwendungen	7	214.031	192.327	76.825
Dividendenaufwand		–	3.579.430	536.769
Finanzierungskosten für Swaps		47.969	683.552	978.654
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	(1.729)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>1.462.286</b>	<b>5.949.957</b>	<b>1.954.028</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>19.185.674</b>	<b>(3.606.218)</b>	<b>3.428.818</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		264.189	3.883	24.163
Ausschüttungen		1.675.042	381.509	–
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>17.246.443</b>	<b>(3.991.610)</b>	<b>3.404.655</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(96.542)	(139.426)	(3.249)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>17.149.901</b>	<b>(4.131.036)</b>	<b>3.401.406</b>

Außer bei den im Geschäftsjahr geschlossen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Asian Equity Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
580	338	65	10.952	-	61	2.358	1.004	25
556.713	755.561	253.412	3.963.629	-	2.227	6.767.494	-	-
672	10	292.675	-	-	168	24.015	6.798	182
11.258.202	4.008.339	2.006.670	2.004.602	(528.312)	144.181	64.340.044	(1.792.483)	2.355.013
(17.060.147)	(2.510.940)	(7.116.744)	(10.367.733)	300.243	(88.626)	78.747.912	(2.179.677)	(2.945.647)
<b>(5.243.980)</b>	<b>2.253.308</b>	<b>(4.563.922)</b>	<b>(4.388.550)</b>	<b>(228.069)</b>	<b>58.011</b>	<b>149.881.823</b>	<b>(3.964.358)</b>	<b>(590.427)</b>
1.243.097	170.485	568.046	835.772	15.975	9.260	1.828.453	193.685	14.631
-	-	-	-	-	-	-	-	-
105.042	51.937	23.228	43.897	1.927	3.862	134.738	74.784	32.169
110.988	27.970	64.366	62.184	6.781	3.757	514.651	162.630	42.696
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	(60.224)	(23.900)	-	(3.704)	(8.335)	(176.064)	(106.619)	(57.406)
<b>1.459.127</b>	<b>190.168</b>	<b>631.740</b>	<b>941.853</b>	<b>20.979</b>	<b>8.544</b>	<b>2.301.778</b>	<b>324.480</b>	<b>32.090</b>
<b>(6.703.107)</b>	<b>2.063.140</b>	<b>(5.195.662)</b>	<b>(5.330.403)</b>	<b>(249.048)</b>	<b>49.467</b>	<b>147.580.045</b>	<b>(4.288.838)</b>	<b>(622.517)</b>
427	279	901	7.555	30	13	935	1.679	41
-	721.118	25.893	62.302	-	11.623	3.166.605	5.403.906	482.922
<b>(6.703.534)</b>	<b>1.341.743</b>	<b>(5.222.456)</b>	<b>(5.400.260)</b>	<b>(249.078)</b>	<b>37.831</b>	<b>144.412.505</b>	<b>(9.694.423)</b>	<b>(1.105.480)</b>
(225.264)	(79.531)	(104.620)	(2.640.898)	-	12.149	(1.919.294)	(21.849)	1.847
<b>(6.928.798)</b>	<b>1.262.212</b>	<b>(5.327.076)</b>	<b>(8.041.158)</b>	<b>(249.078)</b>	<b>49.980</b>	<b>142.493.211</b>	<b>(9.716.272)</b>	<b>(1.103.633)</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund
	Erläute- rungen	USD	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		1.912	1.008	683
Dividendenerträge		–	–	21.034
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	302.252	71.131	205.197
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		91.058.842	48.675.732	17.420.740
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		(17.286.501)	(37.467.897)	(37.496.760)
<b>Gesamtertrag</b>		<b>74.076.505</b>	<b>11.279.974</b>	<b>(19.849.106)</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	605.458	788.812	2.647.176
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	225.026	109.037	88.283
Betriebliche Aufwendungen	7	1.067.660	678.270	424.981
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(233.122)	(304.072)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>1.665.022</b>	<b>1.272.047</b>	<b>3.160.440</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>72.411.483</b>	<b>10.007.927</b>	<b>(23.009.546)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		89	4.329	29.018
Ausschüttungen		65.132.871	38.272.262	12.183.016
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>7.278.523</b>	<b>(28.268.664)</b>	<b>(35.221.580)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(209.611)	32.534	(84.777)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>7.068.912</b>	<b>(28.236.130)</b>	<b>(35.306.357)</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Food Fund*	BNY Mellon Future Life Fund*
USD	USD	USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD
41	869	202	1.616	1.178	1	876	18	17
-	-	-	4.405	111.544	-	33.131	40.992	38.636
4.532	3.325	1.221	20.215	41.463	3.854	-	-	-
2.222.494	(4.836.747)	1.276.899	9.136.300	11.463.665	985.228	9.672	31.033	1.911
(2.720.210)	(8.024.218)	(2.549.506)	(20.163.922)	(20.660.147)	(802.918)	142.307	211.645	330.904
<b>(493.143)</b>	<b>(12.856.771)</b>	<b>(1.271.184)</b>	<b>(11.001.386)</b>	<b>(9.042.297)</b>	<b>186.165</b>	<b>185.986</b>	<b>283.688</b>	<b>371.468</b>
396.722	1.192.702	4.117	712.826	2.561.354	41.697	15.844	16.140	14.726
-	-	-	-	-	-	-	-	-
16.606	127.689	34.655	134.618	94.225	16.045	4.077	7.822	5.204
38.661	141.462	15.657	150.194	250.041	23.297	16.969	17.492	17.063
-	-	-	-	-	5	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	(51.673)	-	-	(18.419)	(22.126)	(19.529)
<b>451.989</b>	<b>1.461.853</b>	<b>54.429</b>	<b>945.965</b>	<b>2.905.620</b>	<b>81.044</b>	<b>18.471</b>	<b>19.328</b>	<b>17.464</b>
<b>(945.132)</b>	<b>(14.318.624)</b>	<b>(1.325.613)</b>	<b>(11.947.351)</b>	<b>(11.947.917)</b>	<b>105.121</b>	<b>167.515</b>	<b>264.360</b>	<b>354.004</b>
333	2.929	919	6.201	51.479	8.826	-	16	7
210.472	1.037.410	1.491.597	8.665.311	575.367	338.257	-	-	-
<b>(1.155.937)</b>	<b>(15.358.963)</b>	<b>(2.818.129)</b>	<b>(20.618.863)</b>	<b>(12.574.763)</b>	<b>(241.962)</b>	<b>167.515</b>	<b>264.344</b>	<b>353.997</b>
(487)	510.974	(16.752)	(287.853)	(51.756)	(4.080)	(5.433)	(9.299)	(8.486)
<b>(1.156.424)</b>	<b>(14.847.989)</b>	<b>(2.834.881)</b>	<b>(20.906.716)</b>	<b>(12.626.519)</b>	<b>(246.042)</b>	<b>162.082</b>	<b>255.045</b>	<b>345.511</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund
	Erläute- rungen	USD	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		14.719	1.329	7.635
Dividendenerträge		433.467	19.409	570.697
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	122.766	116.623	40.845
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		13.296.553	46.165.194	10.638.462
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		(53.056.310)	(45.723.538)	(26.222.538)
<b>Gesamtertrag</b>		<b>(39.188.805)</b>	<b>579.017</b>	<b>(14.964.899)</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	2.997.683	162.936	2.738.081
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	154.067	156.214	165.649
Betriebliche Aufwendungen	7	531.384	365.393	478.072
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	9.780	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	(19.750)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>3.683.134</b>	<b>674.573</b>	<b>3.381.802</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>(42.871.939)</b>	<b>(95.556)</b>	<b>(18.346.701)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		11.740	10.315	1.929
Ausschüttungen		1.407.358	16.671.356	5.106.977
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>(44.291.037)</b>	<b>(16.777.227)</b>	<b>(23.455.607)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(137.114)	(20.770)	(24.523)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(44.428.151)</b>	<b>(16.797.997)</b>	<b>(23.480.130)</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.



Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund*	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)
USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	USD	EUR
593	4.237	7.417	4.873	1.309	57	37.331	390	1.499
558.347	7.925.249	21.734.782	-	11.287.863	493.952	126.866	659.034	48.493.424
371	12.175	82.525	33.846	67.785	775	58	1.134	143.577
10.216.313	46.520.818	122.376.150	13.640.540	9.152.146	1.255.585	887.555	4.604.624	91.975.060
(14.720.450)	29.915.266	(53.700.848)	(8.575.049)	9.457.103	7.982.863	475	2.017.334	109.893.452
<b>(3.944.826)</b>	<b>84.377.745</b>	<b>90.500.026</b>	<b>5.104.210</b>	<b>29.966.206</b>	<b>9.733.232</b>	<b>1.052.285</b>	<b>7.282.516</b>	<b>250.507.012</b>
692.686	4.345.716	6.948.912	1.117.233	1.385.266	414.143	27.894	732.160	23.087.274
-	-	-	-	-	-	-	-	-
111.444	129.642	143.044	66.115	53.365	16.352	11.565	24.528	627.464
116.798	513.999	655.316	156.955	235.288	57.832	20.407	45.435	2.038.558
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
(40.077)	-	-	-	(31.758)	(1.592)	(19.893)	-	-
<b>880.851</b>	<b>4.989.357</b>	<b>7.747.272</b>	<b>1.340.303</b>	<b>1.642.161</b>	<b>486.735</b>	<b>39.973</b>	<b>802.123</b>	<b>25.753.296</b>
<b>(4.825.677)</b>	<b>79.388.388</b>	<b>82.752.754</b>	<b>3.763.907</b>	<b>28.324.045</b>	<b>9.246.497</b>	<b>1.012.312</b>	<b>6.480.393</b>	<b>224.753.716</b>
1.327	1.568	1.396	8.953	2.333	-	1.329	75	659.135
-	1.923.451	15.506.737	3.302.797	8.651.742	80.789	199.273	25	13.783.430
<b>(4.827.004)</b>	<b>77.463.369</b>	<b>67.244.621</b>	<b>452.157</b>	<b>19.669.970</b>	<b>9.165.708</b>	<b>811.710</b>	<b>6.480.293</b>	<b>210.311.151</b>
65.845	(1.307.125)	(3.936.965)	(20.785)	(2.244.278)	(96.985)	2.203	(98.256)	(4.952.902)
<b>(4.761.159)</b>	<b>76.156.244</b>	<b>63.307.656</b>	<b>431.372</b>	<b>17.425.692</b>	<b>9.068.723</b>	<b>813.913</b>	<b>6.382.037</b>	<b>205.358.249</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
	Erläute- rungen	GBP	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		165	10.084	3.374
Dividendenerträge		965.560	5.580.902	40.952
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	1.210	7.164	327.424
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		3.559.131	13.328.541	45.153.011
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		329.565	10.192.140	(23.679.740)
<b>Gesamtertrag</b>		<b>4.855.631</b>	<b>29.118.831</b>	<b>21.845.021</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	261.204	3.211.828	3.009.070
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	57.354	134.497	137.111
Betriebliche Aufwendungen	7	52.778	365.026	695.756
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	(41.692)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>371.336</b>	<b>3.711.351</b>	<b>3.800.245</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>4.484.295</b>	<b>25.407.480</b>	<b>18.044.776</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		80	2.103	13.190
Ausschüttungen		787.639	1.229.738	33.824.941
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>3.696.576</b>	<b>24.175.639</b>	<b>(15.793.355)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(92.994)	(553.838)	(89.144)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.603.582</b>	<b>23.621.801</b>	<b>(15.882.499)</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)
USD	JPY	EUR	USD	USD	EUR	USD	EUR	EUR
670	11.216	2.793	1.734	36	181	9	81	2
428.841	256.778.554	19.518.216	5.237.693	24.171	1.952.115	15.189	-	866.355
1.738	13.123.162	64.771	261.471	52	24.625	-	-	-
1.215.515	1.566.639.963	206.902.326	23.461.452	15.228.968	9.363.098	224.527	(1.865.156)	(913.707)
1.015.376	1.040.431.984	167.357.917	77.933.487	(14.876.015)	3.787.892	(218.916)	2.606.111	4.936.401
<b>2.662.140</b>	<b>2.876.984.879</b>	<b>393.846.023</b>	<b>106.895.837</b>	<b>377.212</b>	<b>15.127.911</b>	<b>20.809</b>	<b>741.036</b>	<b>4.889.051</b>
53	158.018.029	15.903.576	7.410.977	10.826	906.702	37.924	921.253	401.374
-	-	-	-	-	-	-	-	-
19.183	6.266.665	243.541	186.943	8.593	20.015	4.392	108.810	76.488
21.023	21.004.923	1.091.227	874.878	9.747	65.193	14.946	227.824	58.647
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
(3.000)	-	-	(64.395)	(8.925)	-	(13.183)	(77.364)	(48.591)
<b>37.259</b>	<b>185.289.617</b>	<b>17.238.344</b>	<b>8.408.403</b>	<b>20.241</b>	<b>991.910</b>	<b>44.079</b>	<b>1.180.523</b>	<b>487.918</b>
<b>2.624.881</b>	<b>2.691.695.262</b>	<b>376.607.679</b>	<b>98.487.434</b>	<b>356.971</b>	<b>14.136.001</b>	<b>(23.270)</b>	<b>(439.487)</b>	<b>4.401.133</b>
9	1.822.265	9.400	32.046	351	9.504	2	82.971	16.687
365.925	55.806.239	2.317.436	193.544	-	49.601	-	4.765.767	282.715
<b>2.258.947</b>	<b>2.634.066.758</b>	<b>374.280.843</b>	<b>98.261.844</b>	<b>356.620</b>	<b>14.076.896</b>	<b>(23.272)</b>	<b>(5.288.225)</b>	<b>4.101.731</b>
(63.930)	(38.516.786)	(4.434.218)	(1.084.151)	(2.140)	(242.690)	(4.665)	(49.737)	(97.679)
<b>2.195.017</b>	<b>2.595.549.972</b>	<b>369.846.625</b>	<b>97.177.693</b>	<b>354.480</b>	<b>13.834.206</b>	<b>(27.937)</b>	<b>(5.337.962)</b>	<b>4.004.052</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
	Erläute- rungen	USD	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		473	89	490
Dividendenerträge		–	11.292	7.135.925
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	4	19.001
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		5.205.669	908.221	40.483.966
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		(6.236.512)	(560.743)	21.766.096
<b>Gesamtertrag</b>		<b>(1.030.370)</b>	<b>358.863</b>	<b>69.405.478</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	633.996	12.982	1.416.263
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	35.881	11.709	56.981
Betriebliche Aufwendungen	7	95.180	10.673	273.644
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	(18.127)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>765.057</b>	<b>17.237</b>	<b>1.746.888</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>(1.795.427)</b>	<b>341.626</b>	<b>67.658.590</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		843	57	9.876
Ausschüttungen		626.274	–	5.115.342
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>(2.422.544)</b>	<b>341.569</b>	<b>62.533.372</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(14.822)	(374)	(1.732.547)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(2.437.366)</b>	<b>341.195</b>	<b>60.800.825</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021^
USD	EUR	USD
1.716	1	137.217
-	-	168.392.043
-	-	2.556.661
(10.240.833)	4.197.924	1.070.709.345
(7.572.511)	(5.469.039)	153.219.198
<b>(17.811.628)</b>	<b>(1.271.114)</b>	<b>1.395.014.464</b>
3.832.087	2.414.349	112.390.537
-	-	115.463
102.257	108.272	4.911.071
949.683	617.148	16.097.435
-	-	5.557.602
-	-	2.163.809
-	(79.105)	(1.595.729)
<b>4.884.027</b>	<b>3.060.664</b>	<b>139.640.188</b>
<b>(22.695.655)</b>	<b>(4.331.778)</b>	<b>1.255.374.276</b>
11.599	82.995	1.619.010
22.040.535	1.174.328	284.782.598
<b>(44.747.789)</b>	<b>(5.589.101)</b>	<b>968.972.668</b>
-	(135.769)	(28.996.546)
<b>(44.747.789)</b>	<b>(5.724.870)</b>	<b>939.976.122</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund
	Erläute- rungen	EUR	GBP	EUR
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		5.686	4.792	638
Dividendenerträge		–	4.279.177	217.693
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	29.252	14.979	–
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(4.464.261)	13.813.017	1.529.345
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		327.230	(266.433)	1.413.219
<b>Gesamtertrag</b>		<b>(4.102.093)</b>	<b>17.845.532</b>	<b>3.160.895</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	1.104.103	2.047.186	170.026
Performancegebühr	3	19.018	–	328.341
Verwahrstellengebühr	5	197.876	90.503	19.343
Betriebliche Aufwendungen	7	233.986	306.055	36.194
Dividendenaufwand		–	3.366.266	85.852
Finanzierungskosten für Swaps		–	806.506	343.088
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	(15.768)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>1.554.983</b>	<b>6.616.516</b>	<b>967.076</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>(5.657.076)</b>	<b>11.229.016</b>	<b>2.193.819</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		127.898	3.831	15.459
Ausschüttungen		1.938.423	460.734	–
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>(7.723.397)</b>	<b>10.764.451</b>	<b>2.178.360</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(203.744)	215.998	(17)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(7.927.141)</b>	<b>10.980.449</b>	<b>2.178.343</b>

Außer bei den im Geschäftsjahr geschlossen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit.  
Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

\*\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asia Rising Stars Fund**	BNY Mellon Asian Equity Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund*	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
236	–	23	98	46.373	1.064	11.506	51	42
114.573	300.155	1.135.433	177.953	1.476.270	66.960	5.910.616	–	–
10.616	12.083	–	1.734	–	244	11.913	16	10
(481.300)	9.245.020	159.574	373.229	(3.425.440)	(113.183)	14.631.419	495.961	5.184.361
98.306	14.069.279	1.674.181	4.569.998	(15.245.843)	77.567	75.290.078	857.707	3.662.888
<b>(257.569)</b>	<b>23.626.537</b>	<b>2.969.211</b>	<b>5.123.012</b>	<b>(17.148.640)</b>	<b>32.652</b>	<b>95.855.532</b>	<b>1.353.735</b>	<b>8.847.301</b>
42.322	764.979	231.173	116.054	992.710	139.603	1.279.503	14.856	35.755
–	–	–	–	–	–	–	–	–
22.571	91.969	79.931	20.828	156.816	18.541	181.761	5.191	62.036
32.589	70.496	35.916	38.398	85.700	21.468	339.757	11.532	43.189
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(20.834)	–	(88.362)	(43.921)	–	(421)	(184.495)	(9.662)	(63.115)
<b>76.648</b>	<b>927.444</b>	<b>258.658</b>	<b>131.359</b>	<b>1.235.226</b>	<b>179.191</b>	<b>1.616.526</b>	<b>21.917</b>	<b>77.865</b>
<b>(334.217)</b>	<b>22.699.093</b>	<b>2.710.553</b>	<b>4.991.653</b>	<b>(18.383.866)</b>	<b>(146.539)</b>	<b>94.239.006</b>	<b>1.331.818</b>	<b>8.769.436</b>
198	36	16	94	5.759	84	612	113	411
68.126	–	1.035.599	78.793	189.073	303.463	1.754.527	43.563	545.303
<b>(402.541)</b>	<b>22.699.057</b>	<b>1.674.938</b>	<b>4.912.766</b>	<b>(18.578.698)</b>	<b>(450.086)</b>	<b>92.483.867</b>	<b>1.288.142</b>	<b>8.223.722</b>
(12.405)	(496.482)	(107.468)	(38.594)	(4.236.523)	(19.607)	(1.821.087)	(1.282)	(3.142)
<b>(414.946)</b>	<b>22.202.575</b>	<b>1.567.470</b>	<b>4.874.172</b>	<b>(22.815.221)</b>	<b>(469.693)</b>	<b>90.662.780</b>	<b>1.286.860</b>	<b>8.220.580</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund
	Erläute- rungen	USD	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		150	6.289	1.923
Dividendenerträge		–	238.422	177.285
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	11.175	69.827	83.999
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		22.450.761	10.615.934	19.385.963
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		65.731.841	39.525.263	8.387.752
<b>Gesamtertrag</b>		<b>88.193.927</b>	<b>50.455.735</b>	<b>28.036.922</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	10.822	705.332	1.897.975
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	3.401	175.162	77.778
Betriebliche Aufwendungen	7	130.528	692.879	314.097
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(8.184)	(245.181)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>136.567</b>	<b>1.328.192</b>	<b>2.289.850</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>88.057.360</b>	<b>49.127.543</b>	<b>25.747.072</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		–	1.247	27.736
Ausschüttungen		178.586	43.738.714	8.812.544
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>87.878.774</b>	<b>5.387.582</b>	<b>16.906.792</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(204.591)	(119.978)	(5.245)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>87.674.183</b>	<b>5.267.604</b>	<b>16.901.547</b>



Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund
USD	USD	USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD
812	9.829	441	2.782	6.118	18	68.434	10.082	70.225
-	-	-	52.778	165.842	-	355.312	147.506	367.430
3.340	3.644	1.221	11.916	84.493	4.578	137.310	36.738	74.883
189.827	(72.083.968)	(36.330)	16.330.990	39.751.082	2.263.271	25.678.006	65.936.827	6.966.209
1.552.646	46.951.263	1.128.245	8.528.468	(26.295.085)	(76.461)	36.264.191	16.999.775	21.932.412
<b>1.746.625</b>	<b>(25.119.232)</b>	<b>1.093.577</b>	<b>24.926.934</b>	<b>13.712.450</b>	<b>2.191.406</b>	<b>62.503.253</b>	<b>83.130.928</b>	<b>29.411.159</b>
407.196	2.446.657	5.314	807.415	4.475.785	43.611	3.435.768	131.927	2.567.391
-	-	-	-	-	-	-	-	-
14.046	236.145	46.748	161.251	190.338	27.876	182.383	168.198	168.499
40.664	278.261	14.607	178.691	546.084	31.433	592.966	297.014	442.139
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	(55.570)	-	-	-	167	-
<b>461.906</b>	<b>2.961.063</b>	<b>66.669</b>	<b>1.091.787</b>	<b>5.212.207</b>	<b>102.920</b>	<b>4.211.117</b>	<b>597.306</b>	<b>3.178.029</b>
<b>1.284.719</b>	<b>(28.080.295)</b>	<b>1.026.908</b>	<b>23.835.147</b>	<b>8.500.243</b>	<b>2.088.486</b>	<b>58.292.136</b>	<b>82.533.622</b>	<b>26.233.130</b>
353	5.130	604	3.577	108.339	17.421	6.128	11.853	2.476
297.623	7.329.113	1.587.070	9.520.036	2.251.467	710.667	2.427.634	12.036.255	4.457.698
<b>986.743</b>	<b>(35.414.538)</b>	<b>(560.766)</b>	<b>14.311.534</b>	<b>6.140.437</b>	<b>1.360.398</b>	<b>55.858.374</b>	<b>70.485.514</b>	<b>21.772.956</b>
697	(987.863)	(58.780)	(516.128)	209.406	5.984	(141.754)	(63.940)	(117.432)
<b>987.440</b>	<b>(36.402.401)</b>	<b>(619.546)</b>	<b>13.795.406</b>	<b>6.349.843</b>	<b>1.366.382</b>	<b>55.716.620</b>	<b>70.421.574</b>	<b>21.655.524</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund
	Erläute- rungen	USD	USD	USD
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		14	43	613
Dividendenerträge		225.178	7.104.931	39.737.229
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	2.645	40.224	246.312
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		4.303.472	16.276.369	9.222.625
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		12.858.352	46.792.204	(116.758.360)
<b>Gesamtertrag</b>		<b>17.389.661</b>	<b>70.213.771</b>	<b>(67.551.581)</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	322.075	3.417.528	11.205.665
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	85.605	106.597	275.758
Betriebliche Aufwendungen	7	66.800	419.314	1.317.473
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(58.653)	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>415.827</b>	<b>3.943.439</b>	<b>12.798.896</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>16.973.834</b>	<b>66.270.332</b>	<b>(80.350.477)</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		206	559	5.554
Ausschüttungen		9.279	2.733.382	29.382.209
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>16.964.349</b>	<b>63.536.391</b>	<b>(109.738.240)</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(150.629)	(1.476.657)	(8.944.575)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>16.813.720</b>	<b>62.059.734</b>	<b>(118.682.815)</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
USD	USD	USD	EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD
17.454	1.494	982	10	36	1.523	1.400	8.579	10.518
–	6.371.034	904.303	712.169	741.403	41.154.994	909.157	4.301.382	480.101
13.566	1	3.689	3	4.545	371.524	5.024	22.278	423.900
3.957.217	5.048.676	19.141.779	690.131	845.320	139.597.038	1.559.764	6.788.033	3.824.702
5.849.378	7.838.138	(8.693.700)	(1.369.726)	1.068.705	9.999.181	1.516.250	16.150.180	24.378.397
<b>9.837.615</b>	<b>19.259.343</b>	<b>11.357.053</b>	<b>32.587</b>	<b>2.660.009</b>	<b>191.124.260</b>	<b>3.991.595</b>	<b>27.270.452</b>	<b>29.117.618</b>
819.743	589.266	548.347	134.185	705.785	21.085.514	269.528	2.135.026	2.905.179
–	–	–	–	–	–	–	–	–
48.229	58.991	19.596	25.528	60.027	842.193	80.954	157.035	131.235
106.650	131.771	66.955	28.488	47.360	2.325.609	84.647	250.716	590.856
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(40.917)	(484)	(29.124)	–	–	–	–	(10.524)
<b>974.622</b>	<b>739.111</b>	<b>634.414</b>	<b>159.077</b>	<b>813.172</b>	<b>24.253.316</b>	<b>435.129</b>	<b>2.542.777</b>	<b>3.616.746</b>
<b>8.862.993</b>	<b>18.520.232</b>	<b>10.722.639</b>	<b>(126.490)</b>	<b>1.846.837</b>	<b>166.870.944</b>	<b>3.556.466</b>	<b>24.727.675</b>	<b>25.500.872</b>
5.074	2.213	37	573	430	613.242	299	622	20.984
2.695.653	4.937.545	378.972	836.860	10.453	26.779.139	1.161.646	2.001.869	34.225.861
<b>6.162.266</b>	<b>13.580.474</b>	<b>10.343.630</b>	<b>(963.923)</b>	<b>1.835.954</b>	<b>139.478.563</b>	<b>2.394.521</b>	<b>22.725.184</b>	<b>(8.745.973)</b>
(7.813)	(1.344.383)	(191.153)	(42.130)	(146.859)	(3.459.799)	(79.773)	(341.643)	14.639
<b>6.154.453</b>	<b>12.236.091</b>	<b>10.152.477</b>	<b>(1.006.053)</b>	<b>1.689.095</b>	<b>136.018.764</b>	<b>2.314.748</b>	<b>22.383.541</b>	<b>(8.731.334)</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
	Erläute- rungen	USD	JPY	EUR
<b>Erträge</b>				
Erträge aus Bankzinsen		119	108.321	152.889
Dividendenerträge		316.608	185.533.502	23.101.046
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	1.748	51.797.199	137.030
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		1.165.662	(25.086.198)	3.747.943
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		3.416.695	1.358.617.819	81.383.405
<b>Gesamtertrag</b>		<b>4.900.832</b>	<b>1.570.970.643</b>	<b>108.522.313</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühr	3	44	101.360.517	14.399.976
Performancegebühr	3	–	–	319.072
Verwahrstellengebühr	5	21.376	4.336.167	206.615
Betriebliche Aufwendungen	7	26.074	16.689.129	1.317.124
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(10.432)	(1.067.025)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>37.062</b>	<b>121.318.788</b>	<b>16.242.787</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>4.863.770</b>	<b>1.449.651.855</b>	<b>92.279.526</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Bankzinsen		2	1.100.996	13.790
Ausschüttungen		480.699	63.226.899	2.319.581
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>4.383.069</b>	<b>1.385.323.960</b>	<b>89.946.155</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(46.648)	(27.497.048)	(4.893.756)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>4.336.421</b>	<b>1.357.826.912</b>	<b>85.052.399</b>

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
USD	USD	EUR	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD
1.617	167	43	–	90	5	4.193	68	31.276
1.834.091	697.766	990.657	1.681	–	320.143	–	565.690	9.234.489
31.542	1.785	41.880	–	–	–	–	1.569	13.599
20.716.552	6.928.420	1.135.636	51.460	7.373.715	126.743	1.606.584	2.489.817	(29.245.422)
108.899.832	(2.854.991)	(1.651.540)	(47.841)	(694.218)	1.572.238	7.186.777	(2.293.407)	(21.626.167)
<b>131.483.634</b>	<b>4.773.147</b>	<b>516.676</b>	<b>5.300</b>	<b>6.679.587</b>	<b>2.019.129</b>	<b>8.797.554</b>	<b>763.737</b>	<b>(41.592.225)</b>
1.954.153	257.607	663.539	1.745	470.658	157.336	547.178	278.923	1.463.082
–	–	–	–	–	–	–	–	–
106.586	97.810	43.364	462	110.229	71.089	44.821	27.271	62.278
256.288	58.785	46.961	806	168.910	30.482	86.853	27.114	284.818
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(61.857)	(43.243)	–	(960)	(92.298)	(64.881)	–	(56)	–
<b>2.255.170</b>	<b>370.959</b>	<b>753.864</b>	<b>2.053</b>	<b>657.499</b>	<b>194.026</b>	<b>678.852</b>	<b>333.252</b>	<b>1.810.178</b>
<b>129.228.464</b>	<b>4.402.188</b>	<b>(237.188)</b>	<b>3.247</b>	<b>6.022.088</b>	<b>1.825.103</b>	<b>8.118.702</b>	<b>430.485</b>	<b>(43.402.403)</b>
10.630	155	4.906	–	66.800	4.793	774	14	3.099
557.890	19	112.861	–	3.239.808	–	845.873	40	7.504.516
<b>128.659.944</b>	<b>4.402.014</b>	<b>(354.955)</b>	<b>3.247</b>	<b>2.715.480</b>	<b>1.820.310</b>	<b>7.272.055</b>	<b>430.431</b>	<b>(50.910.018)</b>
(390.487)	(194.137)	(163.550)	(504)	(125.743)	(37.683)	(5.966)	(148.963)	(2.315.525)
<b>128.269.457</b>	<b>4.207.877</b>	<b>(518.505)</b>	<b>2.743</b>	<b>2.589.737</b>	<b>1.782.627</b>	<b>7.266.089</b>	<b>281.468</b>	<b>(53.225.543)</b>

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Gesamt 31. Dezember 2020^
	Erläuterungen	USD	USD
<b>Erträge</b>			
Erträge aus Bankzinsen		3.460	510.331
Dividendenerträge		–	167.414.453
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	2.551.127
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten			
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		34.222.431	465.654.966
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		21.112.272	525.691.040
<b>Gesamtertrag</b>		<b>55.338.163</b>	<b>1.161.821.917</b>
<b>Aufwendungen</b>			
Managementgebühr	3	2.202.117	97.984.524
Performancegebühr	3	–	759.654
Verwahrstellengebühr	5	75.755	5.490.220
Betriebliche Aufwendungen	7	533.248	14.021.904
Dividendenaufwand		–	4.414.266
Finanzierungskosten für Swaps		–	1.425.225
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(98)	(1.187.133)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>2.811.022</b>	<b>122.908.660</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>52.527.141</b>	<b>1.038.913.257</b>
<b>Finanzierungskosten</b>			
Bankzinsen		11.146	1.252.892
Ausschüttungen		16.084.232	242.455.445
<b>Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr</b>		<b>36.431.763</b>	<b>795.204.920</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		9.398	(34.645.915)
<b>Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>36.441.161</b>	<b>760.559.005</b>

Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.



# BILANZ

Zum 31. Dezember 2021

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Equity Fund	
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD	
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	393.892.842	127.934.704	105.690.359	58.137.558
	Barmittel und Bargegenwerte	9	28.685.756	735.906	1.156.742	1.144.551
	Forderungen aus Erträgen		1.939.741	102.985	234.973	35.469
	Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	448.507	–
	Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	37	–
	Margen auf Derivatkontrakte	9	24.088.305	1.714.385	1.060.741	–
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	2.530.000	770.000	–
	Forderungen aus Zeichnungen		9.247	36.472	80.101	–
	Sonstige Forderungen		126	74	1.096	7.836
			<b>448.616.017</b>	<b>133.054.526</b>	<b>109.442.556</b>	<b>59.325.414</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	21.587.074	6.230.259	12.168.583	61
	Banküberziehung	9	247.049	–	–	47.055
	Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		2.179.664	–	439.174	–
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		100.642	318.666	–	17.201
	Zahlbare Aufwendungen		184.320	216.901	60.658	124.766
	Zahlbare Performancegebühren	3	–	1.516	90.533	–
	Margen auf Derivatkontrakte	9	3.329.865	26.275	705.341	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	2.530.000	770.000	–
	Auf Swaps zu zahlende Erträge		154.174	5.832	10.423	–
	Finanzierungskosten für Swaps		–	19.206	49.680	–
	Zahlbare Steuern	10	–	–	–	311.766
			<b>27.782.788</b>	<b>9.348.655</b>	<b>14.294.392</b>	<b>500.849</b>
	<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>420.833.229</b>	<b>123.705.871</b>	<b>95.148.164</b>	<b>58.824.565</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied - **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied - **Claire Cawley**

14. April 2022



Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
14.651.276	93.027.940	42.075.648	22.671.147	–	610.316.339	187.835.232	20.164.373	1.885.955.846
322.520	1.192.077	3.756.949	2.368.625	–	40.040.201	511.757	218.419	11.424.672
28.376	3.587	167.102	13.635	–	231.495	2.714.359	183.522	24.916.282
–	–	–	1.649	–	–	186.739	–	–
3.596	3.677	–	2.616	2.533	7.777	7.668	2.168	24.234
–	–	–	924.226	–	4.903.000	536.577	208.819	2.872.146
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1.359.758	4.508	–	–	5.969	99.192	–	99.557
1.100	356	–	–	–	28	3.021	2.589	–
<b>15.006.868</b>	<b>95.587.395</b>	<b>46.004.207</b>	<b>25.981.898</b>	<b>2.533</b>	<b>655.504.809</b>	<b>191.894.545</b>	<b>20.779.890</b>	<b>1.925.292.737</b>
1	51.332	1.787	308.461	–	37	363.707	60.949	3.192.954
327	–	–	189	–	–	–	–	–
–	–	2.255.055	–	–	–	–	–	–
–	281.236	503	–	–	6.185.614	46.268	–	415.080
26.794	129.474	89.296	19.149	2.533	307.090	80.450	22.835	376.531
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	903.094	–	3.087.954	102.127	4.801	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	3.333	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	1.041.327	–	–	–	–	–	–
<b>27.122</b>	<b>462.042</b>	<b>3.387.968</b>	<b>1.230.893</b>	<b>2.533</b>	<b>9.580.695</b>	<b>595.885</b>	<b>88.585</b>	<b>3.984.565</b>
<b>14.979.746</b>	<b>95.125.353</b>	<b>42.616.239</b>	<b>24.751.005</b>	<b>–</b>	<b>645.924.114</b>	<b>191.298.660</b>	<b>20.691.305</b>	<b>1.921.308.172</b>

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	713.955.886	532.273.406	31.948.791	104.106.567
Barmittel und Bargegenwerte	9	4.125.462	11.409.759	1.097.087	9.004.966
Forderungen aus Erträgen		10.005.235	5.928.307	427.361	1.643.154
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	1.975.192	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	5.736	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.485.548	1.059.157	182.622	258.000
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	272.000
Forderungen aus Zeichnungen		2.795.127	2.452.299	–	–
Sonstige Forderungen		4	3.444	–	244
		<b>734.372.998</b>	<b>555.101.564</b>	<b>33.655.861</b>	<b>115.284.931</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	4.088.433	339.690	45.551	481.453
Banküberziehung	9	–	4	–	118.027
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	673.755
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		8.258	110.094	396.910	21.353
Zahlbare Aufwendungen		287.830	382.252	47.433	158.613
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.376.774	–	31.067	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	272.000
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	3.333	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		<b>7.761.295</b>	<b>835.373</b>	<b>520.961</b>	<b>1.725.201</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>726.611.703</b>	<b>554.266.191</b>	<b>33.134.900</b>	<b>113.559.730</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Food Fund*	BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund
USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
26.631.365	121.210.735	270.100.214	39.597.242	2.098.963	2.697.272	2.298.463	428.178.417	440.596.139
1.028.474	2.766.010	4.325.469	1.036.134	70.717	78.202	60.233	6.370.439	3.640.662
403.532	2.064.756	1.661.913	251.041	3.480	2.254	1.649	1.916.459	2.867.087
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2.722	-	-	-	-	-	-	10.059
30.257	275.214	4.982.507	630.660	-	-	-	503.154	12.238.567
-	49.000	-	-	-	-	-	2.010.000	-
-	387	27.979	-	-	-	-	311.237	34.426
-	-	-	-	4.908	4.908	4.908	-	5.068
<b>28.093.628</b>	<b>126.368.824</b>	<b>281.098.082</b>	<b>41.515.077</b>	<b>2.178.068</b>	<b>2.782.636</b>	<b>2.365.253</b>	<b>439.289.706</b>	<b>459.392.008</b>
83.230	494.268	529.333	148.079	58	-	-	1.982.261	13.014.291
-	191	-	-	-	-	-	754	-
114.412	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	337.131	-	-	-	-	246.401	-
7.271	118.276	292.647	12.996	13.073	15.811	13.677	367.929	68.864
-	-	-	-	-	-	-	-	-
5.427	28.331	4.016.798	614.360	-	-	-	-	3.281.263
-	49.000	-	-	-	-	-	2.010.000	-
-	1.433	-	1.433	-	-	-	-	65.636
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>210.340</b>	<b>691.499</b>	<b>5.175.909</b>	<b>776.868</b>	<b>13.131</b>	<b>15.811</b>	<b>13.677</b>	<b>4.607.345</b>	<b>16.430.054</b>
<b>27.883.288</b>	<b>125.677.325</b>	<b>275.922.173</b>	<b>40.738.209</b>	<b>2.164.937</b>	<b>2.766.825</b>	<b>2.351.576</b>	<b>434.682.361</b>	<b>442.961.954</b>

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	399.598.642	52.485.901	497.379.699	405.886.585
Barmittel und Bargegenwerte	9	19.333.211	777.483	8.581.716	5.698.454
Forderungen aus Erträgen		3.052.129	26.962	384.117	618.388
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	33	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	150.834	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		3.520.000	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		13.100.376	94	20.067	103.220
Sonstige Forderungen		–	10.245	12.931	4
		<b>438.755.192</b>	<b>53.300.718</b>	<b>506.378.530</b>	<b>412.306.651</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	1.874.889	255	92	2.591
Banküberziehung	9	1	3.579	–	544.528
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		3.167	765	59.982	686
Zahlbare Aufwendungen		349.032	71.389	546.300	657.547
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	14.610	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		3.520.000	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	185.048	–	–
		<b>5.761.699</b>	<b>261.036</b>	<b>606.374</b>	<b>1.205.352</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>432.993.493</b>	<b>53.039.682</b>	<b>505.772.156</b>	<b>411.101.299</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund*	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
USD	USD	USD	EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD
159.239.036	225.297.045	64.500.496	–	36.532.593	2.731.136.840	58.915.307	388.463.134	786.181.855
5.521.790	3.481.228	898.708	13.372	754.531	397.401.682	6.793.574	50.536.285	4.463.781
2.194.358	282.252	24.262	–	26.944	3.398.526	65.148	520.536	9.656.627
792.770	–	–	–	–	321.087	7.059	38.565	–
–	3.022	–	–	–	–	–	–	1.545
–	–	–	–	–	50.734.594	591.125	1.513.097	–
–	–	–	–	–	–	–	2.480.000	4.849.000
485.859	6.720	358	–	–	9.182.878	186.336	277.193	1.991.210
–	863	–	–	–	–	–	–	1.854
<b>168.233.813</b>	<b>229.071.130</b>	<b>65.423.824</b>	<b>13.372</b>	<b>37.314.068</b>	<b>3.192.175.607</b>	<b>66.558.549</b>	<b>443.828.810</b>	<b>807.145.872</b>
163.678	48.500	562	–	51	64.988.397	604.245	3.222.671	1.769.339
–	–	–	–	–	10	1	–	–
1.221.723	–	–	–	–	–	–	–	6.810.903
–	1.120.125	913	–	34.743	2.700.685	4.171	62.267	707.083
154.717	194.921	65.289	13.372	80.824	2.757.756	53.087	454.537	436.175
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	2.480.000	4.849.000
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>1.540.118</b>	<b>1.363.546</b>	<b>66.764</b>	<b>13.372</b>	<b>115.618</b>	<b>70.446.848</b>	<b>661.504</b>	<b>6.219.475</b>	<b>14.572.500</b>
<b>166.693.695</b>	<b>227.707.584</b>	<b>65.357.060</b>	<b>–</b>	<b>37.198.450</b>	<b>3.121.728.759</b>	<b>65.897.045</b>	<b>437.609.335</b>	<b>792.573.372</b>

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund
	Erläuterungen	USD	JPY	EUR	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	29.758.111	20.658.426.875	1.573.372.355	972.973.754
Barmittel und Bargegenwerte	9	2.876.300	454.635.335	28.024.349	17.619.432
Forderungen aus Erträgen		57.974	28.310.100	394.845	142.720
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	22.189.490	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	–	3.082
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		–	780.552	1.919.404	5.958.748
Sonstige Forderungen		–	299.290	10.333	–
		<b>32.692.385</b>	<b>21.164.641.642</b>	<b>1.603.721.286</b>	<b>996.697.736</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	136.007	10.069.632	76.616	284.872
Banküberziehung	9	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	31.716.481	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		–	–	1.061.725	1.782.085
Zahlbare Aufwendungen		5.277	20.287.178	1.798.898	1.020.690
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		<b>141.284</b>	<b>62.073.291</b>	<b>2.937.239</b>	<b>3.087.647</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>32.551.101</b>	<b>21.102.568.351</b>	<b>1.600.784.047</b>	<b>993.610.089</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
USD	EUR	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
–	79.875.733	4.963.590	305.053.387	65.642.151	93.339.646	–	284.821.136	993.362.920
49.241	1.485.511	22.726	22.038.050	13.218.317	4.603.483	10.286	12.723.129	5.645.506
–	–	58	2.530.636	67.472	528.594	–	458.641	8.717.971
–	–	–	–	12.153	–	–	–	–
–	–	–	3.606	75	–	–	–	–
–	–	–	3.234.182	660.451	1.129.078	–	–	–
–	–	–	430.000	–	–	–	–	–
–	61.627	–	160.512	356.409	–	–	85	1.530.197
–	87	5.127	5.478	1.272	1.368	–	–	318
<b>49.241</b>	<b>81.422.958</b>	<b>4.991.501</b>	<b>333.455.851</b>	<b>79.958.300</b>	<b>99.602.169</b>	<b>10.286</b>	<b>298.002.991</b>	<b>1.009.256.912</b>
–	–	656	4.219.461	1.478.334	284.878	–	1.338	29.655
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	7.209.299	–	–	–
36.082	123.828	–	9.722	–	–	–	619	1.525.357
13.159	106.255	14.295	161.814	83.163	83.654	10.286	248.565	619.176
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	12.011	–	501.225	–	–	–
–	–	–	430.000	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>49.241</b>	<b>230.083</b>	<b>14.951</b>	<b>4.833.008</b>	<b>1.561.497</b>	<b>8.079.056</b>	<b>10.286</b>	<b>250.522</b>	<b>2.174.188</b>
–	<b>81.192.875</b>	<b>4.976.550</b>	<b>328.622.843</b>	<b>78.396.803</b>	<b>91.523.113</b>	–	<b>297.752.469</b>	<b>1.007.082.724</b>

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021^
	Erläute- rungen	EUR	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>			
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			
	16	950.668.738	18.548.681.008
Barmittel und Bargegenwerte	9	27.180.236	855.591.361
Forderungen aus Erträgen		6.012.461	99.499.032
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	4.087.391
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)			
	6	7.836	93.622
Margen auf Derivatkontrakte	9	2.078.380	132.975.391
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	17.970.685
Forderungen aus Zeichnungen		1.406.858	45.978.876
Sonstige Forderungen		–	94.765
		<b>987.354.509</b>	<b>19.704.972.131</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>			
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			
	16	2.106.646	163.830.966
Banküberziehung	9	–	995.933
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	21.542.420
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		377.670	18.863.705
Zahlbare Aufwendungen		489.448	15.014.563
Zahlbare Performancegebühren	3	–	105.124
Margen auf Derivatkontrakte	9	128.275	21.398.617
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	17.970.685
Auf Swaps zu zahlende Erträge		16.666	289.628
Finanzierungskosten für Swaps		–	82.557
Zahlbare Steuern	10	–	1.538.141
		<b>3.118.705</b>	<b>261.632.339</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>			
		<b>984.235.804</b>	<b>19.443.339.792</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.





Zum 31. Dezember 2020

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asia Rising Stars Fund**
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	386.731.425	218.924.012	39.270.231	–
Barmittel und Bargegenwerte	9	41.679.035	31.868.987	218.390	4.243
Forderungen aus Erträgen		1.794.279	234.445	86.682	70
Forderungen aus veräußerten Anlagen		1.164.368	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	4.082	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	8.566.338	5.188.797	628.917	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		7.350.000	8.289.000	550.000	–
Forderungen aus Zeichnungen		198.060	16.825	–	–
Sonstige Forderungen		1.954	14.210	–	–
		<b>447.485.459</b>	<b>264.536.276</b>	<b>40.758.302</b>	<b>4.313</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	18.485.690	14.065.251	6.071.205	–
Banküberziehung	9	60	1	2.129	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		82.399	356.836	–	–
Zahlbare Aufwendungen		277.806	282.242	42.682	4.313
Zahlbare Performancegebühren	3	17.901	–	325.808	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	454.563	–	522.478	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		7.350.000	8.289.000	550.000	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		219.864	–	4.148	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	34.554	16.832	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	168.814	–	–
		<b>26.888.283</b>	<b>23.196.698</b>	<b>7.535.282</b>	<b>4.313</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>420.597.176</b>	<b>241.339.578</b>	<b>33.223.020</b>	<b>–</b>

\*\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asian Equity Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund*	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund*
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
64.928.334	34.740.584	15.711.563	69.182.970	15.145.449	506.827.874	25.411.872	43.214.523	1.177.246.749
1.744.720	1.420.384	166.581	4.118.480	2.044.645	31.795.217	500.737	706.906	16.666.631
21.963	112.448	4.215	401.961	-	243.040	372.195	376.211	16.440.755
819.115	205.690	-	-	-	-	-	-	41.702.038
-	13.021	11.924	-	-	12.205	5.857	11.263	5.933
-	-	-	-	116.070	-	287.943	283.703	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
460.941	-	6.157	130.523	-	156.517	-	-	-
-	-	-	-	1	-	-	4.465	-
<b>67.975.073</b>	<b>36.492.127</b>	<b>15.900.440</b>	<b>73.833.934</b>	<b>17.306.165</b>	<b>539.034.853</b>	<b>26.578.604</b>	<b>44.597.071</b>	<b>1.252.062.106</b>
-	84	322	4.186	267.381	1.006.480	43.183	389.738	446.047
312.982	5.009	-	-	517.446	-	-	-	-
689.106	-	-	119.621	-	-	108.950	-	47.944.793
18.316	-	-	762.486	-	1.432.762	-	-	-
132.527	46.037	35.294	209.284	17.569	311.909	19.462	38.584	128.514
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	137.699	70.860	71.397	660	191.842
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
461.455	-	-	2.540.087	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>1.614.386</b>	<b>51.130</b>	<b>35.616</b>	<b>3.635.664</b>	<b>940.095</b>	<b>2.822.011</b>	<b>242.992</b>	<b>428.982</b>	<b>48.711.196</b>
<b>66.360.687</b>	<b>36.440.997</b>	<b>15.864.824</b>	<b>70.198.270</b>	<b>16.366.070</b>	<b>536.212.842</b>	<b>26.335.612</b>	<b>44.168.089</b>	<b>1.203.350.910</b>

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD	
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	744.989.879	380.027.423	37.810.015	164.979.734
	Barmittel und Bargegenwerte	9	14.680.942	7.524.437	1.055.348	1.440.472
	Forderungen aus Erträgen		10.919.552	5.392.648	467.836	2.420.216
	Forderungen aus veräußerten Anlagen		376.111	–	–	–
	Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	10.964	–	–	–
	Margen auf Derivatkontrakte	9	2.412.368	1.380.000	56.220	503.000
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	700.000
	Forderungen aus Zeichnungen		3.662.082	442.134	–	305.413
	Sonstige Forderungen		4.169	–	–	2.095
			<b>777.056.067</b>	<b>394.766.642</b>	<b>39.389.419</b>	<b>170.350.930</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	333.500	1.826.208	33.433	939.928
	Banküberziehung	9	–	–	–	1.076
	Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		5.585.751	–	–	–
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		5.903	194.126	–	2.711.856
	Zahlbare Aufwendungen		313.167	273.928	58.181	321.343
	Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
	Margen auf Derivatkontrakte	9	134.822	–	23.417	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	700.000
	Auf Swaps zu zahlende Erträge		6.111	14.445	–	–
	Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
	Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	1.008.086
			<b>6.379.254</b>	<b>2.308.707</b>	<b>115.031</b>	<b>5.682.289</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>						
			<b>770.676.813</b>	<b>392.457.935</b>	<b>39.274.388</b>	<b>164.668.641</b>

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund
USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
27.809.949	163.736.320	431.779.517	40.340.290	604.570.353	791.111.717	485.058.819	53.284.789	433.928.601
883.156	1.378.019	12.518.692	1.339.272	9.973.908	18.869.816	12.334.176	1.485.035	8.057.397
395.423	2.267.507	3.972.849	289.106	3.579.214	4.987.629	3.824.775	17.867	202.318
181.886	-	35.761	-	-	-	-	6.245	-
-	7.004	-	-	-	520	-	6.138	-
78.989	1.231.209	1.476.820	867.954	1.237.172	7.218.304	4.106.192	-	-
-	520.000	771.088	-	480.000	890.000	-	-	-
-	2.772	671.006	-	481.246	61.083	300.292	154.949	5.447
2.583	-	68	186	-	-	-	2.787	12.931
<b>29.351.986</b>	<b>169.142.831</b>	<b>451.225.801</b>	<b>42.836.808</b>	<b>620.321.893</b>	<b>823.139.069</b>	<b>505.624.254</b>	<b>54.957.810</b>	<b>442.206.694</b>
89.596	2.857.770	786.318	124.403	3.046.296	10.942.933	5.184.232	2.162	386.114
-	448	22	-	1.196.446	793.393	1.645.000	-	1.676.710
-	-	-	-	-	-	-	595.734	465.656
970.000	2.345	1.528.047	1.500.000	228.359	1.837	270.538	9.148	1.363
20.021	166.328	508.891	16.371	487.494	151.664	390.371	81.286	468.260
-	-	-	-	-	-	-	-	-
8.378	-	4.723.319	613.805	-	6.872.987	-	-	-
-	520.000	771.088	-	480.000	890.000	-	-	-
-	-	-	1.433	-	104.451	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	73.652	-
-	-	-	82.057	-	-	-	-	-
<b>1.087.995</b>	<b>3.546.891</b>	<b>8.317.685</b>	<b>2.338.069</b>	<b>5.438.595</b>	<b>19.757.265</b>	<b>7.490.141</b>	<b>761.982</b>	<b>2.998.103</b>
<b>28.263.991</b>	<b>165.595.940</b>	<b>442.908.116</b>	<b>40.498.739</b>	<b>614.883.298</b>	<b>803.381.804</b>	<b>498.134.113</b>	<b>54.195.828</b>	<b>439.208.591</b>

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	757.868.354	148.993.364	142.150.329	38.566.476
Barmittel und Bargegenwerte	9	13.149.252	3.903.316	3.354.389	1.482.977
Forderungen aus Erträgen		1.333.118	2.284.036	311.973	13.291
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	360.689	429.351	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	11.574	481
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		33.255	257.076	666.371	61.275
Sonstige Forderungen		–	–	–	–
		<b>772.383.979</b>	<b>155.798.481</b>	<b>146.923.987</b>	<b>40.124.500</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	9.834	122.171	72.634	933
Banküberziehung	9	596.791	–	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	2.116.206	253.492	992.252
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		1.112.953	5.017	38.861	–
Zahlbare Aufwendungen		1.033.511	130.794	119.973	40.412
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		400.208	–	–	–
		<b>3.153.297</b>	<b>2.374.188</b>	<b>484.960</b>	<b>1.033.597</b>
<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>769.230.682</b>	<b>153.424.293</b>	<b>146.439.027</b>	<b>39.090.903</b>

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD	JPY	EUR
20.379.343	35.635.863	2.881.434.650	60.974.434	291.344.971	691.323.576	28.609.152	15.012.143.537	1.535.301.493
446.608	363.754	91.403.260	2.075.704	11.167.248	194.717	1.459.778	352.444.863	37.616.602
64.062	19.222	4.578.565	99.969	492.019	8.266.238	59.904	8.393.325	481.110
-	558.184	301.442	6.310	36.439	1.806.941	-	-	-
4.118	-	-	-	-	3.092	3.483	428.064	-
-	-	10.064.465	198.144	4.085.613	13.596.505	-	-	-
-	-	56.380.000	970.000	-	90.000	-	-	-
10	10.185	3.340.294	105.013	6.862	703.058	-	641.268	1.767.459
4.328	-	-	-	897	5.458	-	7.124	6.776
<b>20.898.469</b>	<b>36.587.208</b>	<b>3.047.502.676</b>	<b>64.429.574</b>	<b>307.134.049</b>	<b>715.989.585</b>	<b>30.132.317</b>	<b>15.374.058.181</b>	<b>1.575.173.440</b>
126.199	149	24.398.093	443.167	5.682.435	11.668.207	128.731	41.410.420	42.170
-	9.156	1.203.141	898	11	-	-	-	-
-	58.247	-	-	-	1.155.768	-	-	1.202.311
-	444.662	33.220.822	112.690	64.658	641.638	-	1.664.661	755.467
27.545	97.305	2.610.143	74.899	292.462	390.383	13.427	13.573.776	1.791.169
-	-	-	-	-	-	-	-	269.498
-	-	2.809.531	65.415	271.606	327.110	-	-	-
-	-	56.380.000	970.000	-	90.000	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>153.744</b>	<b>609.519</b>	<b>120.621.730</b>	<b>1.667.069</b>	<b>6.311.172</b>	<b>14.273.106</b>	<b>142.158</b>	<b>56.648.857</b>	<b>4.060.615</b>
<b>20.744.725</b>	<b>35.977.689</b>	<b>2.926.880.946</b>	<b>62.762.505</b>	<b>300.822.877</b>	<b>701.716.479</b>	<b>29.990.159</b>	<b>15.317.409.324</b>	<b>1.571.112.825</b>

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	
	Erläuterungen	USD	USD	EUR	USD	
<b>Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	468.893.961	36.579.643	60.172.780	4.921.474
	Barmittel und Bargegenwerte	9	4.823.898	462.850	565.140	83.403
	Forderungen aus Erträgen		89.010	19.286	–	1.177
	Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	210.311	–	–
	Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	10.006	13.293	–	961
	Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
	Forderungen aus Zeichnungen		2.471.175	274.521	57.851	–
	Sonstige Forderungen		–	–	–	–
			<b>476.288.050</b>	<b>37.559.904</b>	<b>60.795.771</b>	<b>5.007.015</b>
<b>Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)</b>						
	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	55.097	3	–	74
	Banküberziehung	9	–	–	–	–
	Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		1.473.433	320.971	–	–
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		115.922	295.896	40.529	–
	Zahlbare Aufwendungen		446.284	70.463	93.498	3.013
	Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
	Margen auf Derivatkontrakte	9	–	6.995	–	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
	Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
	Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
	Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–
			<b>2.090.736</b>	<b>694.328</b>	<b>134.027</b>	<b>3.087</b>
	<b>Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen</b>		<b>474.197.314</b>	<b>36.865.576</b>	<b>60.661.744</b>	<b>5.003.928</b>

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.



Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Gesamt 31. Dezember 2020^
EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
265.414.925	33.238.280	92.147.131	3.705.294	223.506.243	590.629.940	16.857.829.443
6.404.396	835.974	2.518.429	17.497	5.709.371	25.882.480	497.069.391
2.239.327	67.837	607.623	3.030	400.676	5.433.575	88.903.085
-	3.105	-	-	1.323.527	-	49.863.345
17.328	11.635	-	56	-	-	177.321
291.146	89.561	83	-	-	-	70.818.256
4.090.000	-	-	-	-	-	99.807.957
1.155	349.936	-	-	-	2.459.061	21.086.401
-	1.866	-	-	-	-	73.429
<b>278.458.277</b>	<b>34.598.194</b>	<b>95.273.266</b>	<b>3.725.877</b>	<b>230.939.817</b>	<b>624.405.056</b>	<b>17.685.628.628</b>
2.750.193	295.466	381.575	-	10.554	77.833	131.096.051
-	-	-	-	-	-	8.228.217
-	-	1.740.943	-	463.554	10.000.000	75.553.281
169.495	5.360	-	-	-	26.892	55.583.902
126.705	49.992	95.645	21.570	198.430	384.049	14.406.918
-	-	-	-	-	-	749.125
-	-	102.845	-	-	-	19.456.044
4.090.000	-	-	-	-	-	99.807.957
-	-	-	-	-	-	400.422
-	-	-	-	-	-	67.816
-	-	-	-	-	-	3.075.194
-	-	-	-	-	-	1.739.392
<b>7.136.393</b>	<b>350.818</b>	<b>2.321.008</b>	<b>21.570</b>	<b>672.538</b>	<b>10.488.774</b>	<b>410.164.319</b>
<b>271.321.884</b>	<b>34.247.376</b>	<b>92.952.258</b>	<b>3.704.307</b>	<b>230.267.279</b>	<b>613.916.282</b>	<b>17.275.464.309</b>

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

	BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Equity Fund	BNY Mellon Asian Income Fund
	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	420.597.176	241.339.578	33.223.020	66.360.687	36.440.997
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	-	-	-	-	-
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	17.149.901	(4.131.036)	3.401.406	(6.928.798)	1.262.212
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	53.636.457	16.156.714	104.038.240	31.363.694	12.339.657
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(70.550.305)	(129.659.385)	(45.514.502)	(31.971.018)	(35.063.120)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>(16.913.848)</b>	<b>(113.502.671)</b>	<b>58.523.738</b>	<b>(607.324)</b>	<b>(22.723.463)</b>
<b>Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>420.833.229</b>	<b>123.705.871</b>	<b>95.148.164</b>	<b>58.824.565</b>	<b>14.979.746</b>

	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	770.676.813	392.457.935	39.274.388	164.668.641	28.263.991
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	-	-	-	-	-
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(28.236.130)	(35.306.357)	(1.156.424)	(14.847.989)	(2.834.881)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	702.548.910	324.285.728	3.840.724	10.329.323	7.284.178
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(718.377.890)	(127.171.115)	(8.823.788)	(46.590.245)	(4.830.000)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>(15.828.980)</b>	<b>197.114.613</b>	<b>(4.983.064)</b>	<b>(36.260.922)</b>	<b>2.454.178</b>
<b>Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>726.611.703</b>	<b>554.266.191</b>	<b>33.134.900</b>	<b>113.559.730</b>	<b>27.883.288</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>	<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>	<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*</b>	<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
15.864.824	70.198.270	–	16.366.070	536.212.842	26.335.612	44.168.089	1.203.350.910
–	–	–	–	–	–	–	–
(5.327.076)	(8.041.158)	(249.078)	49.980	142.493.211	(9.716.272)	(1.103.633)	7.068.912
124.365.027	28.489.209	25.000.083	11.623	157.194.251	237.848.407	499.778	1.200.824.241
(39.777.422)	(48.030.082)	–	(16.427.673)	(189.976.190)	(63.169.087)	(22.872.929)	(489.935.891)
<b>84.587.605</b>	<b>(19.540.873)</b>	<b>25.000.083</b>	<b>(16.416.050)</b>	<b>(32.781.939)</b>	<b>174.679.320</b>	<b>(22.373.151)</b>	<b>710.888.350</b>
<b>95.125.353</b>	<b>42.616.239</b>	<b>24.751.005</b>	<b>–</b>	<b>645.924.114</b>	<b>191.298.660</b>	<b>20.691.305</b>	<b>1.921.308.172</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>	<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>	<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>	<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>	<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>
USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
165.595.940	442.908.116	40.498.739	–	–	–	614.883.298	803.381.804
–	–	–	–	–	–	–	–
(20.906.716)	(12.626.519)	(246.042)	162.082	255.045	345.511	(44.428.151)	(16.797.997)
7.999.341	53.048.478	8.060.287	2.002.855	2.782.025	2.006.065	192.935.665	125.216.450
(27.011.240)	(207.407.902)	(7.574.775)	–	(270.245)	–	(328.708.451)	(468.838.303)
<b>(19.011.899)</b>	<b>(154.359.424)</b>	<b>485.512</b>	<b>2.002.855</b>	<b>2.511.780</b>	<b>2.006.065</b>	<b>(135.772.786)</b>	<b>(343.621.853)</b>
<b>125.677.325</b>	<b>275.922.173</b>	<b>40.738.209</b>	<b>2.164.937</b>	<b>2.766.825</b>	<b>2.351.576</b>	<b>434.682.361</b>	<b>442.961.954</b>

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	498.134.113	54.195.828	439.208.591	769.230.682	153.424.293
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(23.480.130)	(4.761.159)	76.156.244	63.307.656	431.372
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	102.301.016	63.086.911	170.891.213	124.222.479	42.864.484
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(143.961.506)	(59.481.898)	(180.483.892)	(645.659.518)	(30.026.454)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>(41.660.490)</b>	<b>3.605.013</b>	<b>(9.592.679)</b>	<b>(421.437.039)</b>	<b>12.838.030</b>
<b>Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>432.993.493</b>	<b>53.039.682</b>	<b>505.772.156</b>	<b>411.101.299</b>	<b>166.693.695</b>

  

	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*
	USD	JPY	EUR	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	29.990.159	15.317.409.324	1.571.112.825	474.197.314	36.865.576
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	2.195.017	2.595.549.972	369.846.625	97.177.693	354.480
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	365.925	11.283.742.500	553.161.861	692.923.660	91.060
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	–	(8.094.133.445)	(893.337.264)	(270.688.578)	(37.311.116)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>365.925</b>	<b>3.189.609.055</b>	<b>(340.175.403)</b>	<b>422.235.082</b>	<b>(37.220.056)</b>
<b>Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>32.551.101</b>	<b>21.102.568.351</b>	<b>1.600.784.047</b>	<b>993.610.089</b>	<b>–</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund*	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
USD	USD	EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD
146.439.027	39.090.903	20.744.725	35.977.689	2.926.880.946	62.762.505	300.822.877	701.716.479
-	-	-	-	-	-	-	-
17.425.692	9.068.723	813.913	6.382.037	205.358.249	3.603.582	23.621.801	(15.882.499)
131.963.408	28.318.194	247.309	11.027.018	1.076.774.053	20.898.782	174.051.367	317.764.226
(68.120.543)	(11.120.760)	(21.805.947)	(16.188.294)	(1.087.284.489)	(21.367.824)	(60.886.710)	(211.024.834)
<b>63.842.865</b>	<b>17.197.434</b>	<b>(21.558.638)</b>	<b>(5.161.276)</b>	<b>(10.510.436)</b>	<b>(469.042)</b>	<b>113.164.657</b>	<b>106.739.392</b>
<b>227.707.584</b>	<b>65.357.060</b>	<b>-</b>	<b>37.198.450</b>	<b>3.121.728.759</b>	<b>65.897.045</b>	<b>437.609.335</b>	<b>792.573.372</b>
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
EUR	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
60.661.744	5.003.928	271.321.884	34.247.376	92.952.258	3.704.307	230.267.279	613.916.282
-	-	-	-	-	-	-	-
13.834.206	(27.937)	(5.337.962)	4.004.052	(2.437.366)	341.195	60.800.825	(44.747.789)
25.734.919	4.924	83.514.835	46.432.605	1.008.221	134.633	92.344.107	696.030.945
(19.037.994)	(4.365)	(20.875.914)	(6.287.230)	-	(4.180.135)	(85.659.742)	(258.116.714)
<b>6.696.925</b>	<b>559</b>	<b>62.638.921</b>	<b>40.145.375</b>	<b>1.008.221</b>	<b>(4.045.502)</b>	<b>6.684.365</b>	<b>437.914.231</b>
<b>81.192.875</b>	<b>4.976.550</b>	<b>328.622.843</b>	<b>78.396.803</b>	<b>91.523.113</b>	<b>-</b>	<b>297.752.469</b>	<b>1.007.082.724</b>

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021^
	EUR	USD
Inhabern von einlösbaeren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	–	17.275.464.309
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	(554.868.192)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaeren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(5.724.870)	939.976.122
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaeren, partizipierenden Anteilen	1.271.182.451	9.840.192.989
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaeren, partizipierenden Anteilen	(281.221.777)	(8.057.425.440)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>989.960.674</b>	<b>1.782.767.549</b>
<b>Inhabern von einlösbaeren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen Anteile</b>	<b>984.235.804</b>	<b>19.443.339.788</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



**AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS**

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020

	<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>		<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>
	<b>EUR</b>	<b>GBP</b>	<b>EUR</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	397.342.232	371.503.339	28.390.201	8.283.563	38.173.739
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(7.927.141)	10.980.449	2.178.343	(414.946)	22.202.575
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	121.672.312	19.471.495	3.885.541	90.288	26.357.457
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(90.490.227)	(160.615.705)	(1.231.065)	(7.958.905)	(20.373.084)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>31.182.085</b>	<b>(141.144.210)</b>	<b>2.654.476</b>	<b>(7.868.617)</b>	<b>5.984.373</b>
<b>Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>420.597.176</b>	<b>241.339.578</b>	<b>33.223.020</b>	<b>–</b>	<b>66.360.687</b>
	<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>
	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	716.491.768	360.120.657	52.672.790	464.566.692	29.585.251
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	5.267.604	16.901.547	987.440	(36.402.401)	(619.546)
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	886.648.787	221.635.860	15.261.303	21.934.651	5.460.296
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(837.731.346)	(206.200.129)	(29.647.145)	(285.430.301)	(6.162.010)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>48.917.441</b>	<b>15.435.731</b>	<b>(14.385.842)</b>	<b>(263.495.650)</b>	<b>(701.714)</b>
<b>Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>770.676.813</b>	<b>392.457.935</b>	<b>39.274.388</b>	<b>164.668.641</b>	<b>28.263.991</b>

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund*	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund*
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
31.031.538	11.112.189	105.594.026	26.474.856	181.632.588	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
1.567.470	4.874.172	(22.815.221)	(469.693)	90.662.780	1.286.860	8.220.580	87.674.183
7.931.906	1.712.181	44.539.941	3.986.050	343.348.393	25.049.855	62.125.673	1.116.131.292
(4.089.917)	(1.833.718)	(57.120.476)	(13.625.143)	(79.430.919)	(1.103)	(26.178.164)	(454.565)
<b>3.841.989</b>	<b>(121.537)</b>	<b>(12.580.535)</b>	<b>(9.639.093)</b>	<b>263.917.474</b>	<b>25.048.752</b>	<b>35.947.509</b>	<b>1.115.676.727</b>
<b>36.440.997</b>	<b>15.864.824</b>	<b>70.198.270</b>	<b>16.366.070</b>	<b>536.212.842</b>	<b>26.335.612</b>	<b>44.168.089</b>	<b>1.203.350.910</b>
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Global Equity Fund
USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
151.635.419	890.225.293	82.434.065	585.157.899	462.784.533	496.274.784	33.193.624	371.812.812
–	–	–	–	–	–	–	–
13.795.406	6.349.843	1.366.382	55.716.620	70.421.574	21.655.524	16.813.720	62.059.734
70.804.936	122.877.785	7.399.348	215.457.375	289.453.259	168.871.588	23.387.014	174.673.630
(70.639.821)	(576.544.805)	(50.701.056)	(241.448.596)	(19.277.562)	(188.667.783)	(19.198.530)	(169.337.585)
<b>165.115</b>	<b>(453.667.020)</b>	<b>(43.301.708)</b>	<b>(25.991.221)</b>	<b>270.175.697</b>	<b>(19.796.195)</b>	<b>4.188.484</b>	<b>5.336.045</b>
<b>165.595.940</b>	<b>442.908.116</b>	<b>40.498.739</b>	<b>614.883.298</b>	<b>803.381.804</b>	<b>498.134.113</b>	<b>54.195.828</b>	<b>439.208.591</b>

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund
	USD	USD	USD	USD	EUR
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	1.842.135.041	121.548.316	91.053.076	86.118.374	23.691.394
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(118.682.815)	6.154.453	12.236.091	10.152.477	(1.006.053)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	343.422.433	68.552.332	131.634.363	23.577.424	3.295.326
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(1.297.643.977)	(42.830.808)	(88.484.503)	(80.757.372)	(5.235.942)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>(954.221.544)</b>	<b>25.721.524</b>	<b>43.149.860</b>	<b>(57.179.948)</b>	<b>(1.940.616)</b>
<b>Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>769.230.682</b>	<b>153.424.293</b>	<b>146.439.027</b>	<b>39.090.903</b>	<b>20.744.725</b>

	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund
	USD	USD	EUR	USD	EUR
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	154.707.836	50.804.733	74.850.283	–	180.183.426
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	128.269.457	4.207.877	(518.505)	2.743	2.589.737
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	272.164.452	5.481.019	19.347.392	5.001.185	120.728.201
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(80.944.431)	(23.628.053)	(33.017.426)	–	(32.179.480)
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften</b>	<b>191.220.021</b>	<b>(18.147.034)</b>	<b>(13.670.034)</b>	<b>5.001.185</b>	<b>88.548.721</b>
<b>Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen</b>	<b>474.197.314</b>	<b>36.865.576</b>	<b>60.661.744</b>	<b>5.003.928</b>	<b>271.321.884</b>

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,  
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
USD	EUR	GBP	USD	USD	USD	JPY	EUR
48.327.216	3.409.751.582	70.966.738	322.386.292	725.167.880	25.173.039	15.534.711.210	1.485.354.765
-	-	-	-	-	-	-	-
1.689.095	136.018.764	2.314.748	22.383.541	(8.731.334)	4.336.421	1.357.826.912	85.052.399
15.332.903	1.097.360.630	23.914.629	42.586.975	322.102.130	480.699	3.194.780.657	675.224.522
(29.371.525)	(1.716.250.030)	(34.433.610)	(86.533.931)	(336.822.197)	-	(4.769.909.455)	(674.518.861)
<b>(14.038.622)</b>	<b>(618.889.400)</b>	<b>(10.518.981)</b>	<b>(43.946.956)</b>	<b>(14.720.067)</b>	<b>480.699</b>	<b>(1.575.128.798)</b>	<b>705.661</b>
<b>35.977.689</b>	<b>2.926.880.946</b>	<b>62.762.505</b>	<b>300.822.877</b>	<b>701.716.479</b>	<b>29.990.159</b>	<b>15.317.409.324</b>	<b>1.571.112.825</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*</b>	<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>	<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund</b>	<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	<b>Gesamt 31. Dezember 2020^</b>		
EUR	USD	USD	USD	USD	USD		
-	84.505.101	28.865.549	419.124.854	438.605.770	16.628.689.066		
-	-	-	-	-	608.296.876		
1.782.627	7.266.089	281.468	(53.225.543)	36.441.161	760.559.005		
38.877.226	1.181.068	7.822.077	43.530.353	297.120.098	7.908.342.141		
(6.412.477)	-	(33.264.787)	(179.162.385)	(158.250.747)	(8.630.422.779)		
<b>32.464.749</b>	<b>1.181.068</b>	<b>(25.442.710)</b>	<b>(135.632.032)</b>	<b>138.869.351</b>	<b>(722.080.638)</b>		
<b>34.247.376</b>	<b>92.952.258</b>	<b>3.704.307</b>	<b>230.267.279</b>	<b>613.916.282</b>	<b>17.275.464.309</b>		

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS

### 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und Schätztechniken, die bei der Erstellung dieses Abschlusses angewandt wurden, sind im Folgenden aufgeführt:

#### ENTSPRECHENSERKLÄRUNG

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 wurde gemäß dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendender Finanzberichterstattungsstandard“ („Financial Reporting Standard, FRS 102“) und der irischen Gesetzgebung unter Einbeziehung des Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) sowie den Vorschriften der Central Bank Zentralbank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt.

#### GRUNDLAGE FÜR DIE ABSCHLUSSERSTELLUNG

Der Jahresabschluss wurde auf Basis des Fortführungsprinzips der Gesellschaft gemäß dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die Neubewertung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden an den Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, so angepasst, dass sie nach Ansicht des Verwaltungsrats die Tätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds angemessener darstellen.

Die Gesellschaft nimmt die nach Abschnitt 7 „Darstellung der Zahlungsströme“ des FRS 102 offenen Investmentfonds gewährte Ausnahmeregelung in Anspruch, keine Kapitalflussrechnung auf der Grundlage zu erstellen, dass im Wesentlichen alle Anlagen der Gesellschaft hochliquide sind und zum beizulegenden Zeitwert getätigt werden. Die Gesellschaft stellt eine Aufstellung der Veränderungen des Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens bereit.

#### WESENTLICHE BILANZIELLE SCHÄTZUNGEN UND ERMESSENSENTSCHEIDUNGEN

Bei der Erstellung des Abschlusses muss auf bestimmte wichtige bilanzielle Schätzungen zurückgegriffen werden. Außerdem muss der Verwaltungsrat bei der Anwendung der Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden der Gesellschaft sein Ermessen ausüben. Die Geschäftsführung nimmt Schätzungen und Annahmen hinsichtlich der Entwicklung in der Zukunft vor. Die Schätzungen und Annahmen, die ein erhebliches Risiko bezüglich einer wesentlichen Anpassung bei den Buchwerten der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beinhalten, werden nachstehend unter „Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet – Schätzung des beizulegenden Zeitwerts“ erörtert. Die Annahmen und Schätzungen der Gesellschaft basieren auf Parametern, die zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresabschlusses zur Verfügung standen. Bestehende Umstände und Annahmen über künftige Entwicklungen können aufgrund von Marktbewegungen oder dem Eintreten von Umständen, die außerhalb der Kontrolle der Fonds liegen, Änderungen unterliegen. Diese Änderungen werden in den Annahmen wiedergegeben, wenn sie eintreten und zukünftig erkannt werden.

#### WECHSELKURSUMRECHNUNG – FUNKTIONALE UND DARSTELLUNGSWÄHRUNG

Die in den Abschlüssen der Gesellschaft enthaltenen Positionen sind in der Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds ausgewiesen, in dem der jeweilige Fonds tätig ist (die „funktionale Währung“). Die funktionale Währung der einzelnen Fonds wurde vom Verwaltungsrat auf der Grundlage derjenigen Währung festgelegt, welche die wirtschaftlichen Auswirkungen der zugrunde liegenden Transaktionen, Ereignisse, Anlegerbasis und Bedingungen am besten widerspiegelt. Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar ausgewiesen, der Darstellungswährung der Gesellschaft.

Die funktionalen Währungen und Darstellungswährungen der Fonds sind US-Dollar, Euro, Pfund Sterling oder japanischer Yen, wie in der Bilanz angegeben.

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen, einschließlich des Anteilsinhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens, werden zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Schlusskurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Erträge und Aufwendungen in Fremdwährungen werden zu den Wechselkursen, die an den Transaktionsdaten maßgeblich sind, in die funktionale Währung umgerechnet. Die Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen und die Kosten der zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteile werden ebenfalls zu den Wechselkursen, die an den Transaktionsdaten maßgeblich sind, in die funktionale Währung umgerechnet. Aus Transaktionen und Umrechnungen resultierende Fremdwährungsgewinne und -verluste sind in der Gesamtergebnisrechnung unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ ausgewiesen.

Zur Ermittlung von Gesamtsummen für die Gesellschaft werden alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zusammen mit Erträgen und Aufwendungen sämtlicher Anteilsklassen unter Anwendung des Schlusskurses für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten und dem durchschnittlichen Kurs für Erträge und Aufwendungen, einschließlich Zeichnungen und Rücknahmen, in US-Dollar umgerechnet, da dies die Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds ist, in dem die Gesellschaft tätig ist. Ein Währungsausgleich wird erforderlich, wenn das Eröffnungsnettovermögen zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Umrechnungskursen erneut umgerechnet wird, wie in der Aufstellung der Veränderungen des Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens angegeben. Diese Zuweisungsmethode wirkt sich nicht auf den Wert des Nettovermögens aus, das den einzelnen Fonds zugewiesen wird.

## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### **ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – KLASSIFIZIERUNG**

Diese Kategorie hat zwei Unterkategorien: finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und solche, die zu Beginn als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft werden.

Finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, wenn sie gekauft oder eingegangen werden, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen, oder wenn sie beim erstmaligen Ansatz Teil eines aus identifizierbaren, gemeinsam verwalteten Finanzinstrumenten bestehenden Portfolios sind, bei dem sich derzeit ein Vorgehensmuster abzeichnet, das auf kurzfristige Gewinnmitnahmen abzielt. Derivate werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die bei der Erstbewertung erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft aber verwaltet werden und deren Wertentwicklung auf der Grundlage ihres beizulegenden Zeitwerts gemäß der im Prospekt genannten Anlagestrategie der Fonds bewertet wird.

### **ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – ANSATZ, AUSBUCHUNG UND BEWERTUNG**

Reguläre Käufe und Verkäufe von Anlagen werden am Handelstag ausgewiesen, d. h. zu dem Datum, an dem die Gesellschaft sich verpflichtet, die Anlage zu kaufen oder zu verkaufen. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Die Transaktionskosten werden als Aufwendung in der Gesamtergebnisrechnung verbucht.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die Rechte auf den Erhalt von Cashflows aus den bzw. auf Zahlung von Cashflows für die Anlagen erloschen sind oder die Gesellschaft im Wesentlichen alle mit dem Eigentum verbundenen Risiken und Chancen übertragen hat.

Die Folgebewertung aller erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten erfolgt zum beizulegenden Zeitwert. Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung im Geschäftsjahr ihres Entstehens anhand der Durchschnittskostenmethode verbucht.

Bei Devisenterminkontrakten auf der Ebene abgesicherter Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den entsprechenden Anteilsklassen zugewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Absicherungstätigkeiten werden in der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ in der Bilanz ausgewiesen.

### **ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS**

Der beizulegende Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (wie börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den angegebenen Marktkursen am Ende des Geschäftsjahres. In Übereinstimmung mit FRS 102 hat die Gesellschaft die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung der International Accounting Standards („IAS“) 39 „Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung“, die zur Verwendung in der Europäischen Union verabschiedet wurden, angewendet. Dementsprechend ist der angegebene Marktpreis für gehaltene finanzielle Vermögenswerte der Mittelkurs. Wenn die Gesellschaft Derivate zum Ausgleich von Marktrisiken einsetzt, wendet sie Mittelkurse als Grundlage an, um beizulegende Zeitwerte zum Ausgleich von risikobehafteten Positionen festzulegen und diesen Mittelkurs jeweils auf die offene Nettoposition anzuwenden.

Kommt es nach dem Bewertungszeitpunkt der Fonds am Ende des Geschäftsjahres zu einer bedeutenden Veränderung des beizulegenden Zeitwerts, wird der beizulegende Zeitwert anhand von Bewertungsmethoden ermittelt. Ein Ereignis ist dann bedeutend, wenn es nach dem letzten Marktkurs eines Wertpapiers, nach Börsenschluss oder Devisenmarktschluss, jedoch vor dem Bewertungszeitpunkt der Fonds eintritt und sich wesentlich auf die Richtigkeit der Schlusskurse eines Wertpapiers, eines Instruments, einer Währung oder von Wertpapieren auswirkt, die von diesem Ereignis betroffen sind, und diese daher nicht als verfügbare Marktnotierungen gelten können.

Der beizulegende Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. außerbörslich gehandelte OTC-Derivate), wird unter Anwendung von Bewertungsmethoden ermittelt. Die Gesellschaft verwendet eine Vielzahl von Methoden und trifft Annahmen, die auf den zum jeweiligen Bilanzstichtag bestehenden Marktbedingungen beruhen. Zu den verwendeten Bewertungsmethoden gehören die Verwendung vergleichbarer, kürzlich getätigter Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen, die Bezugnahme auf andere, im Wesentlichen identische Instrumente, die Analyse diskontierter Cashflows, Optionspreismodelle und andere Bewertungstechniken, die von Marktteilnehmern üblicherweise verwendet werden, wobei so weit wie möglich auf Marktdaten zurückgegriffen und so wenig wie möglich unternehmensspezifische Daten verwendet werden.

Die Buchwerte abzüglich der Wertberichtigung sonstiger Forderungen und Verbindlichkeiten entsprechen in etwa ihrem beizulegenden Zeitwert.

## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Nachfolgend eine Auflistung der wichtigsten Bewertungsmethoden der Gesellschaft:

- (a) Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die an einer anerkannten Börse notiert und regelmäßig gehandelt werden und für die Marktnotierungen ohne Weiteres verfügbar sind oder die an außerbörslichen Märkten gehandelt werden, werden zu dem Mittelkurs der Hauptbörse des Markts für die betreffende Anlage bewertet.
- (b) Sind die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an mehreren anerkannten Börsen notiert, so wird der Kurs der anerkannten Börse verwendet, die nach Meinung des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem jeweiligen Anlageverwalter den Hauptmarkt für diese Vermögenswerte darstellt.
- (c) Wenn für bestimmte finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten der Mittelkurs gemäß (a) oder (b) oben nicht verfügbar ist oder nach Ansicht des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem entsprechenden Anlageverwalter, keinen fairen oder angemessenen Wert reflektiert, ist der Wert unter Einsatz anderer Methoden mit angemessener Sorgfalt und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat angemessen zu berechnen und von The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin (die „Verwahrstelle“) zu diesem Zweck zu genehmigen, unter Rücksprache mit dem entsprechenden Anlageverwalter, um den wahrscheinlichen Veräußerungswert solcher Anlagen zu bestimmen.
- (d) Für den Fall, dass finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten nicht an einer anerkannten Börse notiert sind oder gehandelt werden, werden diese Vermögenswerte vom Verwaltungsrat mit Sorgfalt und nach Treu und Glauben und in Absprache mit dem jeweiligen Anlageverwalter zum wahrscheinlichen Veräußerungswert bewertet. Dieser wahrscheinliche Veräußerungswert kann anhand von Kursinformationen eines Maklers festgelegt werden.
- (e) Barmittel und andere liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert bewertet, gegebenenfalls mit aufgelaufenen Zinsen.
- (f) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (außer solchen, die gemäß (a) oder (b) oben bewertet wurden) werden zum letzten verfügbaren Nettoinventarwert des entsprechenden Organismus für gemeinsame Anlagen als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet.
- (g) An einem Markt gehandelte derivative Instrumente werden zum Abrechnungspreis dieser Instrumente an einem solchen Markt bewertet. Wenn diese derivativen Instrumente nicht an einem Markt gehandelt werden entspricht ihr Wert dem Tageskurs eines unabhängigen Kursdienstes oder unabhängiger Marktmacher.
- (h) Der Marktwert von Devisenterminkontrakten wird von einer unabhängigen Preisquelle bestimmt, wobei der Preis herangezogen wird, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Höhe und Fälligkeit abgeschlossen werden könnte.
- (i) Einschusszahlungen erfolgen beim Abschluss von Terminkontrakten (Futures) und werden im Allgemeinen in Form von Barmitteln oder Bargegenwerten geleistet. Der beizulegende Zeitwert von Terminkontrakten wird auf der Basis ihres täglichen Abrechnungskurses bestimmt. Wertänderungen offener Terminkontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten erfasst, bis die Kontrakte beendet werden, wobei zu diesem Zeitpunkt die realisierten Gewinne und Verluste erfasst werden. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten sind in der Aufstellung der Wertpapierbestände aufgeführt. Nachschussforderungen/-verbindlichkeiten zum Bilanzstichtag werden als Forderung bzw. Verbindlichkeit in der Bilanz ausgewiesen.
- (j) Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Put-Optionen wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung abgezogen. Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Call-Optionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Prämien, die für den Kauf von Optionen, welche ohne Ausübung verfallen, gezahlt werden, werden als realisierte Verluste behandelt. Die Optionsprämie auf verkaufte Call-Optionen, die ausgeübt wurden, wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers bzw. der Währung hinzuaddiert. Die Optionsprämie auf verkaufte Put-Optionen, die ausgeübt wurden, wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Fremdwährungen abgezogen. Prämien, die beim Verkauf von Optionen, die ohne Ausübung verfallen, vereinnahmt werden, werden als realisierte Gewinne behandelt.
- (k) Zinsswap-, Credit Default Swap- und Total Return Swap-Kontrakte werden auf Basis der Notierungen eines unabhängigen Kursdienstes oder von Marktmachern täglich bewertet, und eine etwaige Änderung wird als nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Zahlungen, die aufgrund einer Vertragskündigung vereinnahmt oder entrichtet wurden, werden abzüglich von Vorauszahlungen als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Erträge aus (im Freiverkehr gehandelten) OTC-Derivaten fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A (die „Verwaltungsgesellschaft“) oder anderen Parteien.
- (l) Commercial Paper und Termineinlagen werden zu den fortgeführten Anschaffungskosten als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet. Die Gesellschaft darf in Finanzinstrumenten anlegen, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden, wobei der beizulegende Zeitwert anhand von Bewertungsmethoden, wie der diskontierten Cashflow-Analyse, und anderen von Marktteilnehmern verwendeten Bewertungsmethoden ermittelt werden kann.
- (m) Börsengehandelte Fonds werden zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage von Notierungen des Nettoinventarwerts je Anteil aus unabhängigen Preisquellen als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet.

## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

- (n) Bestimmte Fonds können „TBA“-Kaufverpflichtungen (To Be Announced) eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Anteilspreis zu einem zukünftigen Zeitpunkt außerhalb der üblichen Abrechnungszeit zu kaufen. Obwohl der Anteilspreis feststeht, ist der Kapitalwert noch nicht endgültig festgelegt. Die Fonds halten bis zum Abrechnungstermin Barmittel oder erstklassige Schuldverschreibungen in einer Höhe, die ausreicht, um den Kaufpreis zu erfüllen, oder die Fonds schließen gegenläufige Kontrakte für den Terminverkauf anderer Wertpapiere, die sie besitzen, ab. Die Erträge aus den Wertpapieren werden erst am Abrechnungstag erzielt. TBA-Kaufverpflichtungen können als Wertpapiere an sich betrachtet werden und bergen ein Verlustrisiko, wenn der Wert des zu kaufenden Wertpapiers vor dem Abrechnungstermin sinkt, was zusätzlich zu dem Risiko eines Wertverlusts der anderen Vermögenswerte der Fonds besteht. Nicht abgewickelte TBA-Kaufverpflichtungen werden zum aktuellen Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere bewertet. Obwohl die Fonds TBA-Kaufverpflichtungen mit der Absicht eingehen können, Wertpapiere für ihre Portfolios zu erwerben oder gemäß von ihnen geschlossenen Optionskontrakten zu liefern, können die Fonds eine TBA-Kaufzusage vor dem Abrechnungstermin veräußern, wenn der Anlageverwalter dies für angemessen hält.
- (o) Aktien-Swaps werden entsprechend der Preisgrundlage für die zugrunde liegenden Aktienpositionen bewertet. Finanzierungskosten für Aktien-Swaps laufen täglich auf, werden monatlich angepasst und werden durch den Verkauf von Aktien-Swaps abgerechnet. Erträge aus Aktien-Swaps fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der Verwaltungsgesellschaft oder anderen Parteien.
- (p) Darlehen werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, der vom Daten- und Informationsdienstleister Markt bereitgestellt wird. Eingenommene oder gezahlte Gebühren sowie der Erhalt von Kapitalzahlungen werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. In Fällen, in denen Markt keinen Wert für ein Darlehen stellen kann, wird das Darlehen zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage einer von einem Finanzinstitut vorgenommenen Bewertung bewertet. Offene Darlehen werden auf Grundlage des vereinbarten Kaufpreises zum beizulegenden Zeitwert bewertet, bis eine Bewertung von einem Preisdienst zur Verfügung steht.
- (q) Einige Fonds können Genussscheine (Participatory Notes, P-Notes) nutzen, die an zulässigen Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Über diese Genussscheine erhalten die Fonds wirtschaftlichen Zugang zu bestimmten Aktien in beschränkt zugänglichen oder Schwellenmärkten wie z. B. Indien, Sri Lanka, Vietnam, Bangladesch, China und Brasilien, wo das Halten lokaler Aktien oder aktienbezogener Wertpapiere möglicherweise weniger effizient ist als die Verwendung von Genussscheinen, was zu einer Verringerung der Kosten führt. Genussscheine werden anhand des Mittelkurses des zugrunde liegenden Wertpapiers bewertet.

### DARLEHEN

Bestimmte Fonds der Gesellschaft können in direkte Schuldinstrumente investieren, die Ansprüche an den Beträgen sind, die von kreditnehmenden Unternehmen und staatlichen Institutionen oder von sonstigen Kreditnehmern gegenüber Kreditgebern oder Syndikatsführern geschuldet werden. Die Anlagen eines Fonds in Darlehen können in Form von Beteiligungen an Darlehen oder Übertragungen aller oder eines Teils von Darlehen von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, die/das als Vertreter für alle Inhaber handelt. Der Vertreter verwaltet die Darlehensbedingungen gemäß den Bestimmungen im Darlehensvertrag. Ein Fonds kann in mehrere Serien oder Tranchen von Darlehen investieren, die unterschiedliche Bestimmungen enthalten und mit unterschiedlichen Risiken verbunden sind. Ein Fonds ist in der Regel nicht berechtigt, die Erfüllung der Bestimmungen des Darlehensvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Daher kann ein Fonds dem Kreditrisiko sowohl des Kreditnehmers als auch des Kreditgebers unterliegen, der den Darlehensvertrag verkauft.

Erwirbt ein Fonds Übertragungen von Kreditgebern, erwirbt er direkte Ansprüche gegenüber dem Kreditnehmer des Darlehens. Bei einer Anlage in ein Darlehen ist ein Fonds berechtigt, Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren zu erhalten, auf die er ausschließlich Anspruch gegenüber dem Kreditgeber hat, der den Darlehensvertrag verkauft, und zwar ausschließlich, wenn der Kreditgeber Zahlungen vom Kreditnehmer erhält.

### FORDERUNGEN

Forderungen umfassen Barmittel und Bargegenwerte, Forderungen aus Erträgen, Forderungen aus veräußerten Anlagen, Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft, Margen auf Derivatkontrakte, Forderungen aus Zeichnungen und sonstige Forderungen. Diese Beträge werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert erfasst und danach zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

### FINANZIELLE VERBINDLICHKEITEN ZU FORTGEFÜHRTEN ANSCHAFFUNGSKOSTEN

Finanzielle Verbindlichkeiten zu fortgeführten Anschaffungskosten umfassen Banküberziehungen, Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen, Verbindlichkeiten aus Rücknahmen, zahlbare Aufwendungen, Verbindlichkeiten aus Performancegebühren, Margen auf Derivatkontrakte, an den Makler zu zahlende Barsicherheiten, auf Swaps zu zahlende Erträge, Finanzierungskosten für Swaps, Steuerverbindlichkeiten und sonstige Verbindlichkeiten. Diese Beträge werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert erfasst und danach zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN

Es erfolgt eine Saldierung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und der Nettobetrag wird in der Bilanz ausgewiesen, sofern die Saldierung der erfassten Beträge rechtlich durchsetzbar ist und beabsichtigt wird, die Abwicklung auf Nettobasis vorzunehmen oder den Vermögenswert zu realisieren und gleichzeitig die Verbindlichkeit abzulösen.

### ÜBERKREUZINVESTITIONEN

Zum 31. Dezember 2021 investieren der BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Euroland Bond Fund und der BNY Mellon European Credit Fund in andere Fonds der Gesellschaft (31. Dezember 2020: BNY Mellon Euroland Bond Fund und BNY Mellon European Credit Fund). Die Überkreuzinvestitionen wurden aus dem Jahresabschluss der Gesellschaft herausgenommen. Investiert ein Fonds in einen oder mehrere Fonds der Gesellschaft, werden diese Überkreuzinvestitionen bei der Berechnung der zu zahlenden Managementgebühren vom Gesamtnettoinventarwert abgezogen. Die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, aus Überkreuzinvestitionen wurden aus den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen werden, herausgenommen.

### BARMITTEL UND BARGEGENWERTE SOWIE BANKÜBERZIEHUNGEN

Barmittel und Bargegenwerte werden zum Nennwert und gegebenenfalls mit den aufgelaufenen Zinsen zum Bewertungszeitpunkt am relevanten Geschäftstag angesetzt. Bargegenwerte umfassen Sichteinlagen bei Banken sowie sonstige kurzfristige Anlagen in einem aktiven Markt mit ursprünglichen Fälligkeiten von bis zu drei Monaten. Banküberziehungen werden in der Bilanz getrennt ausgewiesen.

### SICHERHEITEN

Von den Fonds gestellte Barsicherheiten werden in der Bilanz als „Margen auf Derivatkontrakte“ erfasst und sind nicht als Bestandteil von Barmitteln und Bargegenwerten enthalten. Von den Fonds erhaltene Barsicherheiten werden in der Bilanz als „Vom Makler erhaltene Barsicherheiten“ erfasst. Die Verpflichtung zur Rückzahlung der Barsicherheiten wird in der Bilanz als „An den Makler zu zahlende Barsicherheiten“ erfasst. Erhaltene Barsicherheiten sind nicht Bestandteil der Barmittel und Bargegenwerte der Fonds. Bei anderen Sicherheiten als Barmitteln, wenn die Partei, der die Sicherheit übergeben wird, vertraglich oder eigentümlich das Recht hat, die Sicherheit zu verkaufen oder zu verpfänden, klassifizieren die Fonds diesen Vermögenswert in ihrer Bilanz getrennt von anderen Vermögenswerten und erfassen den Vermögenswert als verpfändete Sicherheit. Hat die Partei, der die Sicherheit übergeben wird, nicht das Recht, die Sicherheit zu verkaufen oder zu verpfänden, wird die übergebene Sicherheit in der Aufstellung der Wertpapierbestände offen gelegt, wenn ein „\*“ angegeben ist.

### TRANSAKTIONSKOSTEN

Transaktionskosten sind Kosten, die für den Erwerb von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten entstehen. Sie beinhalten die an Vertreter, Berater, Makler und Händler gezahlten Gebühren und Provisionen. Im Hinblick auf Aktien und derivative Finanzinstrumente werden entstandene Transaktionskosten in der Gesamtergebnisrechnung sofort als Aufwand ausgewiesen und sind unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ enthalten. Bei allen anderen Wertpapieren ist die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs im Kauf- und Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten und kann nicht getrennt geprüft oder offen gelegt werden.

### DIVIDENDENERTRÄGE

Dividenden aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Dividendenertrag“ ausgewiesen, sofern das Recht der Fonds auf den Erhalt dieser Zahlungen begründet ist. Dividendenerträge werden vor Abzug jeglicher nicht erstattungsfähiger Quellensteuern ausgewiesen.

### DIVIDENDENAUFWAND

Zinsen auf kurzfristige Aktien-Swaps werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Dividendenaufwand“ ausgewiesen. Dieser kann je nach der periodischen Fortschreibung und/oder abschließenden Veräußerung der zugrunde liegenden Swap-Instrumente Änderungen unterliegen.

### ZINSERTRÄGE

Zinserträge für zinstragende Finanzinstrumente werden als Teil der „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ ausgewiesen. Erträge aus Bankzinsen werden bei Zahlungseingang erfasst.

### BESTEUERUNG

Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Praktiken sind von den Fonds keine Einkommen-, Kapitalertrag- oder sonstigen Steuern zu zahlen. Den Fonds entstehen derzeit Quellensteuern, die von bestimmten Ländern auf ihre Anlageerträge und Veräußerungsgewinne erhoben werden. Quellensteuern werden in der Gesamtergebnisrechnung gesondert und nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragsteuer auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Die Kapitalertragsteuer wird in Übereinstimmung mit den Steuervorschriften des jeweiligen Landes und den Steuersätzen für irische Anleger ausgewiesen. Die Kapitalertragsteuer und die am Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind in den Posten „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ und „Zu zahlende Steuern“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz aufgeführt.



## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### AUFWENDUNGEN

Aufwendungen werden periodengerecht abgegrenzt. Kosten in Verbindung mit der Auflösung eines Fonds werden von der Verwaltungsgesellschaft gezahlt.

### WERTPAPIERLEIHE

Die Gesellschaft hat mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Verwahrstelle eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen. Die Gesellschaft kann Wertpapiere in Höhe von bis zu 100 % einer beliebigen Wertpapierlinie an Schuldner verleihen, die von The Bank of New York Mellon genehmigt wurden. Die Gesellschaft erhält als Sicherheit für die entliehenen Wertpapiere Wertpapiere, Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte. Die Gesellschaft akzeptiert Barmittel als Sicherheiten, tätigt jedoch keine Wiederanlage von Barsicherheiten. Gehaltene (und ausstehende) Sicherheiten entsprechen mindestens 102 % des Werts der entliehenen Wertpapiere. Erträge aus der Wertpapierleihe werden bei Zahlungseingang erfasst. Einzelheiten zu der Wertpapierleihposition am Ende des Geschäftsjahres sind in Erläuterung 14 zum Abschluss enthalten.

### AUSSCHÜTTUNGEN AN DIE INHABER EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE

Geleistete Ausschüttungen an Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Finanzierungskosten“ ausgewiesen.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Die Gesellschaft gibt innerhalb jedes Fonds mehrere Klassen einlösbarer, partizipierender Anteile aus, die nach Ermessen des Inhabers rückzahlbar sind und keine identischen Rechte haben. Diese Anteile werden als finanzielle Verbindlichkeiten erfasst.

Einlösbare, partizipierende Anteile können jederzeit gegen einen Barbetrag an den Fonds zurückgegeben werden, der dem der Anteilsklasse zuzuweisenden proportionalen Anteil am Nettoinventarwert des Fonds entspricht. Die einlösbaren, partizipierenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Ende des Geschäftsjahres zahlbar ist, wenn der Inhaber das Recht ausübt, den Anteil an den Fonds zurückzugeben.

Einlösbare, partizipierende Anteile werden nach Wahl des Inhabers zu Preisen ausgegeben und zurückgenommen, die auf dem Nettoinventarwert je Anteil des Fonds zum Zeitpunkt der Ausgabe oder Rücknahme basieren. Der Nettoinventarwert des Fonds je Anteil wird berechnet, indem das Nettovermögen, das den Inhabern der einzelnen Klassen einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuweisen ist, in Übereinstimmung mit den im Prospekt zur Bestimmung des Nettoinventarwerts je Anteil für Zeichnungen und Rücknahmen enthaltenen Bestimmungen durch die Summe aller in Umlauf befindlichen einlösbaren, partizipierenden Anteile geteilt wird.

### VERWÄSSERUNGS AUSGLEICH

Um die Auswirkungen einer Verwässerung abzuschwächen, kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen einen Verwässerungsausgleich in Bezug auf den Nettoinventarwert je Anteil vornehmen. Unter welchen Umständen ein solcher Verwässerungsausgleich erfolgt, liegt allein im Ermessen des Verwaltungsrats.

Die Entscheidung, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen, hängt vom Volumen der Zeichnungen oder Rücknahmen von Anteilen des Fonds ab. Der Verwaltungsrat kann nach eigenem Ermessen einen Verwässerungsausgleich vornehmen, wenn nach seiner Auffassung die bestehenden Anteilsinhaber im Falle von Zeichnungen oder die verbleibenden Anteilsinhaber im Falle von Rücknahmen anderweitig nachteilig betroffen sein könnten. Insbesondere kann unter folgenden Umständen ein Verwässerungsausgleich erfolgen:

- wenn sich ein Fonds in einer anhaltenden Schrumpfung befindet (d. h. einen Nettoabfluss von Rücknahmen erfährt);
- falls der Fonds im Verhältnis zu seiner Größe hohe Nettozeichnungen oder Nettorücknahmen verzeichnet; und
- unter allen anderen Umständen, in denen der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass es im Interesse der Anteilsinhaber ist, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen.

Der Verwässerungsausgleich besteht darin, dass zum Nettoinventarwert je Anteil, sofern sich der Fonds in einer Nettozeichnungsposition befindet, ein Betrag addiert und vom Nettoinventarwert je Anteil, sofern sich der Fonds in einer Nettorücknahmeposition befindet, ein Betrag abgezogen wird, den der Verwaltungsrat für angemessen erachtet, um die Transaktionskosten zu decken, insbesondere Marktspreads, Maklergebühren und Steuern, um den Wert der zugrunde liegenden Vermögenswerte des betreffenden Fonds zu erhalten, und unter allen anderen Umständen, in denen der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass dies im Interesse der Anteilsinhaber ist. Der sich daraus ergebende Betrag ist der Preis, der auf die vom Verwaltungsrat für angemessen erachtete Anzahl von Dezimalstellen gerundet wird.

## 1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

### VERWÄSSERUNGS AUSGLEICH Forts.

Wird ein Verwässerungsausgleich vorgenommen, steigt der Preis, zu dem die Anteile ausgegeben werden, sofern es sich um Nettozeichnungen handelt, und fällt der Preis, zu dem die Anteile zurückgenommen werden, wenn es sich um Nettorücknahmen handelt. Der Preis, zu dem die einzelnen Anteilsklassen ausgegeben bzw. zurückgenommen werden, wird getrennt berechnet. Allerdings wird jeder Verwässerungsausgleich den Preis der einzelnen Anteilsklassen prozentual auf die gleiche Weise beeinflussen. Ein solcher Verwässerungsausgleich beträgt höchstens 2 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Da eine Verwässerung direkt mit den Zu- und Abflüssen bei einem Fonds zusammenhängt, ist es nicht möglich, exakt vorherzusagen, ob eine Verwässerung zu einem beliebigen späteren Zeitpunkt eintreten wird. Folglich ist es ebenfalls nicht möglich, genau vorherzusagen, wie häufig ein Verwässerungsausgleich vorgenommen wird.

## 2. ANTEILSKAPITAL

### GENEHMIGTES KAPITAL

Das ursprüngliche genehmigte Anteilkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist eingeteilt in 38.092 Zeichneranteile zu je 1,00 EUR und 25.000.000.000 nennwertlose Anteile, die zunächst als nicht klassifizierte Anteile bezeichnet werden. Die nicht klassifizierten Anteile stehen zur Ausgabe als partizipierende Anteile zur Verfügung.

### ZEICHNERANTEILE

Die 38.902 Zeichneranteile zu je 1,00 EUR wurden alle als voll eingezahlt ausgegeben und werden von der Verwaltungsgesellschaft gehalten. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zu keinerlei Ausschüttungen, sie berechtigen den Inhaber bei Liquidierung zum Empfang des eingezahlten Betrags, jedoch nicht zur anderweitigen Beteiligung am Gesellschaftsvermögen. Die Zeichneranteile sind nicht Teil des Nettoinventarwerts der Gesellschaft und werden somit in den Abschlüssen nur in dieser Erläuterung ausgewiesen. Nach Meinung des Verwaltungsrats geben diese Ausführungen die Art des Anlagegeschäfts der Gesellschaft wieder.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Einlösbar, partizipierende Anteile verleihen den Anspruch auf einen anteilmäßigen Anteil an den Vermögenswerten der Fonds und berechtigen den Anteilinhaber zu einer Stimme je Anteil bei einer Abstimmung. Anteile werden von den Anteilinhabern zu Preisen eingelöst, die auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse basieren.

Die Aktivitäten bei einlösbar, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2021 waren wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>						
	Klasse C	EUR	3.099	–	–	3.099
	Klasse C (Inc)^	EUR	2.070	–	(2.070)	–
	Klasse R	EUR	54.980	1.618	(17.395)	39.203
	Klasse R (Hedged)	USD	12.034	73	(3.526)	8.581
	Klasse R (Inc)	EUR	7.408	1.270	(3.709)	4.969
	Klasse S	EUR	71.835	10.282	(35.054)	47.063
	Klasse T (Hedged)	CHF	343	–	(210)	133
	Klasse T (Hedged)	USD	78.701	–	–	78.701
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	98.014	4.755	(8.029)	94.740
	Klasse W (Acc)	EUR	1.238	–	–	1.238
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	25.294	8.936	(25.928)	8.302
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	961.230	93.847	(254.946)	800.131
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.951	104	(1.951)	104
	Klasse X	EUR	1.434.832	54.886	(252.283)	1.237.435
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	866.542	228.587	(15.894)	1.079.235

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>						
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	212.885	–	(497)	212.388
	Klasse R (Hedged)	CHF	17.026	–	–	17.026
	Klasse R (Hedged)	EUR	49.396.435	3.124.749	(20.136.605)	32.384.579
	Klasse R (Hedged)	USD	6.019.450	516.834	(2.157.078)	4.379.206
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	3.323.266	60.447	(780.861)	2.602.852
	Sterling R (Acc)	GBP	736.091	157.339	(159.986)	733.444
	Sterling S (Acc)	GBP	239.506	8.422	(85.256)	162.672
	Klasse T (Hedged)	EUR	31.251.987	2.885.487	(12.701.687)	21.435.787
	Klasse T (Hedged)	USD	588.862	–	–	588.862
	Klasse U (Hedged)	EUR	65.241.453	6.417.331	(6.627.946)	65.030.838
	Klasse U (Hedged)	USD	2.219.154	500.314	(1.546.922)	1.172.546
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	19	–	–	19
	Sterling U (Acc)	GBP	3.537.380	2.748.653	(2.155.988)	4.130.045
	Sterling X (Acc)	GBP	69.174.413	36	(63.682.511)	5.491.938
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>						
	Klasse F (Acc)	EUR	503.305	4.099.064	(188.832)	4.413.537
	Klasse F (Acc) (Hedged)^	CHF	–	1.229.388	(10.000)	1.219.388
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	2.608.089	4.502.893	(2.140.627)	4.970.355
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	2.057.015	11.850.431	(592.219)	13.315.227
	Klasse R (Acc)^	EUR	–	55.000	–	55.000
	Klasse U (Acc)	EUR	19.795.137	131.349	(730)	19.925.756
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	–	12.093.083	(224.234)	11.868.849
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	745.772	62.533	(84.000)	724.305
	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.936.321	4.458	(4.936.321)	4.458
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	58.716.928	(31.361.845)	27.355.083
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	4.042.498	1.804.246	(1.931.494)	3.915.250
	Klasse A	EUR	3.758.429	3.118.548	(2.308.581)	4.568.396
	Klasse B	USD	2.521.396	79.538	(146.204)	2.454.730
	Klasse B	EUR	51.467	73.970	(10.000)	115.437
	Klasse C	USD	705.937	31.652	(537.078)	200.511
	Klasse C	EUR	394.407	496.275	(656.384)	234.298
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	Klasse W	USD	660.749	316.722	(394.629)	582.842

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	15.977	–	(14.997)	980
	Klasse A (Inc)^	USD	–	106.715	(127)	106.588
	Klasse A (Inc)	EUR	54.958	235.901	(59.269)	231.590
	Klasse B (Acc)	USD	107.267	–	–	107.267
	Klasse C (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	8.548.921	(668.915)	7.880.006
	Klasse W (Inc)	EUR	21.647.011	871.999	(21.883.635)	635.375
	Klasse W (Inc)	USD	3.546.000	–	(354.812)	3.191.188
	Sterling W (Inc)	GBP	217.453	2.542	(30.123)	189.872
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	53.920	14.254.077	(2.989.955)	11.318.042
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Inc)^	SGD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	USD	–	1.376.316	(5.000)	1.371.316
	Klasse E (Acc)	USD	196.450	255.843	(22.235)	430.058
	Klasse E (Acc)	EUR	315.700	17.545.631	(7.654.918)	10.206.413
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1.520.664	(606.587)	914.077
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	3.846.860	(51.700)	3.800.160
	Klasse G (Acc)^	EUR	–	90.022	–	90.022
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	481.211	20.300.014	(3.983.636)	16.797.589
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse K (Acc)	USD	1.399.704	178.050	(849.849)	727.905
	Klasse K (Acc)	EUR	1.983.904	255.788	(480.480)	1.759.212
	Klasse W (Acc)	USD	4.978.700	4.236.971	(3.654.010)	5.561.661
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	841.545	(10.000)	831.545
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	11.211.263	1.505.236	(3.649.597)	9.066.902
	Klasse A	EUR	14.680.237	6.017.357	(11.066.049)	9.631.545
	Klasse B	USD	2.618.496	395.860	(1.624.309)	1.390.047
	Klasse B	EUR	105.398	–	–	105.398
	Sterling B (Acc)	GBP	195.131	42.834	(180.710)	57.255
	Klasse C	USD	6.259.248	5.753.738	(6.472.375)	5.540.611
	Klasse C	EUR	5.919.756	520.133	(6.286.866)	153.023
	Sterling C (Inc)	GBP	31.340	109.211	(36.374)	104.177
	Klasse G (Acc)	EUR	1.653.156	345.330	(345.330)	1.653.156
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.359.231	969.880	(1.241.387)	1.087.724
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	5.006.428	1.037.756	(3.771)	6.040.413
	Klasse W (Acc)	USD	993.387	79.415	(437.306)	635.496
	Klasse W (Acc)	EUR	561.080	149.802	(291.026)	419.856
	Sterling W (Acc)	GBP	3.335.679	3.285.851	(3.335.557)	3.285.973

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	24.905.477	–	24.905.477
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse X (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)^	USD	11.806	–	(11.806)	–
	Klasse C (Acc)^	USD	310.749	–	(310.749)	–
	Klasse E (Acc)^	USD	14.519.613	–	(14.519.613)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	148.618	–	(148.618)	–
	Klasse W (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse X (Acc)^	USD	50.205	–	(50.205)	–
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	56	568.303	(3.831)	564.528
	Klasse A (Inc)	USD	80.276	272.825	(90.289)	262.812
	Klasse C (Acc)	USD	79.747.465	7.732.190	(38.442.165)	49.037.490
	Klasse G (Acc)	USD	1.023.990	152.709	(847.124)	329.575
	Klasse G (Acc)	EUR	130.259	286.732	(123.872)	293.119
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	14.484.481	172.457	(14.649.580)	7.358
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	3.497.367	273.059	(3.735.760)	34.666
	Klasse W (Acc)	USD	40.751.080	19.924.760	(31.430.338)	29.245.502
	Klasse W (Acc)	EUR	53.633.658	8.039.186	(9.475.546)	52.197.298
	Klasse W (Inc)	EUR	71.942.297	54.824.423	(13.282.444)	113.484.276
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	206.980	–	206.980
	Klasse X (Acc)	USD	90.100.439	–	(56.515)	90.043.924

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse E (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	55.791.916	(1.657.014)	54.234.902
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	51.095.373	(19.749.671)	31.445.702
	Klasse E (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.198	(97.853)	11.516
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	100.170	24.403.811	(961.143)	23.542.838
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.205	(97.859)	11.517
	Klasse W (Acc)	USD	23.355.282	–	(23.350.671)	4.611
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	33.300.715	(3.015.762)	30.384.953
	Klasse W (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.200	(97.855)	11.516
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.170	1.508.820	(373.440)	1.235.550
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	30.483.755	11.927	(15.872.695)	14.622.987
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(86.811)	13.189
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse X (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	72.000	5.154.889	(1.877.520)	3.349.369
	Klasse C (Acc)	USD	339.875	10.527.003	(1.645.932)	9.220.946
	Klasse C (Inc)^	USD	–	1.288.309	(81)	1.288.228
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	–	65.232.470	(100.000)	65.132.470
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	2.556.055	(729.912)	1.826.143
	Klasse N (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse N (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse N (Inc) (M)^	USD	–	5.112	(56)	5.056
	Klasse W (Acc)	USD	48.046.390	249.926.179	(71.847.770)	226.124.799
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	5.189.226	(5.101.033)	88.193
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Klasse W (Inc)^	USD	–	5.194	(97)	5.097
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	8.642.783	904.977	(91.279)	9.456.481
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	102.030	(102.030)	–
	Klasse X (Acc)	USD	214.308.117	323.677.979	(103.475.620)	434.510.476
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	208.797.923	122.833.508	(68.075.478)	263.555.953
	Klasse X (Inc)	USD	549.202.955	117.906.640	(162.003.039)	505.106.556
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	100.044	67.950.392	(104.656)	67.945.780
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>						
	Klasse A (Inc)	USD	34.017	189.885	(34.017)	189.885
	Klasse A (Inc)	EUR	609.577	2.354.732	(30.612)	2.933.697
	Klasse C (Acc)	USD	188.437	–	(136.000)	52.437
	Klasse C (Inc)^	USD	5.139	458	(5.597)	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	38.577.634	2.127.230	(4.983.203)	35.721.661
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	257.899.993	29.608.004	(214.294.486)	73.213.511
	Sterling E (Inc) (Hedged)^	GBP	102.124	6.355	(108.479)	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	82.815	(86.755)	96.060
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.031	1.340.000	(1.340.000)	13.031
	Klasse K (Acc)	USD	313.433	–	–	313.433
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(88.281)	11.719
	Klasse L (Acc)	USD	65.643.817	235.114.219	(82.405.487)	218.352.549
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	57.894.039	54.229.098	(70.737.424)	41.385.713
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(88.959)	11.041
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	17.097.207	8.099.782	(1.638.686)	23.558.303
	Klasse W (Acc)	USD	63.099.253	–	(49.206.229)	13.893.024
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse W (Inc)	USD	5.087	492.381	(297)	497.171
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	26.021.008	7.933.138	(1.339.000)	32.615.146
	Sterling W (Inc) (hedged)	GBP	101.740	14.832.582	(1.374.781)	13.559.541
	Klasse X (Acc)	USD	5.087.338	89.909.009	(19.331.525)	75.664.822
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	21.620.243	36.993.989	(58.614.232)	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)^	GBP	–	45.068.678	–	45.068.678
	Klasse X (Inc)^	USD	5.127	457	(5.584)	–

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>						
	Klasse A	USD	29.163	204.001	(28.543)	204.621
	Klasse A	EUR	90.099	69.775	(71.253)	88.621
	Klasse A (Inc)^	USD	51	1	(52)	-
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	327	593	(504)	416
	Klasse B	USD	2.172	557	(444)	2.285
	Klasse C	USD	94.118	32.732	(28.824)	98.026
	Klasse C	EUR	58.848	61.711	(39.064)	81.495
	Klasse G (Inc)	USD	17.710	5.221	(5.286)	17.645
	Klasse H (Hedged)	EUR	124.861	20.826	(65.661)	80.026
	Klasse I (Hedged)	EUR	130.581	23.383	(45.337)	108.627
	Klasse W	USD	255.631	68.788	(57.939)	266.480
	Klasse W	EUR	7.006	3.664	(2.714)	7.956
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	135.169	246.116	(11.937)	369.348
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	243.405	689.502	(61.983)	870.924
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	58.160	20.000	(8.160)	70.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	212.650	-	(1.100)	211.550
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	27.930	11.309	(9.831)	29.408
	Klasse X	USD	673.975	522.242	(122.737)	1.073.480
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	173.939	-	(173.939)	-
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>						
	Klasse A	USD	532.145	50.531	(129.769)	452.907
	Klasse A	EUR	4.280.343	364.042	(1.139.779)	3.504.606
	Klasse C	USD	5.093.433	626.642	(945.858)	4.774.217
	Klasse C	EUR	3.002.021	145.179	(375.669)	2.771.531
	Klasse C (Inc)	USD	798.050	-	(706.063)	91.987
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1.339.284	299.459	(1.066.532)	572.211
	Klasse W	USD	5.000	-	-	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	2.630.319	129.566	-	2.759.885



## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>						
	Klasse A	USD	8.092.103	6.908	(2.366.576)	5.732.435
	Klasse A	EUR	13.646.522	615.621	(4.764.176)	9.497.967
	Klasse A (Inc)	USD	52.723	43	(33.121)	19.645
	Klasse A (Inc)	EUR	1.888.858	509.404	(317.362)	2.080.900
	Sterling A (Acc)	GBP	227.859	–	(50.809)	177.050
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	Klasse C	USD	1.469.138	983.283	(1.526.363)	926.058
	Klasse C	EUR	621.038	228.088	(269.226)	579.900
	Klasse C (Inc)	USD	328.123	95.858	(404.481)	19.500
	Klasse C (Inc)	EUR	15.487.661	5.000	(6.668.160)	8.824.501
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	–	–	1.615
	Sterling C (Inc)	GBP	153.349	7	(15.337)	138.019
	Klasse H (Hedged)	EUR	11.660.523	175.846	(7.066.556)	4.769.813
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.533.104	3.863.198	(2.472.366)	3.923.936
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	Klasse W	USD	86.541.800	661.577	(626.743)	86.576.634
	Klasse W	EUR	4.704.059	881.198	(3.109.030)	2.476.227
	Klasse W (Hedged)	EUR	8.982.606	731.918	(8.933.197)	781.327
	Klasse W (Inc)	EUR	767.287	–	–	767.287
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	487.950	14.530	(488.131)	14.349
	Sterling W (Inc)	GBP	7.302.134	143.022	(6.799.536)	645.620
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	37.081	49.243	(48.572)	37.752
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>						
	Klasse A	EUR	23.504	28.859	–	52.363
	Klasse C	USD	256.500	–	–	256.500
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	27.155.049	7.494.102	(5.019.666)	29.629.485
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	66.429.041	2.895.132	(16.330.325)	52.993.848
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(86.035)	13.965
	Klasse W (Acc)	USD	64.610.852	–	(4.905.808)	59.705.044
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	7.349	–	–	7.349
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	211.011	61.163	(19.136)	253.038
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>						
	Klasse A	EUR	115.491.909	7.060.206	(58.148.672)	64.403.443
	Klasse A (Inc)	EUR	8.088.463	197.246	(2.571.118)	5.714.591
	Klasse B	EUR	62.950	–	(6.940)	56.010
	Klasse B (Inc)	EUR	16.640	–	–	16.640
	Klasse C	EUR	42.672.639	1.141.054	(25.571.587)	18.242.106
	Klasse C (Inc)	EUR	2.622.554	39.060	(798.090)	1.863.524
	Klasse G (Acc)	EUR	1.578.698	–	(50.628)	1.528.070
	Klasse H (Hedged)	CHF	3.026.540	35.000	(345.145)	2.716.395
	Klasse I (Hedged)	CHF	1.208.515	6.717.600	(437.654)	7.488.461
	Klasse S	EUR	14.014.449	5.499.932	(5.711.428)	13.802.953
	Klasse W (Acc)	EUR	60.883.193	17.816.240	(17.781.729)	60.917.704
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>						
	Klasse A	EUR	8.415	1.715	(2.229)	7.901
	Klasse C	EUR	40.381	21.501	(12.551)	49.331
	Klasse W (Acc)	EUR	847	517	(276)	1.088
	Klasse X	EUR	247.226	33.065	(40.400)	239.891
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	1.617.245	–	1.617.245
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>						
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	605.000	(205.000)	400.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	2.000.000	–	2.000.000
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>						
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	2.000.000	–	2.000.000

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>						
	Klasse A	USD	42.245.454	9.971.492	(16.341.531)	35.875.415
	Klasse A	EUR	21.615.304	1.052.908	(10.280.978)	12.387.234
	Klasse B	USD	750.738	42.244	(79.294)	713.688
	Klasse C	USD	62.411.076	16.288.991	(33.680.105)	45.019.962
	Klasse C	EUR	81.091.176	23.657.317	(58.404.500)	46.343.993
	Klasse C (Inc)	USD	553.933	163.454	(207.965)	509.422
	Sterling C (Inc)	GBP	3.235.412	342.998	(856.264)	2.722.146
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.009.139	113.067	(703.083)	1.419.123
	Klasse I (Hedged)	EUR	5.237.009	95.419	(4.811.116)	521.312
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	–	10.273.565	(10.259.870)	13.695
	Klasse W (Acc)	USD	18.738.087	37.235.300	(14.245.065)	41.728.322
	Klasse W (Acc)	EUR	4.546	5.000	(4.546)	5.000
	Klasse X	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1.409.377	1.490.744	(467.130)	2.432.991
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	4.219.864	7.814.033	(1.139.211)	10.894.686
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc) (Q)^	USD	5.012	28	(5.040)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	10.289.102	5.403.712	(2.265.299)	13.427.515
	Klasse W (Acc)	USD	6.854.065	3.078.441	(7.784.478)	2.148.028
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	393.476	167.463	(229.704)	331.235
	Klasse X (Acc)	USD	198.786.267	14.267.370	(175.514.874)	37.538.763
	Klasse X (Acc)^	JPY	–	21.509.574	(822)	21.508.752
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	463.472.278	–	(192.909.786)	270.562.492
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	JPY	–	65.059.740	(2.733)	65.057.007

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>						
	Klasse A	USD	3.389.842	309.402	(1.542.002)	2.157.242
	Klasse A	EUR	1.634.650	572.576	(1.163.410)	1.043.816
	Klasse A (Inc)	USD	178.103	668	–	178.771
	Klasse C	USD	110.208.727	35.890.815	(16.935.623)	129.163.919
	Klasse G (Acc)	EUR	67.120	–	(13.931)	53.189
	Klasse H (Hedged)	EUR	5.274.262	1.273.620	(3.752.751)	2.795.131
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	639.413	60.279	(373.780)	325.912
	Klasse I (Hedged)	EUR	10.595.082	619.547	(4.665.112)	6.549.517
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	SGD	–	10.000	–	10.000
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	1.340.481	188.300	(80.236)	1.448.545
	Klasse W	USD	128.431.502	8.887.506	(48.125.842)	89.193.166
	Klasse W (Hedged)	EUR	74.519.118	23.557.001	(32.699.595)	65.376.524
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	139.782	9.672	(149.454)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	9.679.014	1.012.776	(127.890)	10.563.900
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	8.565.353	1.397.397	(2.275.156)	7.687.594
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	100.880	714	(101.594)	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	19.689.028	–	(54.141)	19.634.887
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	10.038.007	6.289	(132.516)	9.911.780
	Klasse Z (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse Z (Inc)^	USD	5.000	85	(5.085)	–
	Sterling Z (Acc)	GBP	3.210.869	24.696	(1.994.071)	1.241.494
	Sterling Z (Inc)	GBP	59.550	24.000	(15.550)	68.000
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(89.361)	10.639
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	100.859	1.530	(91.480)	10.909

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>						
	Klasse A	USD	273.888	4.696.253	(4.740.593)	229.548
	Klasse A	EUR	1.044.155	2.076.230	(2.430.596)	689.789
	Klasse A (Inc)	EUR	87.417	918.417	(719.177)	286.657
	Klasse B (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Inc)	USD	5.170	169.319	(5.235)	169.254
	Klasse B (Inc)	EUR	94.342	21.778	(12.545)	103.575
	Klasse C	USD	135.000	5.597	–	140.597
	Klasse C (Acc)	USD	19.394.549	13.775.846	(16.730.443)	16.439.952
	Klasse C (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse C (Inc)	USD	52.676	70.256	(58.180)	64.752
	Sterling C (Inc)^	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse E (Acc)	USD	2.396.890	3.694.637	(1.912.006)	4.179.521
	Klasse E (Acc)	CHF	874.464	131.561	(274.455)	731.570
	Klasse H (Hedged)	EUR	180.428	759.008	(515.689)	423.747
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.018.814	642.761	(1.275.643)	385.932
	Klasse W (Acc)	USD	190.105	240.278	(351.244)	79.139
	Klasse W (Acc)	EUR	1.243.335	4.858.189	(1.554.026)	4.547.498
	Klasse W (Inc)	USD	236.198	–	(89.634)	146.564
	Klasse W (Inc)	EUR	66.211	2.169	(10.138)	58.242
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	12.169.789	16.667.088	(18.711.168)	10.125.709
	Klasse A	EUR	1.383.653	9.659.069	(8.509.771)	2.532.951
	Klasse B	USD	3.273.634	136.320	(50.821)	3.359.133
	Klasse B	EUR	16.994	23.000	–	39.994
	Klasse C	USD	8.137.637	3.333.602	(7.379.495)	4.091.744
	Klasse I (Hedged)	EUR	243.605	–	–	243.605
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	–	10.068.962	(10.054.077)	14.885
	Klasse W (Acc)	USD	21.188.129	8.867.760	(7.954.831)	22.101.058
	Klasse W (Acc)	EUR	177.006.318	23.993.674	(20.656.476)	180.343.516

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>						
	Klasse A	USD	10.085.112	4.435.849	(5.888.493)	8.632.468
	Klasse A	EUR	22.548.021	3.189.268	(8.259.696)	17.477.593
	Klasse A (Inc)	USD	2.899.281	544.009	(563.850)	2.879.440
	Klasse A (Inc)	EUR	6.030.788	1.126.067	(2.835.022)	4.321.833
	Sterling A (Acc)	GBP	293.069	–	(165.373)	127.696
	Klasse B	USD	5.388.669	61.835	(923.156)	4.527.348
	Klasse B	EUR	1.318.596	32.704	(413.278)	938.022
	Klasse B (Inc)	USD	3.725.187	93.411	(644.100)	3.174.498
	Klasse B (Inc)	EUR	1.586.893	242.937	(306.176)	1.523.654
	Sterling B (Inc)	GBP	1.034.895	52.440	(503.074)	584.261
	Klasse C	USD	37.784.278	5.102.756	(25.324.943)	17.562.091
	Klasse C	EUR	5.569.211	876.476	(1.283.738)	5.161.949
	Klasse C (Inc)	USD	7.200.537	2.250.522	(1.595.149)	7.855.910
	Klasse C (Inc)	EUR	18.981.884	22.856	(2.371.608)	16.633.132
	Sterling C (Inc)	GBP	743.722	7.732	(236.933)	514.521
	Klasse G (Acc)	EUR	1.126.081	57.676	(1.070.681)	113.076
	Klasse H (Hedged)	EUR	5.093.817	371.908	(2.194.918)	3.270.807
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	6.888.678	257.132	(982.973)	6.162.837
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.693.698	611.030	(1.926.905)	1.377.823
	Klasse W	USD	6.080.309	7.641.807	(11.437.532)	2.284.584
	Klasse W	EUR	15.760.320	4.014.191	(3.749.786)	16.024.725
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	209.957	63.737	(186.718)	86.976
	Klasse W (Inc)	USD	15.942.657	409.587	(2.713.973)	13.638.271
	Klasse W (Inc)	EUR	151.859.683	4.287.205	(142.935.726)	13.211.162
	Sterling W (Acc)	GBP	2.018.906	92.212	(1.004.866)	1.106.252
	Sterling W (Inc)	GBP	25.620.516	2.167.805	(13.670.266)	14.118.055
	Klasse Z (Acc)	USD	2.111.564	92.370	(27.000)	2.176.934
	Klasse Z (Acc)	EUR	38.120	14.983	(15.800)	37.303
	Klasse Z (Inc)	USD	3.131.227	–	(1.063.278)	2.067.949
	Klasse Z (Inc)	EUR	476.850	12.000	(18.977)	469.873
	Sterling Z (Acc)^	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	Sterling Z (Inc)	GBP	3.135.118	772.004	(703.159)	3.203.963
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>						
	Klasse A	EUR	5.910.931	1.363.441	(2.666.464)	4.607.908
	Klasse C	USD	40.815.719	9.747.259	(7.517.361)	43.045.617
	Klasse C	EUR	12.195	553.085	(223.094)	342.186
	Klasse C (Inc)	USD	398.288	–	–	398.288
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.168.660	126.919	(324.062)	971.517
	Klasse I (Hedged)	EUR	7.646.402	938.394	(455.241)	8.129.555
	Klasse W (Acc)	USD	14.136.406	9.908.175	(705.710)	23.338.871
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	968.200	257.825	(341.800)	884.225
	Klasse X (Inc)	USD	21.296.254	3.458.373	(4.197.623)	20.557.004
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	19.537.541	3.464.242	(2.803.866)	20.197.917

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	195.925	4.952	(195.925)	4.952
	Klasse A (Inc)	USD	716.993	42.503	(307.472)	452.024
	Klasse A (Inc)	EUR	5.545	27.646	(7.286)	25.905
	Klasse B (Acc)	SGD	7.885.537	11.297.593	(1.747.940)	17.435.190
	Klasse B (Acc)	USD	1.311.832	5.223.768	(1.573.040)	4.962.560
	Klasse B (Inc)	USD	6.491.158	13.357.532	(2.627.289)	17.221.401
	Klasse B (Inc)	SGD	4.429.644	11.153.723	(1.198.526)	14.384.841
	Klasse B (Inc) (M)^	USD	–	5.380	(190)	5.190
	Klasse B (Inc) (M)^	SGD	–	5.370	(185)	5.185
	Klasse E (Inc)	USD	876.451	57.895.188	(6.033.568)	52.738.071
	Klasse E (Inc)	EUR	2.709.460	1.693.894	(432.166)	3.971.188
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	79.817.550	10.043.509	(35.942.625)	53.918.434
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	323.699	369.702	(20.881)	672.520
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1.071.548	58.788	(99.901)	1.030.435
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	669.773	956.919	(446.142)	1.180.550
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	1.935.403	5.352.237	(288.356)	6.999.284
	Klasse W (Acc)	USD	11.117.644	16.366.703	(10.109.046)	17.375.301
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	180.000	–	(82.713)	97.287
	Klasse W (Inc)	USD	2.182.226	5.541.300	(1.302.218)	6.421.308
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	17.900.000	–	–	17.900.000
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	861.649	241.476	(74.273)	1.028.852
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	1.122	–	6.122
	Klasse A (Inc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	7.556.560	(1.201.069)	6.360.491
	Klasse C (Acc)	USD	3.167.533	46.959	(257.082)	2.957.410
	Klasse E (Acc)	USD	10.663.143	4.658.627	(2.359.703)	12.962.067
	Klasse E (Acc)	EUR	991.680	–	(5.000)	986.680
	Sterling E (Acc)	GBP	2.926.036	1.456.739	(285.988)	4.096.787
	Klasse H (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	(55.942)	11.058
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	80.161	132.093	(82.140)	130.114
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	103.138	(75.075)	116.063
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(84.355)	12.645
	Klasse W (Acc)	USD	749.322	672.905	(794.963)	627.264
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	(56.680)	10.320
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(75.249)	12.751
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(84.525)	12.475
	Sterling W (Acc)	GBP	993.773	677.880	(332.658)	1.338.995

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse A (Inc)^	EUR	2.443.887	44.976	(2.488.863)	–
	Klasse A (Inc)^	USD	5.049	96	(5.145)	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	5.930	–	(5.930)	–
	Klasse E (Inc)^	EUR	6.167.284	81.813	(6.249.097)	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	10.635.492	–	(10.635.492)	–
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>						
	Klasse A	USD	2.037.553	802.970	(926.604)	1.913.919
	Klasse A	EUR	7.456.242	1.223.328	(2.310.197)	6.369.373
	Klasse B	USD	765.528	52.438	(112.642)	705.324
	Klasse C	USD	258.231	5.089	(11.260)	252.060
	Klasse C	EUR	52.416	101.681	(99.487)	54.610
	Klasse H (Hedged)	EUR	242.445	2.544	(114.785)	130.204
	Klasse I (Hedged)	EUR	14.931	–	–	14.931
	Klasse W (Acc)	USD	3.600	1.971.385	(1.972.779)	2.206
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>						
	Klasse A	EUR	556.965.607	362.787.911	(279.273.351)	640.480.167
	Klasse A (Inc)	EUR	17.522.756	5.498.484	(2.806.338)	20.214.902
	Klasse C	EUR	137.886.714	122.695.929	(154.759.993)	105.822.650
	Klasse C (Inc)	EUR	4.428.295	4.928.019	(2.146.053)	7.210.261
	Klasse G (Acc)	EUR	9.764.885	15.216.791	(3.172.123)	21.809.553
	Klasse G (Inc)	EUR	4.291.694	908.320	(720.557)	4.479.457
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	4.521.594	353.535	(865.271)	4.009.858
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	2.494.943	1.563.805	(320.951)	3.737.797
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1.248.102	360.099	(294.216)	1.313.985
	Klasse W	EUR	536.534.496	95.683.635	(152.805.399)	479.412.732
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	520.362	248.770	(23.626)	745.506
	Klasse W (Inc)	EUR	1.039.717	735.397	–	1.775.114
	Klasse X	EUR	655.544.243	58.910.365	(112.184.007)	602.270.601
	Klasse Z (Acc)	EUR	69.990.795	40.089.697	(1.617.690)	108.462.802
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>						
	Sterling B (Acc)	GBP	959.396	440.983	(459.882)	940.497
	Sterling B (Inc)	GBP	402.024	115.134	–	517.158
	Sterling C (Inc)	GBP	262.366	–	(97.076)	165.290
	Sterling W (Acc)	GBP	11.550.607	6.523.896	(4.161.838)	13.912.665
	Sterling W (Inc)	GBP	9.779.977	2.097.964	(2.268.300)	9.609.641
	Sterling X (Acc)	GBP	23.644.409	5.321.740	(8.308.537)	20.657.612



## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>						
	Klasse A	USD	61.832.404	50.401.055	(14.009.186)	98.224.273
	Klasse C	USD	26.138.741	34.246.389	(8.715.349)	51.669.781
	Klasse C (Inc)	USD	8.993	70.000	–	78.993
	Klasse G (Acc)	USD	4.250	163.379	–	167.629
	Klasse W	USD	13.048.442	7.519.465	(4.190.389)	16.377.518
	Klasse W (Inc)	USD	9.459.564	2.408.415	(1.270.365)	10.597.614
	Klasse X	USD	61.865.762	5.505.304	(6.581.478)	60.789.588
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	3.479.928	2.038.917	(1.074.775)	4.444.070
	Klasse A (Inc)	USD	104.868	663.597	(38.264)	730.201
	Klasse C (Acc)	USD	8.777.559	1.623.805	(2.307.655)	8.093.709
	Klasse G (Acc)	USD	170.550	233.422	(10.000)	393.972
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	61.159.515	33.431.903	(14.712.760)	79.878.658
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.075.534	701.600	(435.619)	2.341.515
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	12.375.078	2.228.809	(5.285.210)	9.318.677
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	710.936	2.615.655	(306.140)	3.020.451
	Klasse W (Acc)	USD	49.014.543	27.758.389	(10.717.197)	66.055.735
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	121.900	852.057	(10.050)	963.907
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	52.457.305	52.061.445	(7.267.613)	97.251.137
	Klasse W (Inc)	USD	30.073.325	8.017.039	(30.153.249)	7.937.115
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1.263.000	–	(360.000)	903.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	30.831.132	20.129.465	(18.234.340)	32.726.257
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	2.610.285	1.998.973	(613.881)	3.995.377
	Klasse X (Acc)	USD	4.363	39.031.385	(4.949.148)	34.086.600
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	50.884.969	–	(28.287.669)	22.597.300
	Klasse Y (Acc)	USD	155.815.437	–	(13.306.431)	142.509.006
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	7.388.586	–	–	7.388.586
	Klasse Z (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Inc)^	USD	–	736.446	(148)	736.298
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	2.500.941	1.566.416	(1.457.130)	2.610.227
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	80.889.803	32.021.842	(25.339.914)	87.571.731
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>						
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	136.827	2.406.031	(2.188.053)	354.805
	Klasse C	JPY	700.701	1.841.559	(808.501)	1.733.759
	Klasse C^	USD	–	28.139.699	(28.134.699)	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.994.995	529.036	(2.897.831)	1.626.200
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	Klasse G (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1.083.387	486.838	(81.198)	1.489.027
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	489.734	33.441	(296.092)	227.083
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(82.791)	5.209
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(91.520)	5.480
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.315.391	1.772.674	(962.746)	2.125.319
	Klasse H (Hedged)	USD	253.312	7.012	(34.684)	225.640
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.523.308	6.161.378	(6.418.772)	2.265.914
	Klasse I (Hedged)	USD	465.609	8.604.461	–	9.070.070
	Klasse W	JPY	18.889.337	3.562.173	(2.267.903)	20.183.607
	Klasse W (Acc)	EUR	25.182.710	2.898.589	(2.821.791)	25.259.508
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	630.303	4.003	(38.177)	596.129
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(82.728)	5.272
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(91.474)	5.526
	Sterling W (Acc)	GBP	1.054.479	575.679	(355.362)	1.274.796
	Sterling W (Inc)	GBP	5.316.378	952.120	(442.917)	5.825.581

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>						
	Klasse A	EUR	84.506.257	19.632.881	(22.099.729)	82.039.409
	Klasse A	USD	31.911.348	7.333.249	(10.485.469)	28.759.128
	Klasse A (Inc)	EUR	2.708.345	297.489	(927.325)	2.078.509
	Sterling A (Acc)	GBP	799.496	632.725	(102.096)	1.330.125
	Klasse B	EUR	1.335.311	378.483	(428.597)	1.285.197
	Klasse B	USD	11.094.298	23.403.366	(6.288.751)	28.208.913
	Klasse B (Acc)	SGD	8.327.925	12.228.238	(2.535.801)	18.020.362
	Sterling B (Inc)	GBP	285.939	510.913	(51.685)	745.167
	Klasse C	EUR	48.207.401	9.034.881	(10.083.083)	47.159.199
	Klasse C	USD	95.232.761	7.362.562	(55.615.855)	46.979.468
	Klasse G (Acc)	EUR	2.522.228	289.882	(779.840)	2.032.270
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	JPY	–	10.000	–	10.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	644.076	3.729.333	(123.224)	4.250.185
	Klasse S	EUR	41.110.627	10.400.522	(7.293.226)	44.217.923
	Klasse S (Acc) 1	USD	31.667.725	–	(3.269.470)	28.398.255
	Klasse W	EUR	97.268.019	78.396.848	(71.397.644)	104.267.223
	Klasse W	USD	40.091.670	10.399.889	(14.447.314)	36.044.245
	Klasse W (Hedged)	USD	2.176.148	2.757.490	(1.041.737)	3.891.901
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	276.929	185.296	(100.000)	362.225
	Klasse W (Inc)^	EUR	110.280.944	9	(110.280.953)	–
	Klasse W (Inc)	USD	13.457.168	65.548	(789.863)	12.732.853
	Sterling W (Acc)	GBP	9.728.969	2.325.910	(5.837.702)	6.217.177
	Sterling W (Inc)	GBP	3.947.027	2.448.363	(478.485)	5.916.905
	Klasse X (Acc)^	USD	96.371.579	37.126.294	(133.497.873)	–
	Sterling X	GBP	7.143.040	–	(2.287.029)	4.856.011

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	15.392.119	19.825.045	(8.435.399)	26.781.765
	Klasse A (Acc)	EUR	13.603.780	49.640.157	(7.799.293)	55.444.644
	Klasse A (Inc)	USD	564.120	395.906	(247.091)	712.935
	Klasse A (Inc)	EUR	3.253.144	5.185.678	(1.841.430)	6.597.392
	Klasse B (Acc)	USD	11.262.547	5.606.733	(2.214.444)	14.654.836
	Klasse B (Acc)^	SGD	–	255.652	–	255.652
	Klasse C (Acc)	USD	105.000	4.490.567	(1.809.762)	2.785.805
	Klasse C (Acc)	EUR	8.494.708	14.487.988	(11.642.959)	11.339.737
	Klasse C (Inc)	EUR	1.083.000	31.502	(117.000)	997.502
	Klasse E (Acc)	USD	56.662.786	67.825.096	(19.278.804)	105.209.078
	Klasse E (Acc)	CHF	14.164.783	4.402.094	(3.456.006)	15.110.871
	Klasse E (Acc)	EUR	5.643.411	3.148.925	(1.203.674)	7.588.662
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	15.222.635	4.870.619	(4.105.070)	15.988.184
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	15.437.443	19.281.594	(6.573.897)	28.145.140
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	3.509.649	3.783.077	(350.631)	6.942.095
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	135.221	–	140.221
	Klasse G (Acc)	CHF	364.270	163.505	(39.500)	488.275
	Klasse G (Acc)	EUR	13.130	22.944.323	(22.754.408)	203.045
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	424.699	(113.500)	411.199
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	–	109.519	–	109.519
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	11.880.424	19.134.025	(8.153.399)	22.861.050
	Sterling H (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	257.654	521.415	(222.636)	556.433
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	–	–	615.969
	Klasse K (Acc)	USD	8.242.207	12.566.546	(2.792.296)	18.016.457
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	2.558.128	1.018.307	(711.736)	2.864.699
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	7.565.499	10.378.286	(3.062.453)	14.881.332
	Klasse K (Acc) (Hedged)^	SGD	–	2.547.367	(664.173)	1.883.194
	Klasse K (Inc)	USD	983.707	1.216.712	(184.396)	2.016.023
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	170.038	227.615	(140.614)	257.039
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	390.711	413.713	(144.093)	660.331
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	127.171	396.693	(166.008)	357.856
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	689.217	752.108	(123.980)	1.317.345
	Klasse W (Acc)	USD	45.075.993	58.000.781	(19.538.679)	83.538.095
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	383.064	616.784	(165.530)	834.318
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	32.705.461	33.743.863	(20.274.901)	46.174.423
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	202.888	–	202.888
	Klasse W (Inc)	USD	46.276	672.807	(5.019)	714.064
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	2.405	35.301	(2.405)	35.301
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker*</b>						
	Klasse A^	USD	4.753.892	3.222	(4.757.114)	–
	Klasse A ^	EUR	1.736.077	23.452	(1.759.529)	–
	Klasse C^	USD	3.553.700	–	(3.553.700)	–
	Klasse C ^	EUR	206.768	–	(206.768)	–

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>						
	Klasse A	EUR	2.559.604	497.383	(566.673)	2.490.314
	Klasse A	USD	119.230	62.007	(36.086)	145.151
	Klasse B	EUR	53.912	49.829	–	103.741
	Klasse C	EUR	3.830.665	1.064.634	(1.342.848)	3.552.451
	Klasse C	USD	8.702.409	5.180.810	(1.060.445)	12.822.774
	Klasse W (Acc)	EUR	6.601.948	4.139.568	(2.129.036)	8.612.480
	Sterling W (Acc)^	GBP	2.842	–	(2.842)	–
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse B (Acc)	SGD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc)	USD	5.000	4.605	(4.605)	5.000
	Sterling E (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	–	–	100.000
	Klasse W (Acc)	USD	4.398.090	–	–	4.398.090
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	7.000.331	4.336.597	(4.432.807)	6.904.121
	Klasse A (Acc)	USD	533.306	344.033	(212.600)	664.739
	Klasse A (Inc)	EUR	5.049	1.232.061	(30)	1.237.080
	Klasse C (Acc)	EUR	5.001	–	(1)	5.000
	Klasse E (Acc)	EUR	85.230.803	–	(2.000)	85.228.803
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	12.383.665	2.408.524	(1.394.444)	13.397.745
	Klasse G (Acc)	EUR	2.352.825	214.270	(35.839)	2.531.256
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	494.292	276.414	(40.050)	730.656
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Acc)	EUR	25.959.593	51.005.586	(11.456.899)	65.508.280
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	30.717.378	12.122.450	(1.610.673)	41.229.155
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	2.266.756	4.232.468	(495.350)	6.003.874
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	204.908	469.032	(165.692)	508.248
	Klasse W (Inc)	EUR	5.000	110	(55)	5.055
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	269.756	364.334	(236.055)	398.035
	Klasse X (Acc)	EUR	92.606.686	–	–	92.606.686
	Klasse Z (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse Z (Inc)^	EUR	–	5.101	(50)	5.051
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	100.000	728.573	(90.579)	737.994

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	178.775	17.276.790	(59.348)	17.396.217
	Klasse A (Inc)	EUR	5.000	13	(7)	5.006
	Klasse E (Acc)	EUR	12.954.335	23.184.578	(4.562.772)	31.576.141
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1.324.319	49.450	(40.000)	1.333.769
	Klasse E (Inc)^	EUR	5.000	94	(5.094)	-
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	90.061	(89.688)	5.373
	Klasse W (Acc)	EUR	17.175.274	527.497	(630.741)	17.072.030
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	-	105.514	-	105.514
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	270.520	(100.000)	270.520
	Klasse W (Inc)	EUR	5.000	74	(37)	5.037
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.000	1.374	(89.806)	11.568
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	-	-	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	66.115.897	268.275	-	66.384.172
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*</b>						
	Klasse A^	USD	548.341	16.025	(564.366)	-
	Klasse A ^	EUR	435.964	22.474	(458.438)	-
	Klasse B^	USD	94.858	-	(94.858)	-
	Klasse C^	USD	48.863	-	(48.863)	-
	Klasse C ^	EUR	583	-	(583)	-
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	4.677	43.333	-	48.010
	Klasse B (Inc)	USD	5.156	95.373	(58.862)	41.667
	Klasse C (Acc)^	USD	-	37.005.000	-	37.005.000
	Klasse C (Inc)	USD	908.914	3.825	(908.950)	3.789
	Klasse E (Acc)^	EUR	233.288	-	(233.288)	-
	Klasse E (Inc)	USD	4.012.257	306.865	(2.985.450)	1.333.672
	Klasse E (Inc)	EUR	93.090	13.250	-	106.340
	Sterling E (Acc)	GBP	26.112.518	2.666.272	(8.381.288)	20.397.502
	Sterling E (Inc)	GBP	75.972.715	14.212.203	(16.645.516)	73.539.402
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1.194.700	642.100	(601.000)	1.235.800
	Klasse W (Acc)	USD	19.884.479	7.007.205	(2.202.528)	24.689.156
	Klasse W (Acc)	EUR	16.027.667	3.822.563	(5.046.682)	14.803.548
	Klasse W (Inc)	USD	5.575.000	3.225.000	(625.000)	8.175.000
	Sterling W (Inc)	GBP	14.160.007	1.767.538	(14.642.797)	1.284.748

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	154.164	1.511.572	(638.380)	1.027.356
	Klasse A (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Inc) (M)^	USD	–	5.241	(120)	5.121
	Klasse C (Acc)	USD	130.071.488	28.033.544	(46.067.613)	112.037.419
	Klasse E (Acc)	USD	21.402.258	3.867.095	(227.000)	25.042.353
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.550.000	1.049.500	(90.000)	4.509.500
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	4.825.000	1.691.000	–	6.516.000
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	8.248.264	243.687	(121.843)	8.370.108
	Klasse G (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling G (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.799	(90.719)	10.080
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	3.361.733	24.626.845	(6.291.619)	21.696.959
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	–	100.000	(85.328)	14.672
	Sterling H (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	(87.818)	12.182
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	167.930	569.350	(158.014)	579.266
	Klasse P (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse P (Acc) (Hedged)^	AUD	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Inc)^	USD	–	5.112	(56)	5.056
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	AUD	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)	USD	40.308.451	138.721.862	(11.777.376)	167.252.937
	Klasse W (Acc)	EUR	5.091	56.000.475	(3.634.343)	52.371.223
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	27.244.051	7.090.572	(5.254.960)	29.079.663
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	33.024.845	179.612.227	(33.864.563)	178.772.509
	Klasse W (Inc)	USD	62.960.471	31.527.679	(72.141.697)	22.346.453
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	6.574.781	1.000.000	(574.781)	7.000.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	143.328.872	57.079.312	(23.953.045)	176.455.139
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	215.000	(90.000)	125.000
	Klasse X (Acc)^	USD	7.976.912	–	(7.976.912)	–
	Klasse Z (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	CHF	–	100.000	(90.000)	10.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	EUR	–	598.025	(90.000)	508.025
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	(90.000)	10.000
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Acc)^	EUR	–	208.615	–	208.615
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	1.088.955.974	(274.778.335)	814.177.639
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	2.505.000	–	2.505.000
	Klasse X (Acc)^	EUR	–	7.349	(2.350)	4.999
	Klasse Z (Acc)^	EUR	–	177.838.000	(6.284.299)	171.553.701

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2020 waren wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>						
	Klasse C	EUR	3.649	–	(550)	3.099
	Klasse C (Inc)	EUR	2.085	1.985	(2.000)	2.070
	Klasse D (Acc)	EUR	50	–	(50)	–
	Klasse R	EUR	83.841	3.083	(31.944)	54.980
	Klasse R (Hedged)	USD	53.073	172	(41.211)	12.034
	Klasse R (Inc)	EUR	16.160	257	(9.009)	7.408
	Klasse S	EUR	471.511	12.888	(412.564)	71.835
	Klasse S (Inc)	EUR	53	–	(53)	–
	Klasse T (Hedged)	CHF	343	–	–	343
	Klasse T (Hedged)	USD	71.235	17.310	(9.844)	78.701
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	77.650	22.133	(1.769)	98.014
	Klasse W (Acc)	EUR	2.527	–	(1.289)	1.238
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	33.918	833	(9.457)	25.294
	Klasse W (Inc) (Hedged)	USD	1.036	6	(1.042)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	933.165	107.320	(79.255)	961.230
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.951	–	–	1.951
	Klasse X	EUR	1.708.506	7.027	(280.701)	1.434.832
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	1.000	–	(1.000)	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	86.677	779.865	–	866.542
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>						
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	212.885	–	–	212.885
	Klasse R (Hedged)	CHF	50.805	–	(33.779)	17.026
	Klasse R (Hedged)	EUR	83.599.873	2.167.386	(36.370.824)	49.396.435
	Klasse R (Hedged)	USD	6.922.055	249.393	(1.151.998)	6.019.450
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	4.941.271	2.980	(1.620.985)	3.323.266
	Sterling R (Acc)	GBP	736.190	169.099	(169.198)	736.091
	Sterling S (Acc)	GBP	325.042	147.124	(232.660)	239.506
	Klasse T (Hedged)	EUR	61.142.372	10.924.250	(40.814.635)	31.251.987
	Klasse T (Hedged)	USD	7.632.464	–	(7.043.602)	588.862
	Klasse U (Hedged)	EUR	87.518.455	2.255.502	(24.532.504)	65.241.453
	Klasse U (Hedged)	USD	3.149.480	167.889	(1.098.215)	2.219.154
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	105.616	–	(105.597)	19
	Sterling U (Acc)	GBP	6.185.440	310.379	(2.958.439)	3.537.380
	Sterling X (Acc)	GBP	108.311.163	2.663.002	(41.799.752)	69.174.413
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>						
	Klasse F (Acc)	EUR	–	503.305	–	503.305
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	3.272.563	354.407	(1.018.881)	2.608.089
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	1.957.015	–	2.057.015
	Klasse U (Acc)	EUR	19.881.737	–	(86.600)	19.795.137
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	–	844.568	(98.796)	745.772
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse X (Acc)	EUR	4.936.321	–	–	4.936.321



## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Asia Rising Stars Fund**</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	30.994	–	(30.994)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1.620.654	11.172	(1.631.826)	–
	Klasse W (Acc)	USD	5.000.000	–	(5.000.000)	–
	Klasse X (Acc)	USD	239.058	12.942	(252.000)	–
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	4.679.916	3.023.877	(3.661.295)	4.042.498
	Klasse A	EUR	2.457.055	2.302.687	(1.001.313)	3.758.429
	Klasse B	USD	2.629.078	81.170	(188.852)	2.521.396
	Klasse B	EUR	22.291	29.176	–	51.467
	Klasse C	USD	249.935	591.225	(135.223)	705.937
	Klasse C	EUR	315.694	246.181	(167.468)	394.407
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	Klasse W	USD	504.566	156.183	–	660.749
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	43.352	–	(27.375)	15.977
	Klasse A (Inc)	EUR	40.398	14.560	–	54.958
	Klasse B (Acc)	USD	107.267	424.440	(424.440)	107.267
	Klasse C (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	Klasse W (Inc)	EUR	20.879.700	3.617.964	(2.850.653)	21.647.011
	Klasse W (Inc)	USD	729.476	2.953.341	(136.817)	3.546.000
	Sterling W (Inc)	GBP	197.066	37.887	(17.500)	217.453
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	48.920	–	53.920
	Klasse E (Acc)	USD	196.450	–	–	196.450
	Klasse E (Acc)	EUR	616.338	–	(300.638)	315.700
	Klasse E (Inc)	USD	588.955	–	(588.955)	–
	Klasse G (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	431.066	159.745	(109.600)	481.211
	Klasse K (Acc)	USD	1.200.119	338.105	(138.520)	1.399.704
	Klasse K (Acc)	EUR	1.664.235	682.621	(362.952)	1.983.904
	Klasse W (Acc)	USD	4.978.700	–	–	4.978.700

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	14.615.128	2.034.000	(5.437.865)	11.211.263
	Klasse A	EUR	17.472.768	8.892.867	(11.685.398)	14.680.237
	Klasse B	USD	1.503.886	1.332.690	(218.080)	2.618.496
	Klasse B	EUR	80.698	24.700	–	105.398
	Sterling B (Acc)	GBP	270.930	711	(76.510)	195.131
	Klasse C	USD	9.502.741	10.490.744	(13.734.237)	6.259.248
	Klasse C	EUR	6.598.761	653.237	(1.332.242)	5.919.756
	Sterling C (Inc)	GBP	50.261	22.254	(41.175)	31.340
	Klasse G (Acc)	USD	4.566	780.000	(784.566)	–
	Klasse G (Acc)	EUR	17.311	1.656.989	(21.144)	1.653.156
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	187.036	85.099	(272.135)	–
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.735.579	1.227.532	(2.603.880)	1.359.231
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	4.166.415	1.011.151	(171.138)	5.006.428
	Klasse W (Acc)	USD	4.219.930	633.575	(3.860.118)	993.387
	Klasse W (Acc)	EUR	2.214.629	1.717.690	(3.371.239)	561.080
	Sterling W (Acc)	GBP	2.914.804	3.542.428	(3.121.553)	3.335.679
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	11.806	–	–	11.806
	Klasse C (Acc)	USD	11.922.329	521.125	(12.132.705)	310.749
	Klasse E (Acc)	USD	12.546.652	2.911.575	(938.614)	14.519.613
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	114.342	40.222	(5.946)	148.618
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc)	USD	50.205	–	–	50.205
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	16.967.969	(16.972.913)	56
	Klasse A (Inc)	USD	5.127	75.291	(142)	80.276
	Klasse C (Acc)	USD	49.811.680	36.728.961	(6.793.176)	79.747.465
	Klasse E (Acc)	USD	10.306.250	4.819.400	(15.125.650)	–
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	1.245.056	(226.066)	1.023.990
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	2.074.436	(1.949.177)	130.259
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	15.545.373	(1.060.892)	14.484.481
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	3.439.804	(42.437)	3.497.367
	Klasse W (Acc)	USD	276.778	45.940.519	(5.466.217)	40.751.080
	Klasse W (Acc)	EUR	5.000	54.533.344	(904.686)	53.633.658
	Klasse W (Inc)	EUR	–	84.414.559	(12.472.262)	71.942.297
	Klasse X (Acc)	USD	76.219.552	13.953.489	(72.602)	90.100.439

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Inc)	USD	–	5.017	(8)	5.009
	Klasse C (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	–	5.017	(8)	5.009
	Klasse E (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse E (Inc)	USD	–	5.017	(8)	5.009
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	–	100.341	(170)	100.171
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.340	(170)	100.170
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	–	100.342	(171)	100.171
	Klasse W (Acc)	USD	–	23.355.282	–	23.355.282
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	–	100.000	–	100.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Inc)	USD	–	5.017	(8)	5.009
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	–	100.342	(171)	100.171
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.340	(170)	100.170
	Klasse X (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	–	49.611.221	(19.127.466)	30.483.755
	Klasse W (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse X (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	72.000	–	72.000
	Klasse C (Acc)	USD	–	339.875	–	339.875
	Klasse W (Acc)	USD	–	48.046.390	–	48.046.390
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	–	8.642.877	(94)	8.642.783
	Klasse X (Acc)	USD	–	214.308.117	–	214.308.117
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	209.012.698	(214.775)	208.797.923
	Klasse X (Inc)	USD	–	549.342.227	(139.272)	549.202.955
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.088	(44)	100.044

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>						
	Klasse A (Inc)	USD	34.017	90.000	(90.000)	34.017
	Klasse A (Inc)	EUR	13.788	805.766	(209.977)	609.577
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	188.437	(5.000)	188.437
	Klasse C (Inc)	USD	–	5.278	(139)	5.139
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	41.805.204	19.641.925	(22.869.495)	38.577.634
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	383.049.420	66.480.608	(191.630.035)	257.899.993
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	22.617.767	2.275.772	(24.791.415)	102.124
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1.932.893	17.079.474	(18.999.336)	13.031
	Klasse K (Acc)	USD	47.587	265.846	–	313.433
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse L (Acc)	USD	5.000	72.604.896	(6.966.079)	65.643.817
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	62.043.995	(4.249.956)	57.894.039
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	38.762.752	3.947.138	(25.612.683)	17.097.207
	Klasse W (Acc)	USD	13.893.024	62.983.675	(13.777.446)	63.099.253
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	101.072	–	(1.072)	100.000
	Klasse W (Inc)	USD	–	5.174	(87)	5.087
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	113.300	26.032.151	(124.443)	26.021.008
	Sterling W (Inc) (hedged)	GBP	–	103.480	(1.740)	101.740
	Klasse X (Acc)	USD	10.052.088	–	(4.964.750)	5.087.338
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	31.691.659	(10.071.416)	21.620.243
	Klasse X (Inc)	USD	–	417.228.767	(417.223.640)	5.127
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>						
	Klasse A	USD	22.690	18.802	(12.329)	29.163
	Klasse A	EUR	74.406	62.735	(47.042)	90.099
	Klasse A (Inc)	USD	–	51	–	51
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	–	346	(19)	327
	Klasse B	USD	5.310	298	(3.436)	2.172
	Klasse C	USD	452.623	64.435	(422.940)	94.118
	Klasse C	EUR	64.171	60.784	(66.107)	58.848
	Klasse G (Inc)	USD	17.748	4.168	(4.206)	17.710
	Klasse H (Hedged)	EUR	118.970	246.406	(240.515)	124.861
	Klasse I (Hedged)	EUR	111.075	158.138	(138.632)	130.581
	Klasse W	USD	274.155	182.128	(200.652)	255.631
	Klasse W	EUR	27.862	26.738	(47.594)	7.006
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	109.822	46.433	(21.086)	135.169
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	35.047	261.247	(52.889)	243.405
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	66.660	–	(8.500)	58.160
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	102.100	110.550	–	212.650
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	28.576	22.819	(23.465)	27.930
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.000	22	(1.022)	–
	Klasse X	USD	583.150	157.602	(66.777)	673.975
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	173.939	–	–	173.939

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>						
	Klasse A	USD	1.077.184	71.933	(616.972)	532.145
	Klasse A	EUR	5.067.485	1.129.718	(1.916.860)	4.280.343
	Klasse C	USD	7.249.256	4.272.502	(6.428.325)	5.093.433
	Klasse C	EUR	3.514.568	68.401	(580.948)	3.002.021
	Klasse C (Inc)	USD	469.373	329.755	(1.078)	798.050
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	2.902.391	532.918	(2.096.025)	1.339.284
	Klasse W	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	5.603.913	179.967	(3.153.561)	2.630.319
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>						
	Klasse A	USD	11.802.086	649.156	(4.359.139)	8.092.103
	Klasse A	EUR	24.984.973	1.922.374	(13.260.825)	13.646.522
	Klasse A (Inc)	USD	152.704	39	(100.020)	52.723
	Klasse A (Inc)	EUR	1.833.714	239.868	(184.724)	1.888.858
	Sterling A (Acc)	GBP	154.941	73.142	(224)	227.859
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	Klasse C	USD	17.422.386	2.403.720	(18.356.968)	1.469.138
	Klasse C	EUR	963.211	3.441	(345.614)	621.038
	Klasse C (Inc)	USD	151.500	177.141	(518)	328.123
	Klasse C (Inc)	EUR	53.809.499	5.000	(38.326.838)	15.487.661
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	–	–	1.615
	Sterling C (Inc)	GBP	237.890	8	(84.549)	153.349
	Klasse H (Hedged)	EUR	38.295.447	988.854	(27.623.778)	11.660.523
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.061.752	1.103.872	(632.520)	2.533.104
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	Klasse W	USD	94.092.016	454.871	(8.005.087)	86.541.800
	Klasse W	EUR	12.896.313	1.765.679	(9.957.933)	4.704.059
	Klasse W (Hedged)	EUR	43.764.703	7.344.548	(42.126.645)	8.982.606
	Klasse W (Inc)	EUR	767.287	–	–	767.287
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	87.265.050	–	(86.777.100)	487.950
	Sterling W (Inc)	GBP	30.533.663	2.397.436	(25.628.965)	7.302.134
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	58.536	524	(21.979)	37.081
	Klasse X	USD	24.543.479	–	(24.543.479)	–
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>						
	Klasse A	EUR	423.504	–	(400.000)	23.504
	Klasse C	USD	256.500	–	–	256.500
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	27.764.843	5.392.326	(6.002.120)	27.155.049

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Inc)	USD	5.438	178	(5.616)	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	61.093.837	63.211.885	(57.876.681)	66.429.041
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse W (Acc)	USD	64.610.852	–	–	64.610.852
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	13.618	–	(6.269)	7.349
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	304.625	102.677	(196.291)	211.011
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>						
	Klasse A	EUR	231.900.850	39.237.742	(155.646.683)	115.491.909
	Klasse A (Inc)	EUR	8.863.753	648.213	(1.423.503)	8.088.463
	Klasse B	EUR	47.258	28.500	(12.808)	62.950
	Klasse B (Inc)	EUR	51.547	–	(34.907)	16.640
	Klasse C	EUR	55.328.003	7.409.550	(20.064.914)	42.672.639
	Klasse C (Inc)	EUR	92.244.036	134.923	(89.756.405)	2.622.554
	Klasse G (Acc)	EUR	512.630	1.144.479	(78.411)	1.578.698
	Klasse H (Hedged)	CHF	5.091.303	17.800	(2.082.563)	3.026.540
	Klasse I (Hedged)	CHF	1.317.815	90.000	(199.300)	1.208.515
	Klasse S	EUR	32.892.612	2.567.862	(21.446.025)	14.014.449
	Klasse W (Acc)	EUR	123.506.634	20.322.464	(82.945.905)	60.883.193
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>						
	Klasse A	EUR	12.672	1.111	(5.368)	8.415
	Klasse C	EUR	49.536	7.669	(16.824)	40.381
	Klasse W (Acc)	EUR	8.347	–	(7.500)	847
	Klasse X	EUR	553.309	41.881	(347.964)	247.226
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>						
	Klasse A	USD	28.076.999	18.969.813	(4.801.358)	42.245.454
	Klasse A	EUR	19.557.312	8.700.153	(6.642.161)	21.615.304
	Klasse B	USD	809.520	18.539	(77.321)	750.738
	Klasse C	USD	101.399.907	9.972.458	(48.961.289)	62.411.076
	Klasse C	EUR	69.614.867	40.357.293	(28.880.984)	81.091.176
	Klasse C (Inc)	USD	717.856	42.750	(206.673)	553.933
	Sterling C (Inc)	GBP	3.115.325	788.683	(668.596)	3.235.412
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.606.915	2.374.427	(1.972.203)	2.009.139
	Klasse I (Hedged)	EUR	569.671	7.334.105	(2.666.767)	5.237.009
	Klasse W (Acc)	USD	25.980.034	1.536.688	(8.778.635)	18.738.087
	Klasse W (Acc)	EUR	4.546	–	–	4.546
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	99.147	–	(99.147)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Klasse X	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	–	1.733.767	(324.390)	1.409.377
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	–	4.327.922	(108.058)	4.219.864

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Inc) (Q)	USD	–	5.024	(12)	5.012
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	7.905.494	4.577.641	(2.194.033)	10.289.102
	Klasse W (Acc)	USD	526.950	7.804.598	(1.477.483)	6.854.065
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.933	468.853	(176.310)	393.476
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	198.781.267	–	198.786.267
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	479.804.141	–	(16.331.863)	463.472.278
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>						
	Klasse A	USD	4.574.656	730.304	(1.915.118)	3.389.842
	Klasse A	EUR	1.847.701	710.028	(923.079)	1.634.650
	Klasse A (Inc)	USD	184.772	600	(7.269)	178.103
	Klasse C	USD	100.134.674	47.146.378	(37.072.325)	110.208.727
	Klasse G (Acc)	EUR	71.517	–	(4.397)	67.120
	Klasse H (Hedged)	EUR	3.923.592	2.487.210	(1.136.540)	5.274.262
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	895.823	149.551	(405.961)	639.413
	Klasse I (Hedged)	EUR	50.866.259	559.955	(40.831.132)	10.595.082
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	5.417.820	156.636	(4.233.975)	1.340.481
	Klasse W	USD	140.198.900	33.741.044	(45.508.442)	128.431.502
	Klasse W (Hedged)	EUR	66.520.694	23.168.964	(15.170.540)	74.519.118
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	2.069.915	311.967	(2.242.100)	139.782
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	8.279.992	1.412.181	(13.159)	9.679.014
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	10.629.004	3.191.292	(5.254.943)	8.565.353
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	101.759	(879)	100.880
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	9.978.715	9.738.487	(28.174)	19.689.028
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	–	10.042.286	(4.279)	10.038.007
	Klasse Z (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling Z (Acc)	GBP	2.923.683	788.909	(501.723)	3.210.869
	Sterling Z (Inc)	GBP	49.000	15.572	(5.022)	59.550
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	–	101.718	(859)	100.859

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>						
	Klasse A	USD	285.175	2.991.402	(3.002.689)	273.888
	Klasse A	EUR	172.282	1.135.757	(263.884)	1.044.155
	Klasse A (Inc)	EUR	108.732	57.213	(78.528)	87.417
	Klasse B (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Inc)	USD	36.014	5.170	(36.014)	5.170
	Klasse B (Inc)	EUR	33.600	80.092	(19.350)	94.342
	Klasse C	USD	145.200	–	(10.200)	135.000
	Klasse C (Acc)	USD	19.042.116	6.017.143	(5.664.710)	19.394.549
	Klasse C (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	14.524	741.411	(703.259)	52.676
	Sterling C (Inc)	GBP	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)	USD	2.031.546	809.623	(444.279)	2.396.890
	Klasse E (Acc)	CHF	2.314.483	335.788	(1.775.807)	874.464
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	120.831	–	(120.831)	–
	Klasse H (Hedged)	EUR	82.490	193.694	(95.756)	180.428
	Klasse I (Hedged)	EUR	261.228	1.947.333	(1.189.747)	1.018.814
	Klasse W (Acc)	USD	491.436	112.032	(413.363)	190.105
	Klasse W (Acc)	EUR	200.000	1.043.335	–	1.243.335
	Klasse W (Inc)	USD	802.450	299.244	(865.496)	236.198
	Klasse W (Inc)	EUR	58.242	7.969	–	66.211
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>						
	Klasse A	USD	10.631.456	28.201.838	(26.663.505)	12.169.789
	Klasse A	EUR	842.452	14.125.024	(13.583.823)	1.383.653
	Klasse B	USD	3.419.993	–	(146.359)	3.273.634
	Klasse B	EUR	16.994	–	–	16.994
	Klasse C	USD	11.002.868	3.743.388	(6.608.619)	8.137.637
	Klasse C	EUR	2.456	–	(2.456)	–
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.617.511	–	(1.373.906)	243.605
	Klasse W (Acc)	USD	17.769.421	9.880.671	(6.461.963)	21.188.129
	Klasse W (Acc)	EUR	174.639.288	28.300.445	(25.933.415)	177.006.318



## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>						
	Klasse A	USD	11.331.359	17.963.536	(19.209.783)	10.085.112
	Klasse A	EUR	32.322.901	19.706.259	(29.481.139)	22.548.021
	Klasse A (Inc)	USD	4.263.198	1.544.500	(2.908.417)	2.899.281
	Klasse A (Inc)	EUR	6.431.195	1.880.771	(2.281.178)	6.030.788
	Sterling A (Acc)	GBP	215.865	232.852	(155.648)	293.069
	Klasse B	USD	10.852.644	2.001.020	(7.464.995)	5.388.669
	Klasse B	EUR	2.148.358	594.150	(1.423.912)	1.318.596
	Klasse B (Inc)	USD	4.887.512	2.211.979	(3.374.304)	3.725.187
	Klasse B (Inc)	EUR	607.167	1.335.880	(356.154)	1.586.893
	Sterling B (Inc)	GBP	2.209.438	305.189	(1.479.732)	1.034.895
	Klasse C	USD	44.369.694	14.549.099	(21.134.515)	37.784.278
	Klasse C	EUR	7.219.977	1.765.016	(3.415.782)	5.569.211
	Klasse C (Inc)	USD	5.156.783	6.347.391	(4.303.637)	7.200.537
	Klasse C (Inc)	EUR	25.442.311	10.635.393	(17.095.820)	18.981.884
	Sterling C (Inc)	GBP	1.702.260	35.909	(994.447)	743.722
	Klasse G (Acc)	EUR	5.923.161	877.944	(5.675.024)	1.126.081
	Klasse H (Hedged)	EUR	12.848.456	3.604.477	(11.359.116)	5.093.817
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	8.403.991	727.133	(2.242.446)	6.888.678
	Klasse I (Hedged)	EUR	11.958.462	489.310	(9.754.074)	2.693.698
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	1.726.498	1.248.553	(2.975.051)	-
	Klasse W	USD	63.581.327	18.071.442	(75.572.460)	6.080.309
	Klasse W	EUR	75.985.225	17.071.796	(77.296.701)	15.760.320
	Klasse W (Acc)	CHF	5.000	-	(5.000)	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1.404.490	7.768.481	(8.963.014)	209.957
	Klasse W (Inc)	USD	23.459.085	5.014.107	(12.530.535)	15.942.657
	Klasse W (Inc)	EUR	492.560.083	37.375.058	(378.075.458)	151.859.683
	Sterling W (Acc)	GBP	4.143.453	1.487.634	(3.612.181)	2.018.906
	Sterling W (Inc)	GBP	28.164.167	6.226.540	(8.770.191)	25.620.516
	Klasse Z (Acc)	USD	14.720.039	2.552.080	(15.160.555)	2.111.564
	Klasse Z (Acc)	EUR	4.104.633	571.328	(4.637.841)	38.120
	Klasse Z (Inc)	USD	4.352.535	2.547.478	(3.768.786)	3.131.227
	Klasse Z (Inc)	EUR	1.712.067	123.482	(1.358.699)	476.850
	Sterling Z (Acc)	GBP	5.000	-	-	5.000
	Sterling Z (Inc)	GBP	4.253.594	557.361	(1.675.837)	3.135.118

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>						
	Klasse A	EUR	6.450.814	1.942.028	(2.481.911)	5.910.931
	Klasse C	USD	26.990.244	31.192.014	(17.366.539)	40.815.719
	Klasse C	EUR	735.094	15.552	(738.451)	12.195
	Klasse C (Inc)	USD	398.288	–	–	398.288
	Klasse H (Hedged)	EUR	802.962	659.570	(293.872)	1.168.660
	Klasse I (Hedged)	EUR	7.396.352	718.344	(468.294)	7.646.402
	Klasse W (Acc)	USD	403.386	14.027.242	(294.222)	14.136.406
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	980.220	219.210	(231.230)	968.200
	Klasse X (Inc)	USD	26.105.970	1.103.420	(5.913.136)	21.296.254
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	20.735.587	617.965	(1.816.011)	19.537.541
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	195.925	–	–	195.925
	Klasse A (Inc)	USD	1.327.381	1.500	(611.888)	716.993
	Klasse A (Inc)	EUR	5.381	1.525	(1.361)	5.545
	Klasse B (Acc)	SGD	–	8.061.974	(176.437)	7.885.537
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	1.413.601	(106.769)	1.311.832
	Klasse B (Inc)	USD	5.239	6.617.883	(131.964)	6.491.158
	Klasse B (Inc)	SGD	–	4.513.887	(84.243)	4.429.644
	Klasse E (Acc)	USD	3.334.753	–	(3.334.753)	–
	Klasse E (Inc)	USD	24.894.194	865.252	(24.882.995)	876.451
	Klasse E (Inc)	EUR	1.645.390	2.428.517	(1.364.447)	2.709.460
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	37.440.985	92.748.269	(50.371.704)	79.817.550
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	134.591	198.954	(9.846)	323.699
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	330.792	740.756	–	1.071.548
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	–	714.582	(44.809)	669.773
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	–	2.328.081	(392.678)	1.935.403
	Klasse W (Acc)	USD	4.361.369	11.300.577	(4.544.302)	11.117.644
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	158.000	22.000	–	180.000
	Klasse W (Inc)	USD	5.238	2.302.752	(125.764)	2.182.226
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	104.822	17.903.988	(108.810)	17.900.000

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	1.302.287	55.243	(495.881)	861.649
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Acc)	USD	27.617.195	520.725	(24.970.387)	3.167.533
	Klasse E (Acc)	USD	359.181	10.321.035	(17.073)	10.663.143
	Klasse E (Acc)	EUR	–	991.680	–	991.680
	Sterling E (Acc)	GBP	14.933.384	1.628.119	(13.635.467)	2.926.036
	Klasse H (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	–	67.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	88.020	3.725	(11.584)	80.161
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Klasse W (Acc)	USD	630.731	498.591	(380.000)	749.322
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	–	67.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.264.676	847.582	(5.118.485)	993.773
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	EUR	1.931.237	871.502	(358.852)	2.443.887
	Klasse A (Inc)	USD	–	5.098	(49)	5.049
	Klasse C (Acc)	EUR	297.855	5.930	(297.855)	5.930
	Klasse E (Inc)	EUR	9.118.379	2.019.450	(4.970.545)	6.167.284
	Klasse W (Acc)	EUR	10.635.492	–	–	10.635.492
	Klasse W (Inc)	EUR	5.257	215	(5.472)	–
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>						
	Klasse A	USD	3.194.801	2.663.530	(3.820.778)	2.037.553
	Klasse A	EUR	9.461.771	2.542.866	(4.548.395)	7.456.242
	Klasse B	USD	788.184	–	(22.656)	765.528
	Klasse C	USD	318.452	11.064	(71.285)	258.231
	Klasse C	EUR	1.716.199	43.267	(1.707.050)	52.416
	Klasse H (Hedged)	EUR	305.681	78.452	(141.688)	242.445
	Klasse I (Hedged)	EUR	14.931	–	–	14.931
	Klasse W (Acc)	USD	693.988	220.410	(910.798)	3.600
	Klasse W (Acc)	EUR	4.816	–	(4.816)	–

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>						
	Klasse A	EUR	610.174.469	289.451.874	(342.660.736)	556.965.607
	Klasse A (Inc)	EUR	16.066.802	4.628.376	(3.172.422)	17.522.756
	Klasse C	EUR	173.479.728	102.804.573	(138.397.587)	137.886.714
	Klasse C (Inc)	EUR	9.822.944	2.610.699	(8.005.348)	4.428.295
	Klasse G (Acc)	EUR	6.956.341	5.124.003	(2.315.459)	9.764.885
	Klasse G (Inc)	EUR	3.882.942	927.271	(518.519)	4.291.694
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	4.047.620	909.258	(435.284)	4.521.594
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	1.807.533	1.627.159	(939.749)	2.494.943
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	911.717	490.791	(154.406)	1.248.102
	Klasse W	EUR	830.859.336	323.295.069	(617.619.909)	536.534.496
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	2.808.037	390.362	(2.678.037)	520.362
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	100.000	2.273.147	(2.373.147)	–
	Klasse W (Inc)	EUR	996.936	47.833	(5.052)	1.039.717
	Klasse X	EUR	773.846.007	54.369.704	(172.671.468)	655.544.243
	Klasse Z (Acc)	EUR	68.493.755	1.497.040	–	69.990.795
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>						
	Sterling B (Acc)	GBP	1.074.324	198.578	(313.506)	959.396
	Sterling B (Inc)	GBP	402.024	–	–	402.024
	Sterling C (Inc)	GBP	524.357	193	(262.184)	262.366
	Sterling W (Acc)	GBP	13.210.743	9.029.399	(10.689.535)	11.550.607
	Sterling W (Inc)	GBP	17.900.675	2.296.922	(10.417.620)	9.779.977
	Sterling X (Acc)	GBP	23.697.167	6.793.661	(6.846.419)	23.644.409
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>						
	Klasse A	USD	63.818.868	11.122.119	(13.108.583)	61.832.404
	Klasse C	USD	28.480.624	6.300.114	(8.641.997)	26.138.741
	Klasse C (Inc)	USD	679.894	–	(670.901)	8.993
	Klasse G (Acc)	USD	8.500	–	(4.250)	4.250
	Klasse W	USD	16.138.800	4.219.626	(7.309.984)	13.048.442
	Klasse W (Inc)	USD	19.660.559	2.960.541	(13.161.536)	9.459.564
	Klasse X	USD	74.532.954	2.653.942	(15.321.134)	61.865.762

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	8.360.338	2.547.626	(7.428.036)	3.479.928
	Klasse A (Inc)	USD	788.187	60.399	(743.718)	104.868
	Klasse C (Acc)	USD	17.364.400	6.835.478	(15.422.319)	8.777.559
	Klasse G (Acc)	USD	40.858	193.143	(63.451)	170.550
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	95.677.185	17.650.297	(52.167.967)	61.159.515
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.547.350	306.164	(777.980)	2.075.534
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	15.645.968	5.066.418	(8.337.308)	12.375.078
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	2.110.936	600.000	(2.000.000)	710.936
	Klasse W (Acc)	USD	53.095.238	29.814.474	(33.895.169)	49.014.543
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	21.474.800	4.342.650	(25.695.550)	121.900
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	78.653.487	39.443.958	(65.640.140)	52.457.305
	Klasse W (Inc)	USD	30.450.000	73.325	(450.000)	30.073.325
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	3.158.511	108.444	(2.003.955)	1.263.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	6.643.996	42.615.560	(18.428.424)	30.831.132
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	2.898.078	321.969	(609.762)	2.610.285
	Klasse X (Acc)	USD	10.749.954	4.363	(10.749.954)	4.363
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	12.447.669	47.357.300	(8.920.000)	50.884.969
	Klasse Y (Acc)	USD	169.466.042	–	(13.650.605)	155.815.437
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	21.084.481	700.525	(14.396.420)	7.388.586
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1.168.654	1.894.037	(561.750)	2.500.941
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	49.447.095	43.499.802	(12.057.094)	80.889.803
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>						
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	25.001	644.449	(532.623)	136.827
	Klasse C	JPY	1.202.391	853.026	(1.354.716)	700.701
	Klasse E (Acc)	EUR	27.386	–	(27.386)	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.943.013	831.873	(779.891)	3.994.995
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	Klasse G (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	998.978	211.139	(126.730)	1.083.387
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1.111.376	308.871	(930.513)	489.734
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.358.545	277.055	(1.320.209)	1.315.391
	Klasse H (Hedged)	USD	260.357	56.931	(63.976)	253.312
	Klasse I (Hedged)	EUR	7.918.537	6.256.937	(11.652.166)	2.523.308
	Klasse I (Hedged)	USD	525.729	–	(60.120)	465.609
	Klasse W	JPY	18.583.198	1.589.816	(1.283.677)	18.889.337
	Klasse W (Acc)	EUR	25.473.131	–	(290.421)	25.182.710
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	697.680	44.000	(111.377)	630.303
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	3.726.016	852.557	(3.524.094)	1.054.479
	Sterling W (Inc)	GBP	1.489.425	4.154.363	(327.410)	5.316.378

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilkategorie	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>						
	Klasse A	EUR	82.971.610	40.210.525	(38.675.878)	84.506.257
	Klasse A	USD	29.632.521	14.748.288	(12.469.461)	31.911.348
	Klasse A (Inc)	EUR	2.773.686	1.333.094	(1.398.435)	2.708.345
	Sterling A (Acc)	GBP	1.177.509	137.608	(515.621)	799.496
	Klasse B	EUR	1.454.363	889.036	(1.008.088)	1.335.311
	Klasse B	USD	7.197.878	19.418.061	(15.521.641)	11.094.298
	Klasse B (Acc)	SGD	11.640.390	15.881.783	(19.194.248)	8.327.925
	Klasse B (Inc)	SGD	5.000	–	(5.000)	–
	Sterling B (Inc)	GBP	337.375	255.641	(307.077)	285.939
	Klasse C	EUR	70.722.755	24.998.043	(47.513.397)	48.207.401
	Klasse C	USD	132.499.568	26.203.619	(63.470.426)	95.232.761
	Klasse G (Acc)	EUR	2.396.806	3.104.864	(2.979.442)	2.522.228
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	100.000	–	–	100.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)	USD	–	100.000	–	100.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	350.806	376.225	(82.955)	644.076
	Klasse S	EUR	60.385.404	7.974.684	(27.249.461)	41.110.627
	Klasse S (Acc) 1	USD	31.667.725	–	–	31.667.725
	Klasse W	EUR	78.408.878	67.603.912	(48.744.771)	97.268.019
	Klasse W	USD	31.583.576	12.045.256	(3.537.162)	40.091.670
	Klasse W (Hedged)	USD	1.672.704	4.353.838	(3.850.394)	2.176.148
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	176.929	–	276.929
	Klasse W (Inc)	EUR	–	115.014.198	(4.733.254)	110.280.944
	Klasse W (Inc)	USD	16.570.366	2.451.002	(5.564.200)	13.457.168
	Sterling W (Acc)	GBP	9.213.718	5.068.439	(4.553.188)	9.728.969
	Sterling W (Inc)	GBP	1.930.348	2.435.447	(418.768)	3.947.027
	Klasse X (Acc)	USD	96.371.579	–	–	96.371.579
	Sterling X	GBP	7.181.908	–	(38.868)	7.143.040

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.978.528	18.064.133	(8.650.542)	15.392.119
	Klasse A (Acc)	EUR	2.842.218	12.815.839	(2.054.277)	13.603.780
	Klasse A (Inc)	USD	218.952	490.682	(145.514)	564.120
	Klasse A (Inc)	EUR	1.591.852	2.662.353	(1.001.061)	3.253.144
	Klasse B (Acc)	USD	14.122.797	834.869	(3.695.119)	11.262.547
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	100.000	–	105.000
	Klasse C (Acc)	EUR	5.000	8.955.292	(465.584)	8.494.708
	Klasse C (Inc)	EUR	1.510.100	405.000	(832.100)	1.083.000
	Klasse E (Acc)	USD	26.175.805	36.353.405	(5.866.424)	56.662.786
	Klasse E (Acc)	CHF	8.209.932	7.284.831	(1.329.980)	14.164.783
	Klasse E (Acc)	EUR	5.055.509	2.364.814	(1.776.912)	5.643.411
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	12.055.197	6.698.926	(3.531.488)	15.222.635
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	11.092.883	8.745.074	(4.400.514)	15.437.443
	Klasse E (Acc) (Hedged)	SGD	199.706	30.000	(229.706)	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1.736.535	2.382.208	(609.094)	3.509.649
	Klasse G (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Acc)	CHF	–	379.270	(15.000)	364.270
	Klasse G (Acc)	EUR	–	13.130	–	13.130
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	2.876.157	16.100.129	(7.095.862)	11.880.424
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	116.167	165.563	(24.076)	257.654
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	–	–	615.969
	Klasse K (Acc)	USD	5.281.336	6.400.765	(3.439.894)	8.242.207
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	1.851.419	1.135.040	(428.331)	2.558.128
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	3.777.563	4.468.706	(680.770)	7.565.499
	Klasse K (Inc)	USD	363.156	648.451	(27.900)	983.707
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	156.161	58.338	(44.461)	170.038
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	139.571	345.890	(94.750)	390.711
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	127.171	–	–	127.171
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	197.511	526.159	(34.453)	689.217
	Klasse W (Acc)	USD	21.314.192	38.165.482	(14.403.681)	45.075.993
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	–	383.064	–	383.064
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.663.383	28.473.156	(6.431.078)	32.705.461
	Klasse W (Inc)	USD	5.004	41.288	(16)	46.276
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	100.080	170.253	(267.928)	2.405
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker</b>						
	Klasse A	USD	6.553.151	759.102	(2.558.361)	4.753.892
	Klasse A	EUR	1.615.040	1.128.580	(1.007.543)	1.736.077
	Klasse C	USD	6.291.236	341	(2.737.877)	3.553.700
	Klasse C	EUR	1.829.874	7.532	(1.630.638)	206.768
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–



## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>						
	Klasse A	EUR	3.896.276	284.771	(1.621.443)	2.559.604
	Klasse A	USD	119.230	5.939	(5.939)	119.230
	Klasse B	EUR	53.912	–	–	53.912
	Klasse C	EUR	7.068.545	404.099	(3.641.979)	3.830.665
	Klasse C	USD	19.787	8.702.409	(19.787)	8.702.409
	Klasse W (Acc)	EUR	6.040.065	3.617.051	(3.055.168)	6.601.948
	Sterling W (Acc)	GBP	17.713	2.842	(17.713)	2.842
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)	SGD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling E (Acc)	GBP	–	5.000	–	5.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Acc)	USD	–	4.398.090	–	4.398.090
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	100.000	–	100.000
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	7.000.331	(5.000)	7.000.331
	Klasse A (Acc)	USD	–	533.306	–	533.306
	Klasse A (Inc)	EUR	5.029	40	(20)	5.049
	Klasse C (Acc)	EUR	5.000	13.859	(13.858)	5.001
	Klasse E (Acc)	EUR	47.562.993	37.671.598	(3.788)	85.230.803
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	11.504.332	1.776.001	(896.668)	12.383.665
	Klasse G (Acc)	EUR	191.825	2.251.000	(90.000)	2.352.825
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	–	613.571	(119.279)	494.292
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse W (Acc)	EUR	1.794.555	24.377.018	(211.980)	25.959.593
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	–	31.543.233	(825.855)	30.717.378
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	–	2.466.516	(199.760)	2.266.756
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	304.908	(100.000)	204.908
	Klasse W (Inc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.090	469.671	(300.005)	269.756
	Klasse X (Acc)	EUR	113.498.518	7.668.168	(28.560.000)	92.606.686
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	USD	–	100.000	–	100.000
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	–	100.000	–	100.000

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	–	183.775	(5.000)	178.775
	Klasse A (Inc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)	EUR	–	19.657.748	(6.703.413)	12.954.335
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	–	1.439.319	(115.000)	1.324.319
	Klasse E (Inc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)	EUR	–	17.175.274	–	17.175.274
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse W (Inc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	65.852.584	263.313	–	66.115.897
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund</b>						
	Klasse A	USD	706.599	18.506	(176.764)	548.341
	Klasse A	EUR	492.090	107.180	(163.306)	435.964
	Klasse B	USD	94.858	–	–	94.858
	Klasse C	USD	6.608.970	2.666.488	(9.226.595)	48.863
	Klasse C	EUR	583	–	–	583
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	(5.000)	–
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	EUR	4.677	–	–	4.677
	Klasse B (Inc)	USD	5.030	252	(126)	5.156
	Klasse C (Inc)	USD	908.914	–	–	908.914
	Klasse E (Acc)	EUR	479.295	121.432	(367.439)	233.288
	Klasse E (Inc)	USD	5.069.996	–	(1.057.739)	4.012.257
	Klasse E (Inc)	EUR	337.310	–	(244.220)	93.090
	Sterling E (Acc)	GBP	62.820.458	5.737.189	(42.445.129)	26.112.518
	Sterling E (Inc)	GBP	138.802.914	12.888.379	(75.718.578)	75.972.715
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	2.437.935	389.360	(1.632.595)	1.194.700
	Klasse W (Acc)	USD	19.594.548	782.055	(492.124)	19.884.479
	Klasse W (Acc)	EUR	9.444.727	14.448.803	(7.865.863)	16.027.667
	Klasse W (Inc)	USD	6.319.049	–	(744.049)	5.575.000
	Sterling W (Inc)	GBP	31.207.152	329.635	(17.376.780)	14.160.007

## 2. ANTEILS KAPITAL Forts.

### EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>						
	Klasse A (Acc)	USD	–	154.164	–	154.164
	Klasse C (Acc)	USD	117.766.628	55.240.166	(42.935.306)	130.071.488
	Klasse E (Acc)	USD	27.716.258	2.170.000	(8.484.000)	21.402.258
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.400.000	200.000	(50.000)	3.550.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	2.244.788	7.710.212	(5.130.000)	4.825.000
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	5.170.252	3.306.024	(228.012)	8.248.264
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	538.026	21.663.693	(18.839.986)	3.361.733
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	133.496	76.463	(42.029)	167.930
	Klasse W (Acc)	USD	16.903.757	27.119.568	(3.714.874)	40.308.451
	Klasse W (Acc)	EUR	30.005.000	7.620.463	(37.620.372)	5.091
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	18.916.551	11.362.500	(3.035.000)	27.244.051
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	9.019.000	25.716.820	(1.710.975)	33.024.845
	Klasse W (Inc)	USD	640.000	65.242.344	(2.921.873)	62.960.471
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	6.574.781	–	–	6.574.781
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	130.370.454	12.958.418	–	143.328.872
	Klasse X (Acc)	USD	15.000.000	–	(7.023.088)	7.976.912

\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

\*\* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

## 3. MANAGEMENT- UND PERFORMANCEGEBÜHREN

### MANAGEMENTGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf den Erhalt einer jährlichen Managementgebühr für jede Anteilsklasse, die täglich aufläuft und monatlich nachträglich zahlbar ist und auf einem vereinbarten Jahressatz beruht, der im entsprechenden Nachtrag zum Prospekt festgelegt ist. Nachstehende Tabelle führt die Bandbreite der Sätze für die jährliche Managementgebühr für jede Anteilsklasse auf:

Anteilsklasse	Satz	Anteilsklasse	Satz
Klasse A	0,40 % - 2,00 %	Klasse L	0,16 %
Klasse B	0,75 % - 1,50 %	Klasse N	0,90 %
Klasse C	0,30 % - 1,00 %	Klasse P	1,10 %
Klasse D	0,50 % - 1,00 %	Klasse R	0,60 % - 1,50 %
Klasse E	0,08 % - 2,00 %	Klasse S	0,40 % - 1,00 %
Klasse F	0,10 % - 0,45 %	Klasse T	0,40 % - 1,00 %
Klasse G	0,30 % - 1,00 %	Klasse U	0,20 % - 0,85 %
Klasse H	0,40 % - 2,00 %	Klasse W	0,20 % - 0,80 %
Klasse I	0,30 % - 1,00 %	Klasse X	Keine
Klasse J	1,25 % - 1,50 %	Klasse Y	Keine
Klasse K	0,30 % - 1,40 %	Klasse Z	0,25 % - 0,65 %

Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufenen Managementgebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Managementgebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

### 3. MANAGEMENT- UND PERFORMANCEGEBÜHREN Forts.

#### PERFORMANCEGEBÜHREN

Neben der jährlichen Managementgebühr hat die Verwaltungsgesellschaft bei bestimmten Anteilsklassen der folgenden Fonds Anspruch auf eine jährliche Performancegebühr (die „Performancegebühr“), wie in dem betreffenden Nachtrag zum Prospekt erläutert. Nachstehende Tabelle führt die Sätze für die Performancegebühr und die Referenzwerte der jeweiligen Anteilsklasse auf:

Fonds	Referenzwert	Satz
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	3-Monats-EURIBOR/USD LIBOR/GBP LIBOR/CHF LIBOR/JPY LIBOR	Klassen D, R, S und T – 10,00 %
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	1-Monats-EURIBOR/USD LIBOR/GBP LIBOR/CHF LIBOR	Klassen D, R, S, T und U – 15,00 %
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>	1-Monats-EURIBOR/GBP LIBOR/USD LIBOR/CHF LIBOR/JPY LIBOR	Klassen D, F, R, S, T und U – 15,00 %
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund<sup>^</sup></b>	S&P 500 Net Total Return Index in USD	Klassen D, F, S, T und U – 10,00 %
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund<sup>^</sup></b>	MSCI World Index (Nettodividende reinvestiert) in Euro/ USD	Klasse U – 10,00 %
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>	MSCI World Daily (Nettodividende reinvestiert) in Euro/ USD	Klasse S – 15,00 %

<sup>^</sup> Dieser Fonds hatte weder im laufenden noch in früheren Geschäftsjahren Anteilsklassen ausgegeben, die zu einer Performancegebühr berechtigten.

Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufenen Performancegebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Performancegebühr“ und „Zahlbare Performancegebühren“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

### 3. MANAGEMENT- UND PERFORMANCEGEBÜHREN Forts.

#### PERFORMANCEGEBÜHREN (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle sind die Performancegebühren gemäß Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 aufgeführt, aufgeschlüsselt nach Anteilsklassen der Fonds:

Fonds	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Fonds	Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2021	Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>		<b>Summe</b>	<b>160</b>	<b>19.018</b>
	Klasse D (Acc)	EUR	EUR	–
	Klasse R	EUR	EUR	–
	Klasse R (Hedged)	USD	EUR	160
	Klasse R (Inc)	EUR	EUR	–
	Klasse S	EUR	EUR	–
	Klasse S (Inc)	EUR	EUR	–
	Klasse T (Hedged)	CHF	EUR	–
	Klasse T (Hedged)	USD	EUR	–
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	16.015
			–	–
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>		<b>Summe</b>	<b>4.569</b>	<b>–</b>
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	GBP	–
	Klasse R (Hedged)	CHF	GBP	–
	Klasse R (Hedged)	EUR	GBP	–
	Klasse R (Hedged)	USD	GBP	425
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	GBP	–
	Sterling R (Acc)	GBP	GBP	–
	Sterling S (Acc)	GBP	GBP	–
	Klasse T (Hedged)	EUR	GBP	–
	Klasse T (Hedged)	USD	GBP	1.050
	Klasse U (Hedged)	EUR	GBP	–
	Klasse U (Hedged)	USD	GBP	3.093
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	GBP	–
	Sterling U (Acc)	GBP	GBP	1
			–	–
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>		<b>Summe</b>	<b>92.174</b>	<b>328.341</b>
	Klasse F (Acc)	EUR	EUR	6.709
	Klasse F (Acc) (Hedged)^	CHF	EUR	1.993
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	EUR	10.501
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	33.373
	Klasse R (Acc)^	EUR	EUR	69
	Klasse U (Acc)	EUR	EUR	34.689
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	EUR	3.016
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	EUR	1.739
	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	EUR	85
			–	198
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>		<b>Summe</b>	<b>–</b>	<b>319.072</b>
	Klasse S (Acc)	USD	EUR	–
	Klasse S (Acc) 1	USD	EUR	–
			–	256.169
			–	62.903

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

#### **4. VERWALTUNGSGEBÜHREN**

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt an die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (der „Administrator“) aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten des Administrators aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten des Administrators aufgelaufenen Gebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Betriebliche Aufwendungen“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

#### **5. VERWAHRSTELLENGEBÜHREN**

Die Gesellschaft zahlt an die Verwahrstelle aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten der Verwahrstelle aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten der Verwahrstelle aufgelaufenen Gebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Verwahrstellengebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

#### **6. AUSGABENBERGRENZE**

Von Zeit zu Zeit wird für bestimmte Fonds eine Ausgabenobergrenze eingeführt, wobei Ausgaben, die eine vereinbarte Höhe des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds überschreiten, von der Verwaltungsgesellschaft oder ihrer Tochtergesellschaft getragen werden. Die Ausgabenobergrenze wird dann so lange auf den betreffenden Fonds angewendet, bis der Verwaltungsrat einer Änderung der entsprechenden Ausgabenobergrenze zustimmt. Jede Änderung einer Ausgabenobergrenze, die zu einer Erhöhung der Ausgaben führt, wird den betroffenen Anteilsinhabern mitgeteilt. Zum Datum dieses Abschlusses gelten die folgenden Ausgabenobergrenzen:

## 6. AUSGABENBEREICH FORTS.

### Fonds

#### BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

BNY Mellon Asia Rising Stars Fund (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 2. September 2020)

#### BNY Mellon Asian Income Fund

#### BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

#### BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund\*

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund\* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 26. Februar 2021)

#### BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 15. September 2020)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 10. März 2020)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund<sup>(11)</sup> (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 21. September 2020)

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

BNY Mellon Future Earth Fund\* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

BNY Mellon Future Food Fund\* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

BNY Mellon Future Life Fund\* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

#### BNY Mellon Global Credit Fund<sup>(9)</sup>

#### BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

#### BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

#### BNY Mellon Global Leaders Fund

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund\* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 18. März 2021)

#### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

#### BNY Mellon Global Unconstrained Fund

#### BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

#### BNY Mellon Mobility Innovation Fund

BNY Mellon S&P 500<sup>®</sup> Index Tracker\* (mit Höchstgrenze ab dem 24. Juni 2020 bis zum Schließungstermin am 15. Januar 2021)

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 14. Dezember 2020)

#### BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 6. Februar 2020)

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund\* (mit Höchstgrenze ab dem 5. November 2020 bis zum Schließungstermin am 5. März 2021)

#### BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

#### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

#### Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund\*

### Vereinbarte Grenze für die Gesamtkostenquote („TER“)

TER-Grenze der jährlichen Verwaltungsgebühr („JVG“) plus 15 Basispunkte  
TER-Grenze der JVG plus 50 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte<sup>(1)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 22 Basispunkte<sup>(2)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte<sup>(3)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte<sup>(4)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte<sup>(5)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte<sup>(6)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte<sup>(7)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte<sup>(8)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 30 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 12 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte<sup>(10)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte<sup>(11)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte<sup>(12)</sup>

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 24 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte<sup>(13)</sup>

<sup>(1)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklassen EUR X (Acc) (Hedged), Sterling X (Acc) und USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6,3 Basispunkte.

<sup>(2)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte.

<sup>(3)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte und Anteilsklasse Sterling W (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

<sup>(4)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

<sup>(5)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte. In Bezug auf die Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) wurde die TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte mit Wirkung vom 1. Oktober 2021 in eine TER-Grenze ohne JVG plus 8 Basispunkte geändert. Dies führte zu einem Managementgebührenverzicht für die Klasse Sterling L (Acc) (Hedged) in Höhe von 4.147 USD für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 31. Dezember 2021.

<sup>(6)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD X (Acc), USD X (Inc), Sterling X (Acc) (Hedged) und Sterling X (Inc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

<sup>(7)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD L (Acc), EUR L (Acc) (Hedged), Sterling L (Acc) (Hedged), Sterling L (Inc) (Hedged), Sterling X (Acc) (Hedged), USD X (Acc) und USD X (Inc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

<sup>(8)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

<sup>(9)</sup> Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte und Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der

## 6. AUSGABENBEREICH FORTS.

JVG plus 7 Basispunkte.

<sup>(10)</sup> Anzuwenden auf die Anteilsklassen Sterling Y (Acc) (Hedged) und USD Y (Acc).

<sup>(11)</sup> Anzuwenden auf die Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged).

<sup>(12)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklassen CHF E (Acc) Hedged und EUR E (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5 Basispunkte; und der Anteilsklassen EUR A (Acc), EUR A (Inc), EUR C (Acc), EUR G (Acc), EUR W (Acc) und EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 12,5 Basispunkte.

<sup>(13)</sup> Mit Ausnahme der Anteilsklasse EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die über die Obergrenze hinausgehenden Gesamtkosten, die der Gesellschaft während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 in Rechnung gestellt wurden, betragen 1.595.729 USD (31. Dezember 2020: 1.187.133 USD).

## 7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN

Die in der Gesamtergebnisrechnung enthaltenen betrieblichen Aufwendungen beinhalten:

Aufwendungen	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
	USD	USD
Verwaltungsgebühr	12.290.441	8.988.627
Prüfungsgebühr	835.924	697.919
Verwaltungsratshonorare	108.786	82.642
Sonstige Aufwendungen	2.862.284	4.252.716
<b>Betriebliche Aufwendungen insgesamt</b>	<b>16.097.435</b>	<b>14.021.904</b>

Die für das Geschäftsjahr berechneten Honorare und Auslagen für die Leistungen der Abschlussprüfer Ernst & Young stellen sich wie folgt dar:

	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
	USD	USD
Abschlussprüfung des Jahresabschlusses (Irland)	586.172	519.691
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Vereinigtes Königreich)	160.690	178.228
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Österreich)	89.062	–
<b>Summe</b>	<b>835.924</b>	<b>697.919</b>

## 8. TRANSAKTIONSKOSTEN

Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten zu erwerben. Sie umfassen die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs sowie die an Bevollmächtigte, Berater, Makler und Händler gezahlten Gebühren und Provisionen.

Die Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Aktien und derivativen Finanzinstrumenten sind unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen und in nachstehender Tabelle angegeben. Bei allen anderen Wertpapieren ist die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs im Kauf- und Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten und kann nicht getrennt geprüft oder offen gelegt werden.

Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b> >	EUR	135.107	18.742
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	GBP	712.251	825.225
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b> >	EUR	992.374	351.943
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>	USD	136.887	86.559
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>	USD	62.558	k. A.
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	USD	70.984	8.584
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>	USD	111.398	135.961
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund</b> *	USD	9.459	k. A.



## 8. TRANSAKTIONSKOSTEN Forts.

Fonds	Basiswahrung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	USD	2.327	26.021
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	34.261	38.217
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund>	USD	652	1.085
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund>	USD	31.657	4.885
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund>	USD	3	6.106
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund>	USD	5.301	k. A.
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund>	USD	1.029	1.853
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund>	USD	101	13
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund>	USD	2.434	11
BNY Mellon Euroland Bond Fund>	EUR	40.423	373.666
BNY Mellon European Credit Fund>	EUR	4.177	6.411
BNY Mellon Future Earth Fund*	USD	3.028	k. A.
BNY Mellon Future Food Fund*	USD	2.579	k. A.
BNY Mellon Future Life Fund*	USD	2.221	k. A.
BNY Mellon Global Bond Fund>	USD	18.499	8.126
BNY Mellon Global Credit Fund>	USD	42.510	7.516
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	USD	38.020	42.911
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	175.682	65.395
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	180.830	173.598
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	605.809	835.414
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund>	USD	84	23.760
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	363.151	572.301
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	23.041	47.648
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*	EUR	11.011	10.948
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	17.639	25.578
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	2.196.358	3.190.081
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	GBP	41.911	68.892
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	USD	298.791	281.952
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund>	USD	3.234	k. A.
BNY Mellon Global Unconstrained Fund>	USD	14.326	11.491
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	8.632.704	k. A.
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	489.111	401.144
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	631.663	298.338
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*	USD	1.692	1.327
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	95.927	47.177
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	2.982	1.038
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	EUR	16.808	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	80.897	49.695
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund>	USD	5.369	807
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	USD	1.556	29.150
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	170.009	269.655
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	EUR	13.741	k. A.

\* Siehe Erluterung 19 zum Abschluss.

> Die Transaktionskosten fur den Kauf und Verkauf von Anleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie konnen jedoch weder zweckmaig noch zuverlassig zusammengestellt noch getrennt uberpruft oder offen gelegt werden.

## 9. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE

Die Barmittel der Gesellschaft sind bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, hinterlegt und werden von den Kontrahenten (Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse AG, Goldman Sachs, HSBC Bank plc, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Royal Bank of Canada, Royal Bank of Scotland, State Street Bank, Toronto Dominion Bank und UBS AG) in Bezug auf die erforderlichen Sicherheiten und Margenanforderungen gehalten. Barguthaben umfassen taglich in kurzfristige Anlageinstrumente investierte Barmittel.

Kassakontovereinbarungen wurden fur die Fonds infolge neuer Anforderungen fur die Sammelkonten fur Zeichnungs- und Rucknahmebetrage gema dem (Supervision and Enforcement) Act 2013 der (Section 48(1)) Investor Money Regulations 2015 fur Fonds-Dienstleister (Fund Service Providers) („Vorschriften fur Anlegergelder“ – „Investor Money Regulations“) getroffen.

## 9. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE Forts.

Diese Kassakonten, die bei der Verwahrstelle für den Einzug von Zeichnungen und Rücknahmezahlungen sowie für Ausschüttungen der Fonds gehalten werden, gelten als Vermögenswerte der Fonds. Die Guthaben auf diesen Kassakonten am 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 werden in Bezug auf den jeweiligen Fonds, dem sie zustehen, als unwesentlich betrachtet, mit Ausnahme von Barmittelguthaben in Höhe von 21.942 EUR (31. Dezember 2020: 20.492 EUR) für den BNY Mellon Pan European Fund (geschlossen am 9. März 2017) und in Höhe von 36.082 USD (31. Dezember 2020: null USD) für den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker (geschlossen am 15. Januar 2021).

## 10. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und gängiger Praxis ist die Gesellschaft ein Anlageorganismus im Sinne der Definition in Section 739B des Tax Consolidation Acts von 1997 in der jeweils gültigen Fassung. Auf dieser Grundlage unterliegen ihre Erträge und Kapitalgewinne nicht der irischen Steuer.

Allerdings kann eine irische Steuer erhoben werden, wenn ein „steuerpflichtiges Ereignis“ eintritt. Zu den steuerpflichtigen Ereignissen gehören alle Ausschüttungen an Anteilhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen oder Übertragungen von Anteilen und das Halten von Anteilen am Ende jedes Achtjahreszeitraums ab dem Erwerb der Anteile.

Die Gesellschaft ist in Irland in Bezug auf steuerpflichtige Ereignisse, die sich auf folgende Arten von Anteilhabern beziehen, nicht steuerpflichtig:

- (a) Anteilhaber, die zu steuerlichen Zwecken zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig sind noch ihren ständigen Wohnsitz in Irland haben, sofern die entsprechenden gültigen Erklärungen im Sinne des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung bei der Gesellschaft vorliegen; oder die Gesellschaft von der irischen Steuerbehörde die Genehmigung erhalten hat, Bruttzahlungen zu leisten, sofern keine entsprechenden Erklärungen vorliegen; und
- (b) bestimmte in Irland ansässige, ausgenommene Anleger, die der Gesellschaft die unterzeichneten gesetzlich vorgeschriebenen Erklärungen vorgelegt haben.

Es ist möglich, dass Ausschüttungen, Zinsen und etwaige Kapitalgewinne aus Anlagegeschäften der Gesellschaft der Quellensteuer in dem Land unterliegen, aus dem diese Anlageerträge/-gewinne erhalten werden. Diese Steuern werden der Gesellschaft oder den Anteilhabern unter Umständen nicht zurückerstattet.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragsteuer in Brasilien und Indien auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Zum 31. Dezember 2021 wurde für den BNY Mellon Asian Equity Fund eine offene Kapitalertragsteuer in Höhe von 311.766 USD (31. Dezember 2020: 461.455 USD), 1.041.327 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2020: 2.540.087 USD) und 185.048 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2020: 44.734 USD) in der Bilanz ausgewiesen. Für das abgelaufene Geschäftsjahr wurde ein Kapitalertragsteueraufwand von 149.689 USD für den BNY Mellon Asian Equity Fund (31. Dezember 2020: 461.455 USD), 2.418.087 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2020: 3.989.039 USD) und 111.396 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2020: 118.386 USD) in der Gesamtergebnisrechnung unter „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ ausgewiesen.

## 11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Nach Ansicht des Verwaltungsrats gelten die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageverwalter (Mellon Investments Corporation\*, Newton Investment Management Limited, Walter Scott & Partners Limited, Newton Investment Management North America LLC\*, ARX Investimentos Ltda, Insight Investment Management (Global) Limited\*, Alcentra NY, LLC, BNY Mellon Asset Management Japan Limited, Alcentra Limited, Insight North America LLC\*), die Untereinlageverwalter (Insight North America LLC und Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD) und die Vertriebsgesellschaften als der Gesellschaft nahestehende Unternehmen.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt von den von ihr erhaltenen Gebühren die Gebühren der Anlageverwalter und der Vertriebsgesellschaften in Höhe eines zwischen den Parteien vereinbarten jährlichen Satzes. Die im Zusammenhang mit allen sonstigen wesentlichen Transaktionen mit nahestehenden Unternehmen und Personen im Geschäftsjahr gezahlten Gebühren sind in der Gesamtergebnisrechnung sowie in der Erläuterung 3 „Management- und Performancegebühren“, der Erläuterung 4 „Verwaltungsgebühren“, der Erläuterung 5 „Verwahrstellengebühren“, der Erläuterung 6 „Ausgabenobergrenze“ und der Erläuterung 7 „Betriebliche Aufwendungen“ zum Abschluss vollständig ausgewiesen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind der Gesellschaft nahestehende Personen.

## 11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Die folgenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind auch Mitglieder des Verwaltungsrats der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die Verwaltungsgesellschaft) und der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited:

- Greg Brisk
- Gerald Rehn

Greg Brisk und Gerald Rehn haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Die im Geschäftsjahr angefallenen Honorare der Verwaltungsratsmitglieder werden in Erläuterung 7 zum Abschluss offen gelegt.

Greg Brisk ist zudem ein Verwaltungsratsmitglied bei den folgenden Anlageverwaltern der Fonds:

- Alcentra Limited,
- Alcentra NY, LLC,
- Newton Investment Management Limited,
- Insight Investment Management (Global) Limited und
- Insight North America LLC

Greg Brisk ist außerdem Verwaltungsratsmitglied der Insight Global Funds II plc und der Insight Liquidity Funds plc, in die einige Fonds der Gesellschaft investiert haben, sowie der BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited, einem der Gesellschaft nahestehenden Unternehmen. BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited hielt am 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 ein erhebliches wirtschaftliches Eigentum an den Anteilklassen der nachstehend aufgeführten Fonds

Name des Anlegers Fonds	Basis- währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited</b>			
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	21.827.261	21.753.567
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	4.474.114	8.123.954
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	USD	k. A.	166.854
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	153.309	26.336.487
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	26.014	287.561
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	67.771	1.015.640
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	25.655	141.236
BNY Mellon Future Earth Fund*	USD	2.167.175	k. A.
BNY Mellon Future Food Fund*	USD	2.222.200	k. A.
BNY Mellon Future Life Fund*	USD	2.351.704	k. A.
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	Null	49.420
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	148.816	901.073
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*	EUR	k. A.	11.862.378
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	4.611.416	60.670.703
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	150.138	807.120
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	4.976.694	5.004.058
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	EUR	17.298.255	16.355.491
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	USD	148.628	148.784

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die umseitig aufgeführten Fonds investieren in Organismen für gemeinsame Anlagen, die von ihren eigenen Anlageverwaltern verwaltet werden, sowie in andere Fonds der Gesellschaft.

## 11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Fonds	Organismus für gemeinsame Anlagen (OGA)	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>				
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	38.545.235	–
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	EUR	–	7.123.756
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	GBP	12.006.736	23.076.810
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	EUR	6.876.198	2.887.304
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	28.749.161	7.896.733
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	4.014.000	5.770.066
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>				
	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	EUR	–	4.951.369
	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	EUR	2.426.564	2.285.716
	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	EUR	–	7.993.557
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>				
	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	EUR	432.807	753.744
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	1.040.687	1.254.152
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	850.000	14.546.122
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>				
	BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	6.620.068	6.139.869
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	73.536.026	37.621.950

Im Geschäftsjahr wurden von den Anlageverwaltern der Verwahrstelle und den Anlageverwaltern nahestehenden Unternehmen zur Ausführung der Anlage- und Devisengeschäfte sowie zur Annahme von Einlagen im Auftrag der Anlageverwalter ausgewählt. The Bank of New York Mellon, New York, und The Bank of New York Mellon, London, waren Kontrahenten bei am Ende des Geschäftsjahres offenen Devisenterminkontrakten, die in der Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesen sind. Die Kontrahenten wurden von den Anlageverwaltern ausgewählt und die Bedingungen dieser Geschäfte wurden von den Anlageverwaltern mit den entsprechenden Unternehmen ausgehandelt.

Die Verwaltungsgesellschaft besitzt 38.092 (31. Dezember 2020:38.092) Zeichneranteile, wie in Erläuterung 2 zum Abschluss erläutert. Es gab keine oberste beherrschende Partei der Gesellschaft in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020..

## 12. VERRECHNUNGSPROVISION (SOFT COMMISSION) UND MAKLERDIENSTLEISTUNGSVEREINBARUNGEN

Im Geschäftsjahr trafen die Mellon Investments Corporation und ARX Investimentos Ltda (die „Anlageverwalter“) Soft-Commission-Vereinbarungen (auch „Soft-Dollar-Vereinbarungen“ genannt) mit Maklern, und in diesem Zusammenhang wurden bestimmte Waren und Dienstleistungen zur Unterstützung des Anlageprozesses entgegengenommen. Die Anlageverwalter leisten für diese Dienstleistungen keine direkte Zahlung, sondern vergüten die Makler entweder über Provisionen auf Transaktionen oder sorgen dafür, dass die ausführenden Kontrahenten die ihnen zugeteilte Researchprovision ganz oder teilweise an andere Makler oder Researchanbieter zahlen, die keine Maklerfunktion innehaben. Die für die Gesellschaft eingesetzten Waren und Dienstleistungen umfassen wirtschaftliche und politische Analysen, branchen- oder unternehmensspezifische anlagebezogene Recherchen und die aktive Orderverwaltung durch Makler. Die Anlageverwalter sind der Ansicht, dass die Anleger Vorteile aus diesen Vereinbarungen ziehen, und dass die Maklergebühren nicht die üblichen Maklergebühren für den umfassenden institutionellen Anlegerservice überschreiten.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

### 13. WECHSELKURSE

Der Jahresabschluss wird in US-Dollar (USD) erstellt. Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in US-Dollar verwendet:

Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
Argentinischer Peso	102,6909	84,0839
Australischer Dollar	1,3745	1,2971
Brasilianischer Real	5,5700	5,1942
Kanadischer Dollar	1,2650	1,2729
Chilenischer Peso	852,0000	710,5000
Chinesischer Yuan	6,3575	6,5029
Kolumbianischer Peso	4.066,0000	3.415,5000
Tschechische Krone	21,8494	21,4775
Dänische Krone	6,5321	6,0924
Dominikanischer Peso	k. A.	58,2500
Ägyptisches Pfund	15,7100	15,7300
Euro	0,8783	0,8186
Hongkong-Dollar	7,7976	7,7525
Ungarischer Forint	324,4621	296,8486
Indische Rupie	74,3357	73,0675
Indonesische Rupiah	14.252,5000	14.050,0000
Israelischer Schekel	3,1090	3,2135
Japanischer Yen	115,0300	103,2550
Kasachischer Tenge	434,8050	421,1550
Koreanischer Won	1.188,7500	1.086,3000
Malaysischer Ringgit	4,1660	4,0225
Mexikanischer Peso	20,4755	19,8995
Neuseeländischer Dollar	1,4601	1,3899
Norwegische Krone	8,8066	8,5743
Peruanischer neuer Sol	3,9915	3,6200
Philippinischer Peso	50,9925	48,0235
Polnischer Zloty	4,0292	3,7357
Rumänischer Leu	4,3468	3,9838
Russischer Rubel	75,0888	73,9463
Singapur-Dollar	1,3476	1,3216
Südafrikanischer Rand	15,9350	14,6950
Pfund Sterling	0,7388	0,7313
Schwedische Krone	9,0362	8,2276
Schweizer Franken	0,9112	0,8853
Taiwan-Dollar	27,6670	28,0980
Thailändischer Baht	33,4050	29,9600
Türkische Lira	13,2290	7,4330
Ukrainische Hrywnja	k. A.	28,3350
Uruguayischer Peso	44,7000	42,4750

### 13. WECHSELKURSE Forts.

Bei der Erstellung der Bilanz wurden für die Konsolidierung der Abschlüsse der Fonds folgende Wechselkurse gegenüber dem US-Dollar verwendet:

	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
	Schlusskurs	Mittelkurs	Schlusskurs	Mittelkurs
Euro	0,8783	0,8457	0,8186	0,8773
Japanischer Yen	115,0300	109,8126	103,2550	106,7768
Pfund Sterling	0,7388	0,7271	0,7313	0,7799

### 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Die Gesellschaft und jeder Fonds können für Anlagezwecke in derivative Finanzinstrumente („FDI“) investieren, sofern dies im jeweiligen Nachtrag zum Prospekt angegeben ist. Ferner kann jeder Fonds gemäß den von der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen, Techniken und Instrumente für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung oder zur Absicherung gegen Wechselkursrisiken einsetzen.

Zu solchen Anlagetechniken und -instrumenten zählen u. a. Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Optionsscheine, Wertpapierleihvereinbarungen, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, Devisenterminkontrakte und „When issued“- und/oder „Delayed Delivery“-Wertpapiere.

Geschäfte mit dem Vermögen eines Fonds dürfen für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen werden, um eines der folgenden Ziele zu erreichen: eine Risikominderung, eine Kostensenkung ohne Erhöhung oder mit minimaler Erhöhung des Risikos oder Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder Einkommens ohne bzw. mit annehmbar geringem Risikoniveau (im Verhältnis zum erwarteten Ertrag). Die Gesellschaft legt derzeit in die in der jeweiligen Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesenen Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Devisenterminkontrakte und Genussscheine (P-Notes) an. Einzelheiten zu den am Ende des Geschäftsjahres offenen Transaktionen enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände.

Die Gesellschaft hat mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Verwahrstelle eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen. Die Erträge aus der Wertpapierleihe werden zurzeit im Verhältnis 80 % zu 20 % zwischen der Gesellschaft und The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, aufgeteilt.

Wertpapierleihgeschäfte und die damit verbundenen Sicherheiten werden in Übereinstimmung mit den dreiseitigen (Tri-Party) und bilateralen Vereinbarungen abgewickelt und abgerechnet.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihgeschäften:

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	67.351	(13.470)	53.881
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	5.526	(1.105)	4.421
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	8.964	(1.793)	7.171
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	840	(168)	672
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	12	(2)	10
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	365.844	(73.169)	292.675
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	USD	210	(42)	168
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	30.019	(6.004)	24.015
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	8.497	(1.699)	6.798
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	228	(46)	182
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	377.816	(75.564)	302.252
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	88.914	(17.783)	71.131
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	256.496	(51.299)	205.197
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	5.665	(1.133)	4.532

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %) <sup>^</sup>
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	4.156	(831)	3.325
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	1.526	(305)	1.221
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	25.268	(5.053)	20.215
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	51.829	(10.366)	41.463
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	4.817	(963)	3.854
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	153.458	(30.692)	122.766
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	145.779	(29.156)	116.623
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	51.056	(10.211)	40.845
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	464	(93)	371
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	15.218	(3.043)	12.175
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	103.156	(20.631)	82.525
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	42.307	(8.461)	33.846
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	84.731	(16.946)	67.785
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	969	(194)	775
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*	EUR	72	(14)	58
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	1.418	(284)	1.134
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	179.471	(35.894)	143.577
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	1.512	(302)	1.210
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	8.955	(1.791)	7.164
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	409.280	(81.856)	327.424
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.172	(434)	1.738
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	16.403.953	(3.280.791)	13.123.162
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	80.964	(16.193)	64.771
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	326.838	(65.367)	261.471
BNY Mellon S&P 500 <sup>®</sup> Index Tracker*	USD	65	(13)	52
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	30.781	(6.156)	24.625
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	USD	5	(1)	4
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	23.752	(4.751)	19.001

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

<sup>^</sup> Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihgeschäften:

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %) <sup>^</sup>
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	36.565	(7.313)	29.252
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	18.723	(3.744)	14.979
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	13.270	(2.654)	10.616
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	15.104	(3.021)	12.083
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	2.168	(434)	1.734
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	305	(61)	244
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	14.891	(2.978)	11.913
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	20	(4)	16
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	12	(2)	10
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	13.969	(2.794)	11.175
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	87.284	(17.457)	69.827

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	104.999	(21.000)	83.999
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	4.175	(835)	3.340
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	4.555	(911)	3.644
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	1.526	(305)	1.221
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	14.895	(2.979)	11.916
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	105.617	(21.124)	84.493
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	5.722	(1.144)	4.578
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	171.638	(34.328)	137.310
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	45.923	(9.185)	36.738
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	93.603	(18.720)	74.883
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	3.307	(662)	2.645
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	50.280	(10.056)	40.224
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	307.890	(61.578)	246.312
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	16.958	(3.392)	13.566
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	1	–	1
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	4.611	(922)	3.689
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	EUR	4	(1)	3
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	5.682	(1.137)	4.545
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	464.405	(92.881)	371.524
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	6.280	(1.256)	5.024
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	27.848	(5.570)	22.278
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	529.875	(105.975)	423.900
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.186	(438)	1.748
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	64.746.499	(12.949.300)	51.797.199
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	171.287	(34.257)	137.030
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	39.427	(7.885)	31.542
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	2.231	(446)	1.785
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	52.350	(10.470)	41.880
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	1.961	(392)	1.569
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	16.998	(3.399)	13.599

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.



## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Der Wert der entliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt dar:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>				<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	36.889.140	40.578.423	110,00 %
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.442.491	2.499.672	102,34 %
	J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.786.714	4.175.188	110,26 %
	J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	468.405	516.670	110,30 %
	UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.545.827	1.576.961	102,01 %
	Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	786.667	851.860	108,29 %
	Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	300.079	315.130	105,02 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.056.393	1.165.800	110,36 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	829.741	846.399	102,01 %
	BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	384.177	391.936	102,02 %
	Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	375.150	393.887	104,99 %
	Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	100.026	102.044	102,02 %
				<b>48.964.810</b>	<b>53.413.970</b>	<b>109,09 %</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>				<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>%</b>
	Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	224.919	249.430	110,90 %
	Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	92.532	97.178	105,02 %
	UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	74.793	85.449	114,25 %
	Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	73.101	80.611	110,27 %
	Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	136	148	109,78 %
				<b>465.481</b>	<b>512.816</b>	<b>110,17 %</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>				<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
	UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	1.044.909	1.193.781	114,25 %
				<b>1.044.909</b>	<b>1.193.781</b>	<b>114,25 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	8.999.820	9.899.892	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	167.437	176.096	105,17 %
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.161.413	4.578.147	110,01 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.212.603	2.260.050	102,14 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	510.247	520.521	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	208.342	218.800	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	188.622	207.634	110,08 %
			<b>16.448.484</b>	<b>17.861.140</b>	<b>108,59 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.688.150	2.748.565	102,25 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	207.512	217.284	104,71 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	184.033	187.901	102,10 %
			<b>3.079.695</b>	<b>3.153.750</b>	<b>102,40 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	74.223	75.718	102,01 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	69.253	70.809	102,25 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	12.395	12.978	104,70 %
			<b>155.871</b>	<b>159.505</b>	<b>102,33 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	17.579.746	17.956.724	102,14 %
Goldman Sachs & Company	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.928.662	2.747.408	142,45 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	516.331	540.644	104,71 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	57.401	58.608	102,10 %
			<b>20.082.140</b>	<b>21.303.384</b>	<b>106,08 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	26.073.885	26.621.962	102,10 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	4.735.739	4.842.174	102,25 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.347.247	2.397.581	102,14 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.279.233	1.310.047	102,41 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.102.469	1.125.639	102,10 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	896.594	938.812	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	212.856	223.504	105,00 %
			<b>36.648.023</b>	<b>37.459.719</b>	<b>102,21 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	8.632.407	9.111.422	105,55 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.427.316	1.457.318	102,10 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.667.277	3.851.527	105,02 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.140.779	2.252.912	105,24 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.587.499	3.734.108	104,09 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.295.353	3.366.018	102,14 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.184.458	3.334.406	104,71 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.432.594	2.670.630	109,79 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.195.552	1.255.519	105,02 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	866.822	910.934	105,09 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.775.664	1.864.801	105,02 %
Nomura Securities International Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.768.492	1.948.493	110,18 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.097.531	1.152.554	105,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	494.400	545.120	110,26 %
Morgan Stanley & Co. LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.324.163	1.356.032	102,41 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.234.215	1.261.953	102,25 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	617.920	630.907	102,10 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	532.452	555.704	104,37 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	194.816	204.613	105,03 %
Deutsche Bank Securities Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	181.781	219.907	120,97 %
			<b>39.651.491</b>	<b>41.684.878</b>	<b>105,13 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	440.952	463.142	105,03 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	269.041	282.501	105,00 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	624.501	689.178	110,36 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	412.817	436.343	105,70 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	194.949	199.046	102,10 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	229.038	240.392	104,96 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	209.409	214.116	102,25 %
			<b>2.380.707</b>	<b>2.524.718</b>	<b>106,05 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	7.389.531	8.147.615	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	799.832	882.247	110,30 %
			<b>8.189.363</b>	<b>9.029.862</b>	<b>110,26 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.157.118	1.275.826	110,26 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	253.198	265.120	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	226.465	237.794	105,00 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	206.435	216.807	105,02 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	162.874	166.535	102,25 %
			<b>2.006.090</b>	<b>2.162.082</b>	<b>107,78 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.305.556	6.952.436	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.191.157	1.313.893	110,30 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.194.054	1.219.153	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	913.469	965.527	105,70 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	244.058	256.254	105,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.595.496	1.653.563	103,64 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	597.088	626.910	104,99 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	511.058	535.122	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	483.642	509.053	105,25 %
			<b>13.035.578</b>	<b>14.031.911</b>	<b>107,64 %</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	10.249.868	11.274.888	110,00 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.136.633	4.219.585	102,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.781.625	7.222.548	106,50 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	5.712.167	5.827.153	102,01 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	522.484	532.934	102,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.305.772	3.371.902	102,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.164.510	3.250.351	102,71 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.989.878	2.151.907	108,14 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.041.795	1.062.749	102,01 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	740.329	755.192	102,01 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.211.714	1.262.165	104,16 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	351.396	358.476	102,01 %
			<b>39.208.171</b>	<b>41.289.850</b>	<b>105,31 %</b>
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.496.485	1.526.528	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	458.781	468.023	102,01 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	317.163	323.509	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	110.369	112.598	102,02 %
			<b>2.382.798</b>	<b>2.430.658</b>	<b>102,01 %</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	17.591.293	19.350.454	110,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	15.545.993	16.316.683	104,96 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	57.497	60.369	105,00 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	9.963.920	10.306.625	103,44 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	4.040.190	4.192.556	103,77 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.876.686	5.994.238	102,00 %
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	3.088.783	3.397.669	110,00 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.018.871	3.161.022	104,71 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	646.844	659.815	102,01 %
RBC Dominion Securities Inc	Kanada	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	229.140	252.057	110,00 %
			<b>60.059.217</b>	<b>63.691.488</b>	<b>106,05 %</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	10.177.332	11.231.366	110,36 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	8.962.298	9.176.713	102,39 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Euroclear Triparty - UK Gilts	5.598.780	5.877.031	104,97 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	2.956.651	3.015.592	101,99 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.056.444	5.188.377	102,61 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	542.611	553.343	101,98 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	4.121.519	4.533.679	110,00 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.757.014	3.032.463	109,99 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	480.066	499.637	104,08 %
			<b>40.652.715</b>	<b>43.108.201</b>	<b>106,04 %</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	4.405.934	4.846.536	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.593.853	2.661.106	102,59 %
			<b>6.999.787</b>	<b>7.507.642</b>	<b>107,26 %</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.884.007	2.945.851	102,14 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	488.471	512.992	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	221.068	243.350	110,08 %
			<b>3.593.546</b>	<b>3.702.193</b>	<b>103,02 %</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	10.079.488	10.291.360	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.232.876	3.301.726	102,13 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	1.089.221	1.111.382	102,03 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.386.962	2.440.609	102,25 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.071.791	2.272.716	109,70 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	919.135	941.749	102,46 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	905.812	940.680	103,85 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	695.413	730.293	105,02 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	652.114	665.159	102,00 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	455.311	464.482	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	424.663	445.981	105,02 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	408.068	416.818	102,14 %
Goldman Sachs & Company	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	196.684	280.179	142,45 %
			<b>23.517.538</b>	<b>24.303.134</b>	<b>103,34 %</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	6.010.532	6.866.877	114,25 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	5.597.278	6.082.701	108,67 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.665.810	2.799.923	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	2.439.775	2.683.822	110,00 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	56.337	62.015	110,08 %
			<b>16.769.732</b>	<b>18.495.338</b>	<b>110,29 %</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	292.837	322.352	110,08 %
			<b>292.837</b>	<b>322.352</b>	<b>110,08 %</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>			<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	165.980	169.468	102,10 %
			<b>165.980</b>	<b>169.468</b>	<b>102,10 %</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	23.258.138	23.911.718	102,81 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	9.275.601	9.470.576	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	8.218.722	8.548.268	104,01 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	19.770.754	21.739.880	109,96 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	13.716.231	13.992.499	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.328.459	2.561.092	109,99 %



## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY MELLON GLOBAL HORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	6.244.981	6.567.820	105,17 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.835.752	5.953.600	102,02 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.282.985	5.496.633	104,04 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	348.913	363.138	104,08 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.811.447	3.908.233	102,54 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.921.055	2.031.444	105,75 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	505.377	515.486	102,00 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	348.521	356.354	102,25 %
			<b>100.866.936</b>	<b>105.416.741</b>	<b>104,51 %</b>
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	637.901	669.524	104,96 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	101.704	106.783	104,99 %
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	431.728	474.902	110,00 %
			<b>1.171.333</b>	<b>1.251.209</b>	<b>106,82 %</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>			<b>JPY</b>	<b>JPY</b>	<b>%</b>
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	181.521.941	207.384.136	114,25 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	165.890.975	174.218.687	105,02 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	42.246.838	45.573.621	107,87 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	33.637.878	37.250.970	110,74 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	31.302.769	34.437.681	110,01 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	10.451.626	11.505.071	110,08 %
Macquarie Bank Limited	Australien	Aktienindizes (TriParty)	115.834	135.275	116,78 %
			<b>465.167.861</b>	<b>510.505.441</b>	<b>109,75 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	275.321	289.724	105,23 %
			<b>275.321</b>	<b>289.724</b>	<b>105,23 %</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	19.180.758	21.101.182	110,01 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	2.518.965	2.877.852	114,25 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.302.408	1.415.359	108,67 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.467.260	1.540.915	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	264.890	291.589	110,08 %
			<b>24.734.281</b>	<b>27.226.897</b>	<b>110,08 %</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	2.753.008	3.161.291	114,83 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	G10-Schuldtitel (TriParty)	829.319	872.981	105,26 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.307.353	2.498.570	108,29 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	218.051	228.988	105,02 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.152.562	1.252.517	108,67 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	29.267	33.437	114,25 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	1.157.691	1.274.375	110,08 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.062.033	1.177.771	110,90 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	183.226	192.443	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	870.702	957.798	110,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	566.851	632.832	111,64 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	513.095	566.078	110,33 %
			<b>11.643.158</b>	<b>12.849.081</b>	<b>110,36 %</b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	5.743.017	5.928.339	103,23 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	4.270.627	4.640.997	108,67 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	1.345.513	1.537.213	114,25 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	3.381.480	3.775.085	111,64 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	466.347	490.743	105,23 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	527.012	538.313	102,14 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	101.132	103.405	102,25 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Forts.</b>			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	9.938	10.147	102,10 %
			<b>15.845.066</b>	<b>17.024.242</b>	<b>107,44 %</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der Wert der entliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum Donnerstag, 31. Dezember 2020 wie folgt dar:

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verlie- henen Wert- papiere am 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>			EUR	EUR	%
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	15.624.834	17.187.478	110,00 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	745.048	760.017	102,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.556.308	2.693.126	105,35 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.192.308	2.274.901	103,77 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.581.251	1.725.732	109,14 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.319.321	1.372.572	104,04 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	603.992	616.718	102,11 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	571.977	600.699	105,02 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	805.323	848.675	105,38 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	319.306	325.898	102,06 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	210.444	223.366	106,14 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	185.498	195.957	105,64 %
			<b>26.715.610</b>	<b>28.825.139</b>	<b>107,90 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>			<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	3.559.891	3.628.293	101,92 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	160.720	176.904	110,07 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.403.900	1.474.211	105,01 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	62.856	66.301	105,48 %
			<b>5.187.367</b>	<b>5.345.709</b>	<b>103,05 %</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertibles Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.995.276	2.035.188	102,00 %
			<b>1.995.276</b>	<b>2.035.188</b>	<b>102,00 %</b>
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.735.568	1.789.343	103,10 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.478.452	1.556.859	105,30 %
			<b>3.214.020</b>	<b>3.346.202</b>	<b>104,11 %</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.194.856	2.241.016	102,10 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	295.724	316.075	106,88 %
			<b>2.490.580</b>	<b>2.557.091</b>	<b>102,67 %</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.964.031	5.460.531	110,00 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	982.469	1.002.436	102,03 %
ING Bank NV	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	727.576	801.818	110,20 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	483.377	532.050	110,07 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	431.506	461.202	106,88 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	360.180	367.755	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	217.000	228.295	105,21 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	64.497	66.495	103,10 %
			<b>8.230.636</b>	<b>8.920.582</b>	<b>108,38 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	205.119	209.433	102,10 %
			<b>205.119</b>	<b>209.433</b>	<b>102,10 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	104.544	106.742	102,10 %
			<b>104.544</b>	<b>106.742</b>	<b>102,10 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	6.888.205	7.033.072	102,10 %
Goldman Sachs & Company	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.872.670	3.952.166	102,05 %
			<b>10.760.875</b>	<b>10.985.238</b>	<b>102,08 %</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	9.971.457	10.190.468	102,20 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	4.233.894	4.322.937	102,10 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.016.015	2.059.957	102,18 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	469.248	480.813	102,46 %
			<b>16.690.614</b>	<b>17.054.175</b>	<b>102,18 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	2.465.442	2.590.824	105,09 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.439.348	2.619.535	107,39 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.542.287	4.769.510	105,00 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.447.970	4.904.164	110,26 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.920.121	4.121.215	105,13 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	512.113	523.361	102,20 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	2.962.046	3.110.414	105,01 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitle (TriParty)	1.841.688	1.933.791	105,00 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	843.634	891.200	105,64 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.434.557	2.561.851	105,23 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.527.215	1.620.991	106,14 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	866.642	1.012.911	116,88 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	295.172	319.765	108,33 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	836.746	854.344	102,10 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	434.718	463.560	106,63 %
			<b>30.369.699</b>	<b>32.297.436</b>	<b>106,35 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	618.977	682.461	110,26 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	457.104	480.059	105,02 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	316.793	332.829	105,06 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	213.319	217.806	102,10 %
			<b>1.606.193</b>	<b>1.713.155</b>	<b>106,66 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	665.963	699.321	105,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	245.436	265.885	108,33 %
			<b>911.399</b>	<b>965.206</b>	<b>105,90 %</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.792.727	1.882.557	105,01 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	718.209	754.127	105,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.013.833	1.064.249	104,97 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	448.759	458.615	102,20 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	609.989	640.503	105,00 %
			<b>4.583.517</b>	<b>4.800.051</b>	<b>104,72 %</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	23.380.734	23.975.089	102,54 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.197.198	2.241.286	102,01 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.577.965	5.689.776	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.498.449	1.561.204	104,19 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.908.957	6.028.727	102,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	5.018.776	5.119.721	102,01 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.706.246	3.780.748	102,01 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.318.028	2.555.770	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.219.092	1.268.373	104,04 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	650.557	676.972	104,06 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	304.833	356.283	116,88 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.739.702	1.826.899	105,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.475.473	1.554.901	105,38 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.106.408	1.161.969	105,02 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	969.650	990.043	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	413.510	434.722	105,13 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	313.541	319.841	102,01 %
			<b>57.799.119</b>	<b>59.542.324</b>	<b>103,02 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	239.256	244.296	102,11 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	217.097	227.975	105,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	202.063	210.231	104,04 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	183.951	193.140	105,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	176.138	179.661	102,00 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	106.584	108.727	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	106.435	108.633	102,06 %
			<b>1.231.524</b>	<b>1.272.663</b>	<b>103,34 %</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	41.264.903	45.391.626	110,00 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes	23.473.371	25.824.760	110,02 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.050.749	6.172.038	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	5.757.476	5.996.616	104,15 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	5.100.312	5.611.136	110,02 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.272.407	2.386.043	105,00 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	6.737.736	6.951.080	103,17 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Euroclear Triparty - Britische GILTS (set 11)	1.134.541	1.190.309	104,92 %
			<b>91.791.495</b>	<b>99.523.608</b>	<b>108,42 %</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	39.166.013	40.749.280	104,04 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.974.776	3.134.914	105,38 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes	769.176	846.227	110,02 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.723.244	4.105.109	110,26 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.793.316	1.831.031	102,10 %



## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.287.700	1.352.201	105,01 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	650.135	663.197	102,01 %
			<b>50.364.360</b>	<b>52.681.959</b>	<b>104,60 %</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	4.052.297	4.254.939	105,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	4.031.025	4.434.150	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	255.227	268.320	105,13 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes	20.180	22.202	110,02 %
			<b>8.358.729</b>	<b>8.979.611</b>	<b>107,43 %</b>
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	732.156	754.841	103,10 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	441.661	485.895	110,02 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	345.698	352.724	102,03 %
			<b>1.519.515</b>	<b>1.593.460</b>	<b>104,87 %</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	1.243.829	1.400.760	112,62 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	892.903	912.293	102,17 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	632.243	664.165	105,05 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	120.044	134.754	112,25 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	14.630	14.928	102,04 %
			<b>2.903.649</b>	<b>3.126.900</b>	<b>107,69 %</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.433.307	4.664.077	105,21 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	772.074	895.598	116,00 %
			<b>5.205.381</b>	<b>5.559.675</b>	<b>106,81 %</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.993.802	2.035.734	102,10 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.194.831	1.221.074	102,20 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	529.601	556.769	105,13 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.071.253	1.181.123	110,26 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	941.643	992.077	105,36 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	652.828	685.549	105,01 %
Morgan Stanley & Co. LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	237.268	244.136	102,89 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	131.680	139.766	106,14 %
			<b>6.752.906</b>	<b>7.056.228</b>	<b>104,49 %</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	9.553.228	10.515.181	110,07 %
			<b>9.553.228</b>	<b>10.515.181</b>	<b>110,07 %</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	8.750	9.822	112,25 %
			<b>8.750</b>	<b>9.822</b>	<b>112,25 %</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	7.307.190	8.476.272	116,00 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	988.041	1.112.700	112,62 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	282.406	311.564	110,33 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	9.167	10.291	112,26 %
			<b>8.586.804</b>	<b>9.910.827</b>	<b>115,42 %</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>			<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>%</b>
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	358.262	415.581	116,00 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	23.289	26.143	112,26 %
			<b>381.551</b>	<b>441.724</b>	<b>115,77 %</b>

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.420.231	1.594.258	112,25 %
			<b>1.420.231</b>	<b>1.594.258</b>	<b>112,25 %</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	10.804.701	11.673.906	108,04 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	9.730.616	9.992.218	102,69 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.614.377	3.808.946	105,38 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.505.630	1.581.650	105,05 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.001.992	3.508.659	116,88 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.920.817	1.998.465	104,04 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.425.540	1.454.115	102,00 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	665.265	679.282	102,11 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	599.486	611.530	102,01 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	430.919	452.476	105,00 %
			<b>33.699.343</b>	<b>35.761.247</b>	<b>106,12 %</b>
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	411.694	455.085	110,54 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	327.990	334.656	102,03 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	203.366	223.734	110,02 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	143.993	151.488	105,21 %
			<b>1.087.043</b>	<b>1.164.963</b>	<b>107,17 %</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>			<b>JPY</b>	<b>JPY</b>	<b>%</b>
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	406.278.481	449.098.123	110,54 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	19.589.229	20.574.591	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	7.188.716	7.910.056	110,03 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Forts.</b>			<b>JPY</b>	<b>JPY</b>	<b>%</b>
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	16.129.567	17.124.635	106,17 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	8.486.838	9.548.300	112,51 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	9.188.766	10.109.078	110,02 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	16.129.567	17.239.558	106,88 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Aktienindizes (TriParty)	681.276	769.456	112,94 %
			<b>483.672.440</b>	<b>532.373.797</b>	<b>110,07 %</b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	21.590.555	24.236.138	112,25 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	8.976.869	9.880.786	110,07 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	232.692	244.654	105,14 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	20.302	20.729	102,10 %
			<b>30.820.418</b>	<b>34.382.307</b>	<b>111,56 %</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	21.816.738	24.545.414	112,51 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	16.756.515	17.108.924	102,10 %
ING Bank NV	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	2.457.750	2.708.542	110,20 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.115.793	1.192.581	106,88 %
			<b>42.146.796</b>	<b>45.555.461</b>	<b>108,09 %</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	2.221.324	2.444.783	110,06 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	205.374	215.705	105,03 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.369.786	1.442.429	105,30 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	230.005	260.708	113,35 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.202.177	1.326.305	110,33 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	185.350	194.879	105,14 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	1.273.991	1.401.585	110,02 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	691.093	775.776	112,25 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	20.845	21.987	105,48 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	634.813	777.123	122,42 %

## 14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>%</b>
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	452.451	509.536	112,62 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	238.092	267.870	112,51 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	188.397	224.553	119,19 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	101.008	111.125	110,02 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	55.421	58.306	105,20 %
			<b>9.070.127</b>	<b>10.032.670</b>	<b>110,61 %</b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>%</b>
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	4.182.733	4.312.331	103,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.519.529	3.702.733	105,21 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	3.046.768	3.361.354	110,33 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	425.544	478.768	112,51 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	165.901	169.272	102,03 %
			<b>11.340.475</b>	<b>12.024.458</b>	<b>106,03 %</b>

## 15. NETTOINVENTARWERT

Der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse einlösbarer, partizipierender Anteile wird errechnet, indem das Nettovermögen der Anteilsklasse durch die Anzahl der einlösbaren, partizipierenden Anteile geteilt wird, die zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf sind.

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Der veröffentlichte Nettoinventarwert jeder Klasse einlösbarer, partizipierender Anteile beträgt wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>420.833.229</b>	<b>420.597.176</b>	<b>397.342.232</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse C	EUR	99,4418	99,9810	99,6501
	Klasse C (Inc)^	EUR	–	94,1383	94,9534
	Klasse D (Acc)	EUR	–	–	100,3946
	Klasse R	EUR	97,3616	98,2325	98,2485
	Klasse R (Hedged)	USD	107,0876	107,2566	105,9570
	Klasse R (Inc)	EUR	94,0972	95,0959	95,9159
	Klasse S	EUR	104,8799	105,2903	104,7596
	Klasse S (Inc)	EUR	–	–	95,5533
	Klasse T (Hedged)	CHF	93,8644	94,4961	94,4518
	Klasse T (Hedged)	USD	118,0047	117,6139	115,6893
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	112,1818	112,0080	111,0150
	Klasse W (Acc)	EUR	94,7722	95,3816	95,2036
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	103,5767	103,4283	101,7687
	Klasse W (Inc) (Hedged)	USD	–	–	99,7297
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100,4564	100,5486	99,9024
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	96,0752	96,4175	96,8591
	Klasse X	EUR	112,3488	112,1810	111,0339
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	–	–	105,1359
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	119,8551	119,0334	117,3278
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>GBP</b>	<b>123.705.871</b>	<b>241.339.578</b>	<b>371.503.339</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	0,9387	0,9205	0,9195
	Klasse R (Hedged)	CHF	0,8867	0,8758	0,8828
	Klasse R (Hedged)	EUR	1,0555	1,0402	1,0442
	Klasse R (Hedged)	USD	1,0745	1,0506	1,0406
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	0,9199	0,9066	0,9101
	Sterling R (Acc)	GBP	1,1419	1,1177	1,1129
	Sterling S (Acc)	GBP	1,2044	1,1730	1,1621
	Klasse T (Hedged)	EUR	1,1119	1,0903	1,0892
	Klasse T (Hedged)	USD	1,1187	1,0907	1,0739
	Klasse U (Hedged)	EUR	0,9916	0,9709	0,9684
	Klasse U (Hedged)	USD	1,1077	1,0786	1,0614
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	0,9601	0,9400	0,9186
	Sterling U (Acc)	GBP	1,2177	1,1842	1,1714
	Sterling X (Acc)	GBP	1,3874	1,3369	1,3103

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>95.148.164</b>	<b>33.223.020</b>	<b>28.390.201</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse F (Acc)	EUR	1,0308	1,0218	–
	Klasse F (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0102	–	–
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	1,1225	1,1040	1,0097
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	1,1083	1,0923	1,0038
	Klasse R (Acc)^	EUR	1,0071	–	–
	Klasse U (Acc)	EUR	1,1024	1,0925	1,0142
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0078	–	–
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	1,1074	1,0911	–
	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0046	–	1,0208
	Klasse X (Acc)	EUR	1,1442	1,1231	1,0213
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0019	–	–
<b>BNY Mellon Asia Rising Stars Fund**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>8.283.563</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	–	–	1,2700
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	–	–	1,2346
	Klasse W (Acc)	USD	–	–	1,2997
	Klasse X (Acc)	USD	–	–	1,0953
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>58.824.565</b>	<b>66.360.687</b>	<b>38.173.739</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	5,1788	5,7230	3,6442
	Klasse A	EUR	4,0312	4,1082	2,8596
	Klasse B	USD	5,6561	6,2193	3,9405
	Klasse B	EUR	2,1310	2,1609	1,4966
	Klasse C	USD	6,4812	7,0910	4,4703
	Klasse C	EUR	4,2687	4,3069	2,9682
	Sterling C (Inc)	GBP	4,2823	4,6261	3,0133
	Klasse W	USD	1,8220	1,9885	1,2505
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>14.979.746</b>	<b>36.440.997</b>	<b>31.031.538</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,5058	1,3413	1,3783
	Klasse A (Inc)^	USD	0,9637	–	–
	Klasse A (Inc)	EUR	1,1907	1,0963	1,1674
	Klasse B (Acc)	USD	1,2888	1,2390	1,1590
	Klasse C (Acc)	USD	1,3974	1,3367	1,2440
	Klasse W (Acc)^	EUR	1,0801	–	–
	Klasse W (Inc)	EUR	1,3241	1,2041	1,2661
	Klasse W (Inc)	USD	1,0915	1,0761	1,0352
	Sterling W (Inc)	GBP	1,3676	1,3314	1,3233

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>95.125.353</b>	<b>15.864.824</b>	<b>11.112.189</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,7039	1,5763	1,0907
	Klasse A (Acc)^	EUR	0,8290	–	–
	Klasse B (Acc)^	USD	0,9389	–	–
	Klasse B (Inc)^	SGD	0,9412	–	–
	Klasse C (Acc)^	USD	1,0015	–	–
	Klasse E (Acc)	USD	1,7913	1,6349	1,1161
	Klasse E (Acc)	EUR	1,7848	1,5181	1,1287
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9637	–	–
	Klasse E (Inc)	USD	–	–	1,0566
	Klasse G (Acc)	USD	1,3680	1,2536	–
	Klasse G (Acc)^	EUR	1,0042	–	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	0,8894	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,6116	1,5088	1,0686
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9957	–	–
	Klasse K (Acc)	USD	1,7460	1,6080	1,1076
	Klasse K (Acc)	EUR	1,7399	1,4933	1,1203
	Klasse W (Acc)	USD	1,7812	1,6289	1,1142
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9984	–	–
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>42.616.239</b>	<b>70.198.270</b>	<b>105.594.026</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	0,9326	1,0597	1,3152
	Klasse A	EUR	1,1441	1,1974	1,6321
	Klasse B	USD	0,8054	0,9107	1,1248
	Klasse B	EUR	1,0070	1,0486	1,4216
	Sterling B (Acc)	GBP	0,8891	0,9966	1,2788
	Klasse C	USD	1,0753	1,2096	1,4872
	Klasse C	EUR	1,3220	1,3697	1,8476
	Sterling C (Inc)	GBP	1,0464	1,1714	1,5174
	Klasse G (Acc)	USD	–	–	1,2899
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9304	0,9640	1,3014
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	1,2167
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,7899	0,9092	1,1666
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,7683	0,8756	1,1116
	Klasse W (Acc)	USD	0,9372	1,0517	1,2895
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0821	1,1184	1,5059
	Sterling W (Acc)	GBP	1,1199	1,2458	1,5866



## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>24.751.005</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	0,9885	–	–
	Klasse C (Acc)^	USD	0,9898	–	–
	Klasse E (Acc)^	USD	0,9904	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9891	–	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9896	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	0,9900	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9888	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9893	–	–
	Klasse X (Acc)^	USD	0,9907	–	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9895	–	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9900	–	–
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>–</b>	<b>16.366.070</b>	<b>26.474.856</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	–	1,0238	1,0261
	Klasse C (Acc)^	USD	–	1,0833	1,0748
	Klasse E (Acc)^	USD	–	1,0872	1,0732
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,9305	0,9481
	Klasse W (Acc)^	USD	–	1,0977	1,0865
	Klasse X (Acc)^	USD	–	1,1489	1,1279
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>645.924.114</b>	<b>536.212.842</b>	<b>181.632.588</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,1191	1,0962	1,0095
	Klasse A (Inc)	USD	1,9816	1,5338	1,3057
	Klasse C (Acc)	USD	2,0205	1,5572	1,3172
	Klasse E (Acc)	USD	–	–	1,3273
	Klasse G (Acc)	USD	1,5627	1,2045	1,0188
	Klasse G (Acc)	EUR	1,5263	1,0964	1,0096
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,4319	1,1154	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,6630	1,2975	1,1249
	Klasse W (Acc)	USD	2,0359	1,5660	1,3220
	Klasse W (Acc)	EUR	1,8063	1,2948	1,1905
	Klasse W (Inc)	EUR	1,4741	1,0623	–
	Sterling W (Acc)^	GBP	1,0756	–	1,3060
	Klasse X (Acc)	USD	2,0752	1,5893	1,3357

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>191.298.660</b>	<b>26.335.612</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0806	1,0498	–
	Klasse A (Inc)	USD	1,0315	1,0479	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,0820	1,0501	–
	Klasse C (Inc)	USD	1,0327	1,0483	–
	Klasse E (Acc)	USD	1,0848	1,0507	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0719	1,0471	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0804	1,0488	–
	Klasse E (Inc)	USD	1,0354	1,0488	–
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	1,0225	1,0453	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1,0316	1,0470	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0672	1,0462	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,0186	1,0444	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,0834	1,0504	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	10,6971	10,4666	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0700	1,0468	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	10,7907	10,4793	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	10,7387	10,4696	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0790	1,0485	–
	Klasse W (Inc)	USD	1,0341	1,0485	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1,0211	1,0450	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1,0303	1,0467	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,0867	1,0511	–
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>20.691.305</b>	<b>44.168.089</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0507	1,0608	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	1,0441	1,0526	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,0543	1,0621	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0315	1,0488	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,0512	–
	Klasse X (Acc)^	USD	–	1,0137	–

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>1.921.308.172</b>	<b>1.203.350.910</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1395	1,0849	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,1417	1,0853	–
	Klasse C (Inc)^	USD	1,0187	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0424	–	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0400	–	–
	Klasse N (Acc)^	USD	1,0068	–	–
	Klasse N (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0033	–	–
	Klasse N (Inc) (M)^	USD	0,9956	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,1439	1,0858	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0413	–	–
	Klasse W (Inc)^	USD	1,0264	–	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1,0830	1,0817	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,1488	1,0868	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,1434	1,0846	–
	Klasse X (Inc)	USD	1,1008	1,0863	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	1,0072	1,0840	–
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>726.611.703</b>	<b>770.676.813</b>	<b>716.491.768</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Inc)	USD	0,9625	0,9716	0,9923
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9988	0,9396	1,0451
	Klasse C (Acc)	USD	1,2401	1,1813	1,1279
	Klasse C (Inc)^	USD	–	1,1172	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,1418	1,0946	1,0638
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,1828	1,1267	1,0927
	Sterling E (Inc) (Hedged)^	GBP	–	0,9812	1,0276
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,1134	1,0701	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0927	1,0510	1,0327
	Klasse K (Acc)	USD	1,2108	1,1532	1,1013
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	1,1293	1,0851	1,0565
	Klasse L (Acc)	USD	1,2184	1,1584	1,1042
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	1,1360	1,0895	1,0587
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	1,1033	1,0517	1,0197
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,9558	0,9643	0,9995
	Klasse W (Acc)	USD	1,2448	1,1843	1,1298
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,0606	1,0291
	Klasse W (Inc)	USD	1,0726	1,0806	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8855	0,9001	0,9355
	Sterling W (Inc) (hedged)	GBP	1,0672	1,0775	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,0172	1,1897	1,1323
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,1673	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0086	–	–
	Klasse X (Inc)^	USD	–	1,1420	–

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>554.266.191</b>	<b>392.457.935</b>	<b>360.120.657</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	148,8118	152,7282	142,4403
	Klasse A	EUR	167,0360	158,0924	161,1662
	Klasse A (Inc)^	USD	–	110,4029	–
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	1.032,1792	1.083,0567	–
	Klasse B	USD	164,9561	168,8745	157,0770
	Klasse C	USD	170,0873	173,4325	160,7062
	Klasse C	EUR	189,8492	178,4712	180,9051
	Klasse G (Inc)	USD	99,8756	105,5549	102,4094
	Klasse H (Hedged)	EUR	132,9036	137,5639	130,9446
	Klasse I (Hedged)	EUR	140,4363	144,4120	136,5029
	Klasse W	USD	173,3326	176,3701	163,1225
	Klasse W	EUR	202,8604	190,3746	192,4222
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	112,3116	115,5095	109,3395
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	108,2557	111,0868	104,7770
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	99,0615	105,8527	105,1012
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	92,2053	98,2949	97,2623
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	156,0680	159,1680	149,8278
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	103,2061
	Klasse X	USD	191,2988	193,3003	177,5334
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	118,6679	110,9318
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>33.134.900</b>	<b>39.274.388</b>	<b>52.672.790</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,4303	2,4936	2,3965
	Klasse A	EUR	2,1347	2,0411	2,1365
	Klasse C	USD	2,6399	2,6951	2,5787
	Klasse C	EUR	2,3139	2,2015	2,2929
	Klasse C (Inc)	USD	0,8047	0,8531	0,8483
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1753	1,2169	1,1938
	Klasse W	USD	1,3378	1,3624	1,2998
	Klasse X (Inc)	USD	1,0020	1,0624	1,0569

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>113.559.730</b>	<b>164.668.641</b>	<b>464.566.692</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,0262	1,1322	1,1309
	Klasse A	EUR	1,1221	1,1537	1,2551
	Klasse A (Inc)	USD	0,4827	0,5573	0,5824
	Klasse A (Inc)	EUR	0,6896	0,7420	0,8446
	Sterling A (Acc)	GBP	0,9902	1,0813	1,1152
	Sterling B (Acc)	GBP	1,0276	1,1199	1,1521
	Klasse C	USD	1,3751	1,5096	1,5015
	Klasse C	EUR	1,2097	1,2376	1,3397
	Klasse C (Inc)	USD	0,5179	0,5980	0,6252
	Klasse C (Inc)	EUR	0,6487	0,6980	0,7946
	Sterling C (Acc)	GBP	1,5068	1,6378	1,6807
	Sterling C (Inc)	GBP	0,7591	0,8675	0,9362
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,8395	0,9363	0,9567
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,8606	0,9552	0,9709
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,4342	0,5036	0,5360
	Klasse W	USD	0,8298	0,9076	0,8990
	Klasse W	EUR	0,9420	0,9603	1,0359
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,7627	0,8433	0,8540
	Klasse W (Inc)	EUR	0,5684	0,6116	0,6964
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,6570	0,7674	0,8229
	Sterling W (Inc)	GBP	0,5926	0,6773	0,7311
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,4854	0,5631	0,5997
	Klasse X	USD	–	–	1,7284
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>27.883.288</b>	<b>28.263.991</b>	<b>29.585.251</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,2650	1,2572	1,3204
	Klasse C	USD	1,1138	1,1819	1,1341
	Klasse W (Acc)	USD	1,0609	1,1217	1,0727
	Klasse X (Inc)	USD	0,9274	1,0281	1,0323
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>125.677.325</b>	<b>165.595.940</b>	<b>151.635.419</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0075	1,0989	1,0325
	Klasse E (Inc)	USD	–	–	0,9452
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,8887	1,0255	1,0349
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9663	1,0647	1,0225
	Klasse W (Acc)	USD	1,0262	1,1142	1,0423
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9327	1,0226	0,9778
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9451	1,0295	0,9813
	Klasse X (Acc)	USD	1,0508	1,1344	1,0553

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>275.922.173</b>	<b>442.908.116</b>	<b>890.225.293</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,9885	2,0677	1,9753
	Klasse A (Inc)	EUR	1,2026	1,2534	1,2057
	Klasse B	EUR	1,4026	1,4550	1,3866
	Klasse B (Inc)	EUR	1,2096	1,2606	1,2126
	Klasse C	EUR	2,1781	2,2535	2,1420
	Klasse C (Inc)	EUR	1,3140	1,3693	1,3172
	Klasse G (Acc)	EUR	1,0600	1,0968	1,0428
	Klasse H (Hedged)	CHF	1,2629	1,3170	1,2627
	Klasse I (Hedged)	CHF	1,3490	1,3998	1,3354
	Klasse S	EUR	1,2188	1,2599	1,1964
	Klasse W (Acc)	EUR	1,1034	1,1410	1,0840
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>40.738.209</b>	<b>40.498.739</b>	<b>82.434.065</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	125,9258	126,7630	123,8809
	Klasse C	EUR	131,6104	131,8246	128,1852
	Klasse W (Acc)	EUR	109,3006	109,3689	106,2977
	Klasse X	EUR	138,1121	137,5919	133,0672
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>2.164.937</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	1,0853	–	–
	Klasse B (Acc)^	USD	1,0900	–	–
	Klasse C (Acc)^	USD	1,0953	–	–
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,1994	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0732	–	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0832	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,0975	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0853	–	–
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>2.766.825</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,2030	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,1111	–	–
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>2.351.576</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,2831	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,1722	–	–

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>434.682.361</b>	<b>614.883.298</b>	<b>585.157.899</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,3579	2,5588	2,3299
	Klasse A	EUR	1,8584	1,8599	1,8513
	Klasse B	USD	2,4208	2,6233	2,3850
	Klasse C	USD	2,5813	2,7872	2,5251
	Klasse C	EUR	2,0471	2,0384	2,0189
	Klasse C (Inc)	USD	0,9813	1,0657	0,9738
	Sterling C (Inc)	GBP	1,4532	1,5595	1,4735
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,2109	1,3274	1,2316
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,2892	1,4063	1,2981
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	0,9330	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,1011	1,1878	1,0751
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0196	1,1005	1,0889
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	0,9887
	Klasse X	USD	2,7510	2,9542	2,6617
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1,0071	1,0891	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9953	1,0852	–
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>442.961.954</b>	<b>803.381.804</b>	<b>462.784.533</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0380	1,0487	–
	Klasse A (Inc) (Q)^	USD	–	1,0415	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1815	1,2044	1,0985
	Klasse W (Acc)	USD	1,3782	1,3844	1,2310
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	1,0421	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,2914	1,2999	1,1740
	Klasse X (Acc)	USD	1,3996	1,3991	1,2385
	Klasse X (Acc)^	JPY	103,6889	–	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,3715	1,3727	1,2239
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	JPY	99,1545	–	–

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>432.993.493</b>	<b>498.134.113</b>	<b>496.274.784</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,2881	1,3073	1,2631
	Klasse A	EUR	1,3242	1,2393	1,3090
	Klasse A (Inc)	USD	1,0732	1,0968	1,0664
	Klasse C	USD	1,3850	1,3984	1,3445
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1554	1,0759	1,1308
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,0271	1,0512	1,0312
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10,3633	10,1020
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,9274	0,9560	0,9437
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0769	1,0968	1,0715
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	SGD	1,0000	–	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,9283	0,9569	0,9461
	Klasse W	USD	1,1950	1,2035	1,1542
	Klasse W (Hedged)	EUR	1,0633	1,0800	1,0514
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	1,0442	1,0201
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10,4829	10,1423
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,9654	0,9951	0,9823
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1334	1,1441	1,1076
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	1,0179	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	102,8088	103,4345	99,9375
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	99,1286	101,7894	–
	Klasse Z (Acc)^	USD	–	1,0017	–
	Klasse Z (Inc)^	USD	–	1,0017	–
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,9917	0,9849	0,9745
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,9630	0,9718	0,9745
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1,0191	1,0270	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9940	1,0182	–



## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>53.039.682</b>	<b>54.195.828</b>	<b>33.193.624</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,4299	1,5287	0,9898
	Klasse A	EUR	1,7384	1,7136	1,2113
	Klasse A (Inc)	EUR	1,5395	1,5175	1,0726
	Klasse B (Acc)^	USD	–	1,8762	–
	Klasse B (Acc)^	EUR	–	1,6827	–
	Klasse B (Inc)	USD	1,4397	1,5313	0,9850
	Klasse B (Inc)	EUR	1,6172	1,5861	1,1155
	Klasse C	USD	1,7221	1,8224	1,1667
	Klasse C (Acc)	USD	1,8993	2,0099	1,2867
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	1,6891	–
	Klasse C (Inc)	USD	1,5052	1,5929	1,0193
	Sterling C (Inc)^	GBP	–	1,6859	–
	Klasse E (Acc)	USD	1,9021	2,0024	1,2767
	Klasse E (Acc)	CHF	1,6632	1,6893	1,1810
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	0,8871
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,2765	1,3794	0,9104
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,3978	1,4956	0,9771
	Klasse W (Acc)	USD	2,2167	2,3400	1,4996
	Klasse W (Acc)	EUR	1,5235	1,4830	1,0353
	Klasse W (Inc)	USD	1,5257	1,6105	1,0293
	Klasse W (Inc)	EUR	1,6836	1,6389	1,1448
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>505.772.156</b>	<b>439.208.591</b>	<b>371.812.812</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	3,5434	3,0414	2,6195
	Klasse A	EUR	2,8236	2,2352	2,1046
	Klasse B	USD	3,8553	3,2929	2,8220
	Klasse B	EUR	3,3752	2,6586	2,4906
	Klasse C	USD	4,2305	3,5947	3,0650
	Klasse C	EUR	–	–	2,4330
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,9105	1,6416	1,4290
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	1,1335	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,9167	1,6249	1,3821
	Klasse W (Acc)	EUR	1,9032	1,4886	1,3841

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>411.101.299</b>	<b>769.230.682</b>	<b>1.842.135.041</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,1617	1,9119	1,8451
	Klasse A	EUR	2,8359	2,3131	2,4403
	Klasse A (Inc)	USD	1,5387	1,3964	1,3859
	Klasse A (Inc)	EUR	1,3903	1,1635	1,2619
	Sterling A (Acc)	GBP	1,9185	1,6755	1,6706
	Klasse B	USD	2,6559	2,3373	2,2446
	Klasse B	EUR	2,8269	2,2942	2,4084
	Klasse B (Inc)	USD	1,8857	1,7027	1,6814
	Klasse B (Inc)	EUR	2,1619	1,8002	1,9434
	Sterling B (Inc)	GBP	2,1891	1,9518	1,9914
	Klasse C	USD	2,5238	2,2098	2,1114
	Klasse C	EUR	3,0880	2,4937	2,6047
	Klasse C (Inc)	USD	1,9854	1,7838	1,7527
	Klasse C (Inc)	EUR	2,1683	1,7965	1,9295
	Sterling C (Inc)	GBP	2,3004	2,0408	2,0718
	Klasse G (Acc)	EUR	1,4076	1,1367	1,1873
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,6471	1,4722	1,4511
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,2693	1,1644	1,1799
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,8024	1,5950	1,5564
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	–	–	1,2523
	Klasse W	USD	2,2310	1,9477	1,8558
	Klasse W	EUR	2,5763	2,0753	2,1617
	Klasse W (Acc)	CHF	–	–	1,0487
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,2869	1,1366	1,1066
	Klasse W (Inc)	USD	1,6937	1,5179	1,4876
	Klasse W (Inc)	EUR	1,9637	1,6221	1,7381
	Sterling W (Acc)	GBP	2,6653	2,2988	2,2637
	Sterling W (Inc)	GBP	2,0252	1,7921	1,8148
	Klasse Z (Acc)	USD	1,8725	1,6339	1,5555
	Klasse Z (Acc)	EUR	2,0628	1,6599	1,7277
	Klasse Z (Inc)	USD	1,3290	1,1898	1,1650
	Klasse Z (Inc)	EUR	1,3390	1,1055	1,1832
	Sterling Z (Acc)^	GBP	–	1,0379	1,0210
	Sterling Z (Inc)	GBP	1,2632	1,1167	1,1297
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>166.693.695</b>	<b>153.424.293</b>	<b>121.548.316</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	2,7968	2,4840	2,6193
	Klasse C	USD	1,5163	1,4567	1,4011
	Klasse C	EUR	2,9209	2,5877	2,7224
	Klasse C (Inc)	USD	0,9611	0,9706	0,9888
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,3164	1,2787	1,2556
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,3529	1,3109	1,2841
	Klasse W (Acc)	USD	1,2255	1,1715	1,1212
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0149
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1107	1,0641	1,0347
	Klasse X (Inc)	USD	1,0103	1,0094	1,0176
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,9069	0,9143	0,9386

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>227.707.584</b>	<b>146.439.027</b>	<b>91.053.076</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0657	0,9355	1,0949
	Klasse A (Inc)	USD	0,9299	0,8534	1,0438
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9311	0,7964	1,0608
	Klasse B (Acc)	SGD	1,2991	1,1133	–
	Klasse B (Acc)	USD	1,0816	0,9451	1,1012
	Klasse B (Inc)	USD	0,9440	0,8625	1,0502
	Klasse B (Inc)	SGD	1,2135	1,0872	–
	Klasse B (Inc) (M)^	USD	1,0890	–	–
	Klasse B (Inc) (M)^	SGD	1,1326	–	–
	Klasse E (Acc)	USD	–	–	1,1281
	Klasse E (Inc)	USD	0,9764	0,8835	1,0651
	Klasse E (Inc)	EUR	0,9781	0,8244	1,0823
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,9130	0,8303	1,0377
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9807	0,8699	1,0494
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8551	0,7934	1,0006
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,3614	1,1915	–
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	1,2715	1,1635	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,1084	0,9616	1,1124
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0207	0,8949	1,0666
	Klasse W (Inc)	USD	0,9674	0,8775	1,0608
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8919	0,8179	1,0169
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>65.357.060</b>	<b>39.090.903</b>	<b>86.118.374</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	2,1514	1,8243	1,4853
	Klasse A (Acc)	EUR	1,7810	1,4075	1,2479
	Klasse A (Inc)^	EUR	–	1,4075	1,2479
	Klasse B (Acc)	USD	1,6658	1,4055	1,1386
	Klasse C (Acc)	USD	2,2636	1,9003	1,5318
	Klasse E (Acc)	USD	2,0290	1,6949	1,3594
	Klasse E (Acc)	EUR	1,4415	1,1221	–
	Sterling E (Acc)	GBP	2,1659	1,7907	1,4829
	Klasse H (Acc) (Hedged)	DKK	15,1216	12,9634	10,8284
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,9141	1,6408	1,3678
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	15,0354	12,8721	10,9288
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	15,0543	12,9082	10,8404
	Klasse W (Acc)	USD	2,2928	1,9199	1,5438
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	16,4629	13,9381	11,4980
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	15,5284	13,1283	11,0081
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	15,5378	13,1574	10,9126
	Sterling W (Acc)	GBP	2,1385	1,7725	1,4714

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>–</b>	<b>20.744.725</b>	<b>23.691.394</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	1,0933	1,0856
	Klasse A (Inc)^	EUR	–	1,0024	1,0368
	Klasse A (Inc)^	USD	–	1,2234	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	1,0870	1,0739
	Klasse E (Inc)^	EUR	–	1,0341	1,0562
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	1,1190	1,1027
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	–	1,0482
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>37.198.450</b>	<b>35.977.689</b>	<b>48.327.216</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	4,2183	3,5794	3,2022
	Klasse A	EUR	3,3366	2,6109	2,5521
	Klasse B	USD	4,6003	3,8841	3,4560
	Klasse C	USD	4,9678	4,1735	3,6943
	Klasse C	EUR	3,9193	3,0365	2,9379
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,9813	1,6999	1,5498
	Klasse I (Hedged)	EUR	2,1481	1,8247	1,6468
	Klasse W (Acc)	USD	1,6705	1,4002	1,2362
	Klasse W (Acc)	EUR	–	–	1,1667
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>3.121.728.759</b>	<b>2.926.880.946</b>	<b>3.409.751.582</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,5477	1,4507	1,3636
	Klasse A (Inc)	EUR	1,2551	1,1807	1,1181
	Klasse C	EUR	1,6420	1,5316	1,4323
	Klasse C (Inc)	EUR	1,3244	1,2456	1,1792
	Klasse G (Acc)	EUR	1,2610	1,1762	1,1001
	Klasse G (Inc)	EUR	1,2184	1,1458	1,0848
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,1938	1,1107	1,0351
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	1,1876	1,1037	1,0233
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1,1639	1,0858	1,0196
	Klasse W	EUR	1,5063	1,4014	1,3076
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,2141	1,1325	1,0609
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	–	–	1,0212
	Klasse W (Inc)	EUR	1,1620	1,0926	1,0247
	Klasse X	EUR	1,6892	1,5594	1,4433
	Klasse Z (Acc)	EUR	1,2675	1,1781	1,0980
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>GBP</b>	<b>65.897.045</b>	<b>62.762.505</b>	<b>70.966.738</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Sterling B (Acc)	GBP	1,3974	1,3192	1,2467
	Sterling B (Inc)	GBP	1,2987	1,2283	1,1680
	Sterling C (Inc)	GBP	1,3256	1,2531	1,1916
	Sterling W (Acc)	GBP	1,4577	1,3659	1,2818
	Sterling W (Inc)	GBP	1,3031	1,2314	1,1711
	Sterling X (Acc)	GBP	1,4953	1,3895	1,2928

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>437.609.335</b>	<b>300.822.877</b>	<b>322.386.292</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,7533	1,6528	1,5262
	Klasse C	USD	1,8660	1,7503	1,6081
	Klasse C (Inc)	USD	1,4416	1,3639	1,2722
	Klasse G (Acc)	USD	1,3531	1,2691	1,1659
	Klasse W	USD	1,5326	1,4339	1,3142
	Klasse W (Inc)	USD	1,3483	1,2760	1,1892
	Klasse X	USD	2,1261	1,9733	1,7941
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>792.573.372</b>	<b>701.716.479</b>	<b>725.167.880</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1990	1,1502	1,1434
	Klasse A (Inc)	USD	0,9727	0,9685	1,0033
	Klasse C (Acc)	USD	1,2296	1,1736	1,1613
	Klasse G (Acc)	USD	1,1031	1,0529	1,0418
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0804	1,0451	1,0579
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8824	0,8859	0,9344
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	1,1075	1,0658	1,0732
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,8827	0,8862	0,9355
	Klasse W (Acc)	USD	1,2452	1,1856	1,1702
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0815	1,0402	1,0487
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0989	1,0548	1,0600
	Klasse W (Inc)	USD	0,9770	0,9727	1,0078
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8839	0,8875	0,9361
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1699	1,1164	1,1174
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9300	0,9276	0,9749
	Klasse X (Acc)	USD	1,2805	1,2125	1,1902
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,1145	1,0574	1,0524
	Klasse Y (Acc)	USD	1,2813	1,2130	1,1907
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	1,2032	1,1414	1,1365
	Klasse Z (Acc)^	USD	1,0417	–	–
	Klasse Z (Inc)^	USD	1,0118	–	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1,0811	1,0304	1,0302
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9554	0,9529	1,0014
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>32.551.101</b>	<b>29.990.159</b>	<b>25.173.039</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse W (Acc)	USD	1,4588	1,3478	1,1515
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,4548	1,3399	1,1502

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>JPY</b>	<b>21.102.568.351</b>	<b>15.317.409.324</b>	<b>15.534.711.210</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,3006	1,2114	1,0989
	Klasse C	JPY	271,9886	243,5126	211,0813
	Klasse C^	USD	1,0105	–	–
	Klasse E (Acc)	EUR	–	–	1,1275
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,3082	1,1775	1,0297
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,4094	1,2554	1,0802
	Klasse G (Acc)^	EUR	–	1,1785	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,1741	1,0599	0,9289
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,9785	1,7902	1,5727
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	14,4586	13,1526	11,7303
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	14,3794	13,0993	11,6353
	Klasse H (Hedged)	EUR	2,3468	2,1399	1,8939
	Klasse H (Hedged)	USD	2,6434	2,3889	2,0855
	Klasse I (Hedged)	EUR	2,5782	2,3278	2,0399
	Klasse I (Hedged)	USD	2,8475	2,5489	2,2033
	Klasse W	JPY	277,7341	248,0364	214,4722
	Klasse W (Acc)	EUR	1,2366	1,1378	1,0192
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,2478	1,1236	0,9821
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	14,7049	13,2103	11,6384
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	14,6493	13,1792	11,5413
	Sterling W (Acc)	GBP	2,9885	2,9525	2,5019
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1682	1,1606	0,9904

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>1.600.784.047</b>	<b>1.571.112.825</b>	<b>1.485.354.765</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	3,8035	3,0344	2,8565
	Klasse A	USD	2,7292	2,3363	2,0194
	Klasse A (Inc)	EUR	2,4411	1,9475	1,8335
	Sterling A (Acc)	GBP	3,7502	3,1776	2,8354
	Klasse B	EUR	3,5968	2,8552	2,6741
	Klasse B	USD	2,8927	2,4640	2,1190
	Klasse B (Acc)	SGD	1,6580	1,3851	1,2122
	Klasse B (Inc)	SGD	–	–	1,2122
	Sterling B (Inc)	GBP	3,2384	2,7303	2,4246
	Klasse C	EUR	4,3601	3,4438	3,2106
	Klasse C	USD	3,1313	2,6535	2,2707
	Klasse G (Acc)	EUR	1,5947	1,2596	1,1747
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	–	1,1535	1,0709
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	USD	–	1,1826	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	JPY	107,1911	–	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,7471	1,3784	1,2839
	Klasse S	EUR	4,4543	3,5007	3,2559
	Klasse S (Acc) 1	USD	1,5682	1,3225	1,1297
	Klasse W	EUR	3,2180	2,5354	2,3573
	Klasse W	USD	2,8244	2,3879	2,0384
	Klasse W (Hedged)	USD	3,3500	2,6227	2,4048
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	1,5824	1,2390	1,1452
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	1,1300	–
	Klasse W (Inc)	USD	2,6723	2,2681	1,9465
	Sterling W (Acc)	GBP	3,3500	2,8033	2,4706
	Sterling W (Inc)	GBP	3,1691	2,6620	2,3589
	Klasse X (Acc)^	USD	–	1,4517	1,2295
	Sterling X	GBP	3,0239	2,5108	2,1954

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>993.610.089</b>	<b>474.197.314</b>	<b>154.707.836</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,7836	1,5100	1,0113
	Klasse A (Acc)	EUR	1,9841	1,5654	1,1418
	Klasse A (Inc)	USD	1,7832	1,5097	1,0111
	Klasse A (Inc)	EUR	1,8270	1,4415	1,0514
	Klasse B (Acc)	USD	1,8111	1,5265	1,0177
	Klasse B (Acc)^	SGD	1,0734	–	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,8667	1,5655	1,0385
	Klasse C (Acc)	EUR	1,8133	1,4172	1,0240
	Klasse C (Inc)	EUR	1,8836	1,4722	1,0655
	Klasse E (Acc)	USD	1,8741	1,5638	1,0323
	Klasse E (Acc)	CHF	1,9835	1,6081	1,1604
	Klasse E (Acc)	EUR	1,9195	1,4927	1,0731
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	2,0412	1,7264	1,1688
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	2,0257	1,7105	1,1588
	Klasse E (Acc) (Hedged)	SGD	–	–	1,1877
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,7531	1,4732	1,0011
	Klasse G (Acc)	USD	1,5287	1,2819	–
	Klasse G (Acc)	CHF	1,5340	1,2499	–
	Klasse G (Acc)	EUR	1,6923	1,3230	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,5026	1,2756	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0839	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,6405	1,4056	0,9659
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,6391	1,4044	0,9654
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	1,9610	1,6727	1,1445
	Klasse K (Acc)	USD	2,1133	1,7812	1,1876
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	1,9568	1,6716	1,1431
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	1,9629	1,6743	1,1456
	Klasse K (Acc) (Hedged)^	SGD	1,0541	–	–
	Klasse K (Inc)	USD	2,1134	1,7813	1,1876
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	1,9549	1,6702	1,1421
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	1,9606	1,6723	1,1442
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	2,0521	1,7361	1,1743
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	1,9893	1,6885	1,1591
	Klasse W (Acc)	USD	1,8548	1,5524	1,0278
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,3528	1,1475	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,7062	1,4452	0,9817
	Sterling W (Acc)^	GBP	1,0527	–	–
	Klasse W (Inc)	USD	1,8471	1,5460	1,0269
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1,6939	1,4347	0,9797
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>–</b>	<b>36.865.576</b>	<b>50.804.733</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A^	USD	–	3,4193	2,9378
	Klasse A ^	EUR	–	2,7978	2,6179
	Klasse C^	USD	–	3,9141	3,3395
	Klasse C ^	EUR	–	3,0387	2,8231
	Klasse G (Acc)	EUR	–	–	1,1090



## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>81.192.875</b>	<b>60.661.744</b>	<b>74.850.283</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	7,0496	5,8158	5,6223
	Klasse A	USD	1,7092	1,5291	1,3523
	Klasse B	EUR	3,6036	2,9581	2,8456
	Klasse C	EUR	8,3551	6,8243	6,5314
	Klasse C	USD	1,9065	1,6886	1,4785
	Klasse W (Acc)	EUR	1,3659	1,1129	1,0625
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	1,9206	1,7332
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>4.976.550</b>	<b>5.003.928</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9887	0,9988	–
	Klasse B (Acc)	USD	0,9934	0,9990	–
	Klasse B (Acc)	SGD	1,0028	0,9892	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,9986	0,9993	–
	Klasse E (Acc)	USD	1,0038	0,9995	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,9886	0,9741	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,9991	0,9992	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9766	0,9983	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,9864	0,9987	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,9905	0,9991	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,0008	0,9994	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9884	0,9988	–
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>328.622.843</b>	<b>271.321.884</b>	<b>180.183.426</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,0203	1,0424	1,0259
	Klasse A (Acc)	USD	1,0168	1,1265	–
	Klasse A (Inc)	EUR	1,0042	1,0321	1,0199
	Klasse C (Acc)	EUR	1,0347	1,0517	1,0300
	Klasse E (Acc)	EUR	1,0524	1,0643	1,0368
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,0084	1,0226	1,0001
	Klasse G (Acc)	EUR	1,0347	1,0518	1,0300
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,9850	1,0091	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10,3364	10,1131
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0445	1,0592	1,0346
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9993	1,0161	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10,4554	10,1533
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	1,0257	1,0322	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0161	1,0242	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,9759	1,0008	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9961	1,0178	1,0007
	Klasse X (Acc)	EUR	1,0600	1,0692	1,0388
	Klasse Z (Acc)^	EUR	0,9892	–	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	USD	–	1,0016	–
	Klasse Z (Inc)^	EUR	0,9793	–	–
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,9847	1,0016	–

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)**</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>78.396.803</b>	<b>34.247.376</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,1430	1,0735	–
	Klasse A (Inc)	EUR	1,1421	1,0740	–
	Klasse E (Acc)	EUR	1,1657	1,0841	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,1875	1,0950	–
	Klasse E (Inc)^	EUR	–	1,0837	–
	Klasse G (Acc)	EUR	1,2315	1,1510	–
	Klasse W (Acc)	EUR	1,1597	1,0812	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	1,0588	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1574	1,0736	–
	Klasse W (Inc)	EUR	1,1514	1,0813	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1,1498	1,0736	–
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>91.523.113</b>	<b>92.952.258</b>	<b>84.505.101</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0365	1,0503	0,9897
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0230	1,0301	0,9714
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>–</b>	<b>3.704.307</b>	<b>28.865.549</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A^	USD	–	3,3533	3,2641
	Klasse A ^	EUR	–	2,7020	2,8645
	Klasse B^	USD	–	2,4704	2,3927
	Klasse C^	USD	–	3,8823	3,7438
	Klasse C ^	EUR	–	3,3708	3,5342
	Klasse W (Acc)	USD	–	–	1,1876
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>297.752.469</b>	<b>230.267.279</b>	<b>419.124.854</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,4158	1,0314	1,1773
	Klasse B (Inc)	USD	1,3070	1,0382	1,1123
	Klasse C (Acc)^	USD	1,0280	–	–
	Klasse C (Inc)	USD	1,4388	1,1374	1,2123
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	1,0743	1,2073
	Klasse E (Inc)	USD	1,4670	1,1531	1,2223
	Klasse E (Inc)	EUR	1,4099	1,0328	1,1923
	Sterling E (Acc)	GBP	1,5112	1,1514	1,2265
	Sterling E (Inc)	GBP	1,3549	1,0541	1,1535
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1,3467	1,0655	1,1704
	Klasse W (Acc)	USD	1,6250	1,2548	1,2985
	Klasse W (Acc)	EUR	1,4391	1,0357	1,1673
	Klasse W (Inc)	USD	1,4568	1,1485	1,2211
	Sterling W (Inc)	GBP	1,3347	1,0417	1,1434

## 15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	31. Dezember 2019
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>USD</b>	<b>1.007.082.724</b>	<b>613.916.282</b>	<b>438.605.770</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0355	1,0299	–
	Klasse A (Inc)^	USD	1,0029	–	–
	Klasse A (Inc) (M)^	USD	0,9809	–	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,2713	1,2580	1,1713
	Klasse E (Acc)	USD	1,2229	1,2078	1,1223
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,1003	1,0988	1,0431
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,1611	1,1565	1,0941
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	1,0031	1,0285	1,0079
	Klasse G (Acc)^	USD	0,9978	–	–
	Sterling G (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0205	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1228	1,1261	1,0730
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	0,9977	–	–
	Sterling H (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0075	–	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,9699	1,0015	0,9887
	Klasse P (Acc)^	USD	1,0006	–	–
	Klasse P (Acc) (Hedged)^	AUD	0,9920	–	–
	Klasse P (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9886	–	–
	Klasse P (Inc)^	USD	0,9893	–	–
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	AUD	0,9920	–	–
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	EUR	0,9886	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,2773	1,2627	1,1745
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0575	0,9743	0,9871
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,1170	1,1166	1,0610
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,1562	1,1527	1,0916
	Klasse W (Inc)	USD	1,0796	1,0991	1,0591
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	1,0273	1,0573	1,0405
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,9975	1,0238	1,0044
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0034	–	–
	Klasse X (Acc)^	USD	–	1,2249	1,1342
	Klasse Z (Acc)^	USD	1,0097	–	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	CHF	0,9942	–	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9980	–	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0035	–	–
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*</b>					
<b>Summe Nettovermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>984.235.804</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	0,9909	–	–
	Klasse G (Acc)^	EUR	0,9947	–	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	0,9956	–	–
	Klasse W (Inc)^	EUR	0,9964	–	–
	Klasse X (Acc)^	EUR	0,9991	–	–
	Klasse Z (Acc)^	EUR	0,9961	–	–

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

\*\* Dieser Fonds wurde im vergangenen Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

^ Der BNY Mellon Digital Assets Fund wurde mit Wirkung vom 8. Dezember 2020 in BNY Mellon Blockchain Innovation Fund umbenannt. Die Vergleichsangaben vom 31. Dezember geben dies nun wieder.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

### STRATEGIE BEIM EINSATZ VON FINANZINSTRUMENTEN

Durch ihre Anlagetätigkeit ist die Gesellschaft verschiedenen Risikotypen ausgesetzt, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten verbunden sind, in die sie investiert. Hierzu zählen das Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko. Die Gesellschaft hat Risikomanagementprogramme etabliert, um die möglichen negativen Einflüsse dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Fonds zu begrenzen.

Die Vermögenswerte jedes Fonds werden separat in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik des betreffenden Fonds angelegt, die in den jeweiligen Nachträgen zum Prospekt aufgeführt sind. Enthält der Name eines Fonds eine bestimmte Währung, ein Land, eine Region, eine Branche oder eine Wertpapierart, werden mindestens drei Viertel der Vermögenswerte des betreffenden Fonds aus Anlagen bestehen, die dieser Währung, diesem Land, dieser Region, dieser Branche oder dieser Wertpapierart entsprechen.

Die Fonds dürfen zur effizienten Portfolioverwaltung oder zur Absicherung gegen Wechselkursrisiken FDI verwenden. Einige Fonds können gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank FDI zu Anlagezwecken einsetzen. In dem Risikomanagementprozess („RMP“) wird erklärt, ob die einzelnen Fonds den Commitment-Ansatz oder Value at Risk („VaR“) für die Berechnung des Gesamtengagements anwendet. Der Commitment-Ansatz misst den durch den Einsatz von Derivaten erzielten Hebeleffekt, der durch Umrechnung aller Derivat-Positionen, die entweder im Rahmen der allgemeinen Anlagepolitik des Fonds, zur Risikominderung oder für eine effiziente Portfolioverwaltung verwendet werden, auf der Grundlage des Marktwerts der zugrunde liegenden Vermögenswerte oder Kontrakte berechnet wird. Der VaR für einen zuvor festgelegten Zeithorizont misst die Wertverlustschwelle eines Portfolios mit Finanzinstrumenten, die mit einer vorgegebenen Wahrscheinlichkeit (entweder Absolut [1] oder Relativ [2]) überschritten werden kann. Die Qualität der Prognosen nach dem VaR-Modell wird anhand von Rückvergleichen belegt. Ergänzend zum VaR wird ein Stresstest verwendet, um die mögliche Auswirkung extremer, wenngleich plausibler Ereignisse oder Entwicklungen bei einer Reihe von Finanzkennzahlen auf die Portfoliowerte zu beurteilen.

Für eine ausführliche Erörterung steht der RMP für jeden Fonds auf Anfrage zur Verfügung.

<sup>[1]</sup> Definiert als der VaR des Fonds, dessen Höchstgrenze einem Prozentsatz des NIW entspricht.

<sup>[2]</sup> Definiert als der VaR des Fonds, geteilt durch den VaR eines Referenzwerts oder eines Referenzportfolios.

### PROZESS DES FINANZIELLEN RISIKOMANAGEMENTS

Um ihre Anlageziele zu erreichen, kauft, verkauft und hält die Gesellschaft finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten. Dadurch ist sie möglicherweise dem Marktpreisrisiko, Zinsrisiko, Währungsrisiko, Kreditrisiko und Liquiditätsrisiko ausgesetzt, die mit den von ihr gehaltenen Finanzinstrumenten verbunden sind. Das umfassende Risikomanagementprogramm der Gesellschaft richtet sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, mögliche negative Einflüsse dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Gesellschaft zu minimieren. Die Gesellschaft setzt FDI zur Verringerung bestimmter Risiken ein.

Die von der Gesellschaft beim Umgang mit diesen Risiken eingesetzten Strategien werden nachfolgend erläutert.

### ANLAGERISIKO

Durch die Aktivitäten der einzelnen Fonds ist die Gesellschaft verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt. Hierzu zählen das Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko.

### MARKTRISIKO

Das Marktrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise schwanken könnte. Das Marktrisiko umfasst folgende drei Risikoarten: Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Fremdwährungsrisiko.

### MARKTPREISRISIKO

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der angemessene Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (die nicht auf das Zinsrisiko und das Währungsrisiko zurückzuführen sind) schwanken kann, ganz gleich, ob diese Veränderungen durch spezielle Faktoren einzelner Finanzinstrumente oder ihrer Emittenten verursacht werden oder durch andere Faktoren, die ähnliche am Markt gehandelte Finanzinstrumente betreffen.

Ein Großteil der Fonds handelt mit Finanzinstrumenten und hält Positionen in Wertpapieren, die an Aktienmärkten oder Märkten für Aktienderivate gehandelt werden. Die Anlagen der Fonds unterliegen Marktschwankungen. Daher kann nicht garantiert werden, dass der Wert der Anlagen steigen wird. Somit besteht das Risiko eines Kapitalverlusts.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MARKTPREISRISIKO Forts.

Die Anlageverwalter steuern das Marktpreisrisiko durch die Zusammenstellung diversifizierter Anlageportfolios, die sich über verschiedene, für die Fonds angemessene Branchen und/oder geografische Regionen erstrecken, und mit den OGAW-Vorschriften der Zentralbank sowie den Anlagezielen der Fonds übereinstimmen. Eine Analyse des Marktpreisrisikos der einzelnen Fonds enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände. Sämtliche Marktpositionen der Fonds werden auf täglicher Basis von den Anlageverwaltern überwacht und auf monatlicher Basis vom Anlagekomitee (Investment Management Oversight Committee) sowie auf vierteljährlicher Basis vom Verwaltungsrat geprüft.

Die Marktrisikostrategie der Gesellschaft wird durch das Anlagerisiko und die Renditeziele der Gesellschaft bestimmt. Der Verwaltungsrat hat die Anlageverwalter angewiesen, sämtliche Risiken in Übereinstimmung mit einem eingeführten Risikomanagementsystem zu verwalten.

Die nachfolgende Tabelle zeigt beispielhaft den wahrscheinlichen Anstieg des Nettoinventarwerts, der durch einen 5%-igen Anstieg des mit den Fonds verbundenen Marktindex ausgelöst würde (ein 5%-iger Rückgang hätte ähnliche negative Auswirkungen). Bitte beachten Sie, dass die Tabelle keine Anleihefonds enthält, da diese, wie unten erläutert, vor allem einem Zinsrisiko ausgesetzt sind. Der nachfolgende Kommentar enthält detaillierte Angaben zur Marktsensitivität dieser Fonds. Im Interesse konsistenter Vergleiche zwischen den Fonds geht die Tabelle von einer Veränderung um 5 % aus. Zu beachten ist, dass künftige Marktbedingungen erheblich abweichen können und die Tabelle nur der Veranschaulichung dient.

Für die in der umseitigen Tabelle aufgeführten Fonds wird der Anstieg oder Rückgang des den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 bei einem Anstieg oder Rückgang des Marktwerts um 5 % bei ansonsten konstanten Variablen gezeigt.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MARKTPREISRISIKO Forts.

Fonds	Referenzindex	Währung	Volatilität		Anstieg/(Rückgang) der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	
			2021	2020	2021	2020
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>	MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	3.081.287	3.571.058
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>	FTSE Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	717.912	1.615.433
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund<sup>^</sup></b>	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	4.648.830	785.562
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>	MSCI Brazil 10/40 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.956.434	3.216.813
<b>BNY Mellon Future Earth Fund<sup>^*</sup></b>	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	104.945	k. A.
<b>BNY Mellon Future Food Fund<sup>^*</sup></b>	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	134.864	k. A.
<b>BNY Mellon Future Life Fund<sup>^*</sup></b>	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	114.923	k. A.
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>	MSCI Emerging Markets Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	2.676.768	2.797.338
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	21.636.013	19.292.641
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>	FTSE World Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	18.061.838	32.966.846
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	S&P Global Infrastructure Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	12.163.421	7.103.885
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>	MSCI World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	2.902.497	1.774.015
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund<sup>*&gt;</sup></b>	60 % MSCI All-Country World Index NR und 40 % ICE Bank of America Merrill Lynch Global Broad Market Index TR EUR	EUR	5,00 %	5,00 %	k. A.	1.012.657
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.826.627	1.763.968
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)<sup>&gt;</sup></b>	1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a.	EUR	5,00 %	5,00 %	k. A.	142.851.828
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)<sup>&gt;</sup></b>	SONIA (30 Tage aufgezinst) + 4 % p.a. / (2020 - 1-Monats-GBP-LIBOR + 4 % p.a.)	GBP	5,00 %	5,00 %	k. A.	3.026.563
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)<sup>&gt;</sup></b>	SOFR (30 Tage aufgezinst) + 4 % p.a. / (2020 - 1-Monats-USD-LIBOR + 4 % p.a.)	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	14.283.127
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	60 % MSCI All-Country World Index NR und 40 % JP Morgan Global Government Bond Unhedged Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	1.718.082	1.637.624
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>	Russell Nomura Small Cap Index	JPY	5,00 %	5,00 %	1.259.549.792	995.553.752
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>	MSCI World Index NR	EUR	5,00 %	5,00 %	69.225.013	68.319.040
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>	MSCI All-Country World Mid Cap Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	50.579.822	23.441.943
<b>BNY Mellon S&amp;P 500<sup>®</sup> Index Tracker<sup>*</sup></b>	S&P 500 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	1.828.982
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	S&P EuroZone Small Cap Index TR	EUR	5,00 %	5,00 %	4.393.165	3.279.417
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund<sup>^</sup></b>	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	248.147	246.070
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)<sup>^&gt;</sup></b>	1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a.	EUR	5,00 %	5,00 %	k. A.	1.647.141
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund<sup>*</sup></b>	Russell 1000 Value Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	209.349
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	S&P 500 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	17.374.008	13.186.246

<sup>\*</sup> Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

<sup>></sup> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

<sup>^</sup> Da der Fonds seit weniger als drei Jahren besteht, ist kein statistisch signifikantes Beta verfügbar. Daher wird zur Angabe der Marktpreissensitivität bei der effektiven Berechnung für diese Fonds ein fiktives Beta von 1 angewendet.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MARKTPREISRISIKO Forts.

Für die Anleihefonds ist die Wahrscheinlichkeit eines Rückgangs des Nettoinventarwerts als Folge eines Abwärtstrends der Marktpreise umseitig angegeben.

Zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 wäre für Anleihefonds unter Verwendung des VaR-Risikomodells der Anlageverwalter (bei denen der VaR auf Wahrscheinlichkeit basiert) mit einem maximalen Verlust in Höhe des nachfolgend angegebenen Prozentsatzes gemäß nachstehender Tabelle (regulatorische Grenze) in jeder beliebigen Woche oder an jedem beliebigen Tag zu rechnen, d. h. der Fonds würde voraussichtlich in einer von hundert Wochen oder an einem von hundert Tagen den in der nachstehenden VaR-Tabelle angegebenen Prozentsatz seines Nettoinventarwerts verlieren. Nachstehende Tabelle zeigt ferner den VaR jedes Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020, der mit einem 99%-igen Konfidenzniveau über die Haltedauer gemessen wird.

Fonds	Konfidenzniveau	VaR-Typ	Bestand Berichts- zeitraum 2021	Bestand Berichts- zeitraum 2020	Regula- torische Grenze 2021	Regula- torische Grenze 2020	VaR 2021	VaR 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	5,00 %	5,00%	1.29%	0,55 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	10,00 %	10,00%	1.05%	2,04 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	6,00 %	6,00%	1.15%	1,06 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	5.70%	k. A.
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	10,00 %	10,00%	k. A.	4,03 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00%	113.36%	98,58 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00%	124.25%	118,49 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00%	112.61%	123,74 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00%	134.40%	143,36 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00%	100.66%	121,82 %
BNY Mellon European Credit Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00%	98.00%	108,00 %
BNY Mellon Global Credit Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00%	92.00%	96,00 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	2.37%	k. A.
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	99 %	Relativ	Ein Tag	Ein Tag	200,00 %	200,00%	98.23%	116,10 %
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	k. A.	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	9.41%	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	8.75%	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	8.88%	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	2.41%	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	k. A.	20,00 %	k. A.	8.98%	k. A.
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00%	1.63%	1,81 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00%	3.12%	3,35 %

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Der VaR ist die Risikobewertungsmethode, die verwendet wird, um Leverage und Marktrisikovolatilität der Fonds zu beurteilen. Wird der VaR als Prozentsatz des Nettoinventarwerts der Fonds berechnet (absoluter oder relativer VaR), darf er die im Prospekt angegebenen regulatorischen Höchstgrenzen nicht übersteigen. Der VaR wird täglich auf der Grundlage eines einseitigen Konfidenzniveaus von 99 % und einer im Voraus festgelegten Haltefrist entweder auf einer absoluten Basis (bei der der Wert mit dem Nettoinventarwert des Fonds verglichen wird) oder auf einer relativen Basis (bei der der VaR mit dem Referenzwert oder dem Referenzportfolio verglichen wird) berechnet. Der historische Beobachtungszeitraum darf nicht weniger als ein Jahr betragen, sofern kein kürzerer Zeitraum gerechtfertigt ist.

Nachfolgend eine Auflistung der Nachteile der VaR-Analyse:

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MARKTPREISRISIKO Forts.

- die Modelle basieren auf historischen Daten und können nicht die Tatsache berücksichtigen, dass künftige Veränderungen des Marktpreises, Korrelationen zwischen Märkten und dem Niveau der Marktliquidität in Situationen von Marktstress möglicherweise nicht mit historischen Mustern zusammenhängen;
- die Angaben zum Marktpreisrisiko sind eher eine relative Risikoschätzung als eine präzise und genaue Zahl;
- die Angaben zum Marktpreis stellen ein hypothetisches Ergebnis dar und sind nicht als Prognose zu werten.

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausage
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	7,60 %	14,46 %	25,80 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	7,70 %	11,95 %	26,80 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	9,68 %	14,22 %	21,03 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	20,53 %	27,56 %	31,67 %
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	0,00 %	42,59 %	48,56 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	49,34 %	56,48 %	59,66 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	57,83 %	60,40 %	63,94 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	56,01 %	59,50 %	62,62 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	64,68 %	70,01 %	76,52 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	47,59 %	54,19 %	61,56 %
BNY Mellon European Credit Fund	44,50 %	52,65 %	58,00 %
BNY Mellon Global Credit Fund	39,50 %	46,34 %	50,00 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	9,21 %	11,13 %	13,38 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	49,12 %	58,52 %	71,15 %
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*^>	10,35 %	54,31 %	67,18 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	33,45 %	47,35 %	66,28 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	26,40 %	44,46 %	62,40 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	18,44 %	44,40 %	61,61 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	8,08 %	10,33 %	12,46 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	29,70 %	46,69 %	67,40 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	5,18 %	7,13 %	9,76 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	31,23 %	35,28 %	40,76 %

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

^ Die Ermittlung des durchschnittlichen Leverage-Niveaus basiert auf Daten für den Berichtszeitraum vom 22. Januar 2021, dem Datum des Inkrafttretens der VaR-Übernahme, bis zum 17. März 2021. Der Fonds wurde anschließend am 26. März 2021 geschlossen.

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausage
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	10,60 %	25,00 %	50,00 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	0,70 %	14,10 %	20,50 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	4,91 %	12,69 %	23,83 %
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	11,84 %	39,48 %	58,00 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	60,64 %	100,61 %	114,48 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	45,45 %	60,47 %	64,77 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	54,41 %	58,63 %	62,05 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	56,00 %	66,91 %	71,97 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	48,42 %	76,44 %	97,42 %
BNY Mellon European Credit Fund	34,50 %	55,00 %	63,00 %
BNY Mellon Global Credit Fund	43,50 %	50,50 %	73,50 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	44,85 %	51,98 %	68,37 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	1,85 %	13,72 %	20,59 %



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MARKTPREISRISIKO Forts.

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausnutzung
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	14,03 %	17,17 %	19,64 %

Leverage wird als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. (Dies kann durch eine Berechnung des Leverage auf der Basis eines Commitment-Ansatzes ergänzt werden. Die Einrichtung eines gehebelten Engagements in einem Index mittels FDI oder die Berücksichtigung eines Leverage-Merkmals in einem Index muss bei der Einhaltung der Offenlegungsbestimmungen des Prospekts ebenfalls berücksichtigt werden.)

Das durchschnittliche Leveragesniveau, das im Verlauf des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 angewendet wurde, gestaltet sich wie folgt:

Fonds	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2021	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	382,97 %	551,05 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	167,00 %	124,83 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	221,00 %	258,55 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	566,25 %	k. A.
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	558,22 %	473,40 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	39,10 %	31,82 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	24,62 %	36,20 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	91,87 %	68,30 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	50,42 %	51,42 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	106,52 %	144,79 %
BNY Mellon European Credit Fund	23,50 %	28,08 %
BNY Mellon Global Credit Fund	188,60 %	210,32 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	108,46 %	k. A.
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	89,01 %	41,01 %
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*^>	51,83 %	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	122,91 %	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	108,10 %	k. A.
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	67,99 %	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	131,87 %	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	116,85 %	k. A.
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	145,39 %	119,59 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	k. A.	k. A.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

> Die Ermittlung des durchschnittlichen Leverage-Niveaus basiert auf Daten für den Berichtszeitraum vom 22. Januar 2021, dem Datum des Inkrafttretens der VaR-Übernahme, bis zum 17. März 2021. Der Fonds wurde anschließend am 26. März 2021 geschlossen.

### ZINSRISIKO

Das Zinsrisiko wird definiert als Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwanken könnte. Dieses Risiko betrifft Finanzinstrumente, bei denen sich Zinsänderungen negativ auf den beizulegenden Zeitwert auswirken.

Die Mehrzahl der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft, d. h. jene Fonds, die vorwiegend Aktien oder Aktienderivate halten, sind nicht zinstragend. Demzufolge unterliegen diese Vermögenswerte keinem hohen Risiko von Schwankungen der jeweils vorherrschenden Marktzinsen. Alle überschüssigen Barmittel und Bargewerte werden kurzfristig am Markt angelegt.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

Die nachfolgende Tabelle fasst das Zinsrisiko für die Gesellschaft zum 31. Dezember 2021 zusammen. Sie enthält die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert, kategorisiert nach vertraglicher Zinsanpassung oder Fälligkeitsterminen, und zwar dem jeweils früheren von beiden:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	6 Jahre EUR		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	132.792.315	62.118.942	154.072.756	44.908.829	393.892.842
Barmittel und Bargegenwerte	28.685.756	–	–	–	28.685.756
Margen auf Derivatkontrakte	24.088.305	–	–	–	24.088.305
Forderungen	–	–	–	1.949.114	1.949.114
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>185.566.376</b>	<b>62.118.942</b>	<b>154.072.756</b>	<b>46.857.943</b>	<b>448.616.017</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	6.593.995	8.925.041	364.491	5.703.547	21.587.074
Banküberziehung	247.049	–	–	–	247.049
Margen auf Derivatkontrakte	3.329.865	–	–	–	3.329.865
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.618.800	2.618.800
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>10.170.909</b>	<b>8.925.041</b>	<b>364.491</b>	<b>8.322.347</b>	<b>27.782.788</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>175.395.467</b>	<b>53.193.901</b>	<b>153.708.265</b>		
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Monat GBP	1-3 Monate GBP	3 Monate GBP		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	4.999.686	40.497.957	49.600.212	32.836.849	127.934.704
Barmittel und Bargegenwerte	735.906	–	–	–	735.906
Margen auf Derivatkontrakte	1.714.385	–	–	–	1.714.385
Forderungen	–	–	–	2.669.531	2.669.531
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>7.449.977</b>	<b>40.497.957</b>	<b>49.600.212</b>	<b>35.506.380</b>	<b>133.054.526</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	37.152	254.653	–	5.938.454	6.230.259
Margen auf Derivatkontrakte	26.275	–	–	–	26.275
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.092.121	3.092.121
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>63.427</b>	<b>254.653</b>	<b>–</b>	<b>9.030.575</b>	<b>9.348.655</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>7.386.550</b>	<b>40.243.304</b>	<b>49.600.212</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	Weniger als 1 Monat EUR	1-3 Monate EUR	Über 3 Monate EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2021 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	27.417.037	33.036.115	34.002.396	11.234.811	105.690.359
Barmittel und Bargegenwerte	1.156.742	–	–	–	1.156.742
Margen auf Derivatkontrakte	1.060.741	–	–	–	1.060.741
Forderungen	–	–	–	1.534.714	1.534.714
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>29.634.520</b>	<b>33.036.115</b>	<b>34.002.396</b>	<b>12.769.525</b>	<b>109.442.556</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	15.465	3.468.239	8.684.879	12.168.583
Margen auf Derivatkontrakte	705.341	–	–	–	705.341
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.420.468	1.420.468
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>705.341</b>	<b>15.465</b>	<b>3.468.239</b>	<b>10.105.347</b>	<b>14.294.392</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>28.929.179</b>	<b>33.020.650</b>	<b>30.534.157</b>
-------------------	-------------------	-------------------

#### BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund\*

	Weniger als 1 Monat USD	1-3 Monate USD	Über 3 Monate USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.211.247	5.321.204	11.889.154	249.542	22.671.147
Barmittel und Bargegenwerte	2.368.625	–	–	–	2.368.625
Margen auf Derivatkontrakte	924.226	–	–	–	924.226
Forderungen	–	–	–	17.900	17.900
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>8.504.098</b>	<b>5.321.204</b>	<b>11.889.154</b>	<b>267.442</b>	<b>25.981.898</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.263	100.030	16.831	188.337	308.461
Banküberziehung	189	–	–	–	189
Margen auf Derivatkontrakte	903.094	–	–	–	903.094
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	19.149	19.149
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>906.546</b>	<b>100.030</b>	<b>16.831</b>	<b>207.486</b>	<b>1.230.893</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>7.597.552</b>	<b>5.221.174</b>	<b>11.872.323</b>
------------------	------------------	-------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	57.308.675	–	–	553.007.664	610.316.339
Barmittel und Bargegenwerte	40.040.201	–	–	–	40.040.201
Margen auf Derivatkontrakte	4.903.000	–	–	–	4.903.000
Forderungen	–	–	–	245.269	245.269
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>102.251.876</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>553.252.933</b>	<b>655.504.809</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	37	37
Margen auf Derivatkontrakte	3.087.954	–	–	–	3.087.954
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	6.492.704	6.492.704
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>3.087.954</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.492.741</b>	<b>9.580.695</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>99.163.922</b>	<b>–</b>	<b>–</b>		
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	340.778	99.824.631	84.254.309	3.415.514	187.835.232
Barmittel und Bargegenwerte	511.757	–	–	–	511.757
Margen auf Derivatkontrakte	536.577	–	–	–	536.577
Forderungen	–	–	–	3.010.979	3.010.979
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.389.112</b>	<b>99.824.631</b>	<b>84.254.309</b>	<b>6.426.493</b>	<b>191.894.545</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	363.707	363.707
Margen auf Derivatkontrakte	102.127	–	–	–	102.127
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	130.051	130.051
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>102.127</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>493.758</b>	<b>595.885</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>1.286.985</b>	<b>99.824.631</b>	<b>84.254.309</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	237.804	9.684.097	9.746.274	496.198	20.164.373
Barmittel und Bargegenwerte	218.419	–	–	–	218.419
Margen auf Derivatkontrakte	208.819	–	–	–	208.819
Forderungen	–	–	–	188.279	188.279
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>665.042</b>	<b>9.684.097</b>	<b>9.746.274</b>	<b>684.477</b>	<b>20.779.890</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	7.074	–	–	53.875	60.949
Margen auf Derivatkontrakte	4.801	–	–	–	4.801
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	22.835	22.835
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>11.875</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>76.710</b>	<b>88.585</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**653.167      9.684.097      9.746.274**

#### BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	9.808.281	844.981.241	1.016.554.823	14.611.501	1.885.955.846
Barmittel und Bargegenwerte	11.424.672	–	–	–	11.424.672
Margen auf Derivatkontrakte	2.872.146	–	–	–	2.872.146
Forderungen	–	–	–	25.040.073	25.040.073
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>24.105.099</b>	<b>844.981.241</b>	<b>1.016.554.823</b>	<b>39.651.574</b>	<b>1.925.292.737</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.062.188	–	–	2.130.766	3.192.954
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	791.611	791.611
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.062.188</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.922.377</b>	<b>3.984.565</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**23.042.911      844.981.241      1.016.554.823**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2021
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.564.975	336.764.736	364.123.455	10.502.720	713.955.886
Barmittel und Bargegenwerte	4.125.462	–	–	–	4.125.462
Margen auf Derivatkontrakte	3.485.548	–	–	–	3.485.548
Forderungen	–	–	–	12.806.102	12.806.102
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>10.175.985</b>	<b>336.764.736</b>	<b>364.123.455</b>	<b>23.308.822</b>	<b>734.372.998</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	4.088.433	4.088.433
Margen auf Derivatkontrakte	3.376.774	–	–	–	3.376.774
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	296.088	296.088
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>3.376.774</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.384.521</b>	<b>7.761.295</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**6.799.211 336.764.736 364.123.455**

#### BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2021
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	76.471	195.710.810	306.535.340	29.950.785	532.273.406
Barmittel und Bargegenwerte	11.409.759	–	–	–	11.409.759
Margen auf Derivatkontrakte	1.059.157	–	–	–	1.059.157
Forderungen	–	–	–	10.359.242	10.359.242
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>12.545.387</b>	<b>195.710.810</b>	<b>306.535.340</b>	<b>40.310.027</b>	<b>555.101.564</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	247.063	82.256	–	10.371	339.690
Banküberziehung	4	–	–	–	4
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	495.679	495.679
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>247.067</b>	<b>82.256</b>	<b>–</b>	<b>506.050</b>	<b>835.373</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**12.298.320 195.628.554 306.535.340**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	27.476	7.160.065	24.751.740	9.510	31.948.791
Barmittel und Bargegenwerte	1.097.087	–	–	–	1.097.087
Margen auf Derivatkontrakte	182.622	–	–	–	182.622
Forderungen	–	–	–	427.361	427.361
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.307.185</b>	<b>7.160.065</b>	<b>24.751.740</b>	<b>436.871</b>	<b>33.655.861</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	40.411	–	–	5.140	45.551
Margen auf Derivatkontrakte	31.067	–	–	–	31.067
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	444.343	444.343
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>71.478</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>449.483</b>	<b>520.961</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>1.235.707</b>	<b>7.160.065</b>	<b>24.751.740</b>
------------------	------------------	-------------------

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	–	34.596.758	68.598.981	910.828	104.106.567
Barmittel und Bargegenwerte	9.004.966	–	–	–	9.004.966
Margen auf Derivatkontrakte	258.000	–	–	–	258.000
Forderungen	–	–	–	1.915.398	1.915.398
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>9.262.966</b>	<b>34.596.758</b>	<b>68.598.981</b>	<b>2.826.226</b>	<b>115.284.931</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	–	–	–	481.453	481.453
Banküberziehung	118.027	–	–	–	118.027
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.125.721	1.125.721
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>118.027</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.607.174</b>	<b>1.725.201</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>9.144.939</b>	<b>34.596.758</b>	<b>68.598.981</b>
------------------	-------------------	-------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.494	4.821.133	21.710.670	96.068	26.631.365
Barmittel und Bargegenwerte	1.028.474	–	–	–	1.028.474
Margen auf Derivatkontrakte	30.257	–	–	–	30.257
Forderungen	–	–	–	403.532	403.532
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.062.225</b>	<b>4.821.133</b>	<b>21.710.670</b>	<b>499.600</b>	<b>28.093.628</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.441	–	–	81.789	83.230
Margen auf Derivatkontrakte	5.427	–	–	–	5.427
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	121.683	121.683
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>6.868</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>203.472</b>	<b>210.340</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**1.055.357      4.821.133      21.710.670**

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.466.989	45.120.401	64.514.767	6.108.578	121.210.735
Barmittel und Bargegenwerte	2.766.010	–	–	–	2.766.010
Margen auf Derivatkontrakte	275.214	–	–	–	275.214
Forderungen	–	–	–	2.116.865	2.116.865
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>8.508.213</b>	<b>45.120.401</b>	<b>64.514.767</b>	<b>8.225.443</b>	<b>126.368.824</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	70.322	35.277	–	388.669	494.268
Banküberziehung	191	–	–	–	191
Margen auf Derivatkontrakte	28.331	–	–	–	28.331
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	168.709	168.709
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>98.844</b>	<b>35.277</b>	<b>–</b>	<b>557.378</b>	<b>691.499</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**8.409.369      45.085.124      64.514.767**



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Euroland Bond Fund	Weniger als		Über	Unverzinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.217.220	109.096.315	156.948.646	2.838.033	270.100.214
Barmittel und Bargegenwerte	4.325.469	–	–	–	4.325.469
Margen auf Derivatkontrakte	4.982.507	–	–	–	4.982.507
Forderungen	–	–	–	1.689.892	1.689.892
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>10.525.196</b>	<b>109.096.315</b>	<b>156.948.646</b>	<b>4.527.925</b>	<b>281.098.082</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	261.581	–	–	267.752	529.333
Margen auf Derivatkontrakte	4.016.798	–	–	–	4.016.798
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	629.778	629.778
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>4.278.379</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>897.530</b>	<b>5.175.909</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**6.246.817    109.096.315    156.948.646**

### BNY Mellon European Credit Fund

BNY Mellon European Credit Fund	Weniger als		Über	Unverzinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	267.022	19.796.146	18.057.439	1.476.635	39.597.242
Barmittel und Bargegenwerte	1.036.134	–	–	–	1.036.134
Margen auf Derivatkontrakte	630.660	–	–	–	630.660
Forderungen	–	–	–	251.041	251.041
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.933.816</b>	<b>19.796.146</b>	<b>18.057.439</b>	<b>1.727.676</b>	<b>41.515.077</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.997	111.371	–	29.711	148.079
Margen auf Derivatkontrakte	614.360	–	–	–	614.360
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	14.429	14.429
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>621.357</b>	<b>111.371</b>	<b>–</b>	<b>44.140</b>	<b>776.868</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**1.312.459    19.684.775    18.057.439**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Bond Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.225.979	158.672.376	235.130.383	26.149.679	428.178.417
Barmittel und Bargegenwerte	6.370.439	–	–	–	6.370.439
Margen auf Derivatkontrakte	503.154	–	–	–	503.154
Forderungen	–	–	–	4.237.696	4.237.696
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>15.099.572</b>	<b>158.672.376</b>	<b>235.130.383</b>	<b>30.387.375</b>	<b>439.289.706</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	1.982.261	1.982.261
Banküberziehung	754	–	–	–	754
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.624.330	2.624.330
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>754</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.606.591</b>	<b>4.607.345</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>15.098.818</b>	<b>158.672.376</b>	<b>235.130.383</b>		
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
BNY Mellon Global Credit Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.728.464	175.844.189	260.606.312	2.417.174	440.596.139
Barmittel und Bargegenwerte	3.640.662	–	–	–	3.640.662
Margen auf Derivatkontrakte	12.238.567	–	–	–	12.238.567
Forderungen	–	–	–	2.916.640	2.916.640
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>17.607.693</b>	<b>175.844.189</b>	<b>260.606.312</b>	<b>5.333.814</b>	<b>459.392.008</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.806.506	4.948.648	–	4.259.137	13.014.291
Margen auf Derivatkontrakte	3.281.263	–	–	–	3.281.263
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	134.500	134.500
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>7.087.769</b>	<b>4.948.648</b>	<b>–</b>	<b>4.393.637</b>	<b>16.430.054</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>10.519.924</b>	<b>170.895.541</b>	<b>260.606.312</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	17.924.037	260.065.100	96.409.600	25.199.905	399.598.642
Barmittel und Bargegenwerte	19.333.211	–	–	–	19.333.211
Margen auf Derivatkontrakte	150.834	–	–	–	150.834
Forderungen	–	–	–	19.672.505	19.672.505
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>37.408.082</b>	<b>260.065.100</b>	<b>96.409.600</b>	<b>44.872.410</b>	<b>438.755.192</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	–	–	–	1.874.889	1.874.889
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	14.610	–	–	–	14.610
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.872.199	3.872.199
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>14.611</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.747.088</b>	<b>5.761.699</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>37.393.471</b>	<b>260.065.100</b>	<b>96.409.600</b>		
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	–	62.780.828	96.286.036	172.172	159.239.036
Barmittel und Bargegenwerte	5.521.790	–	–	–	5.521.790
Forderungen	–	–	–	3.472.987	3.472.987
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>5.521.790</b>	<b>62.780.828</b>	<b>96.286.036</b>	<b>3.645.159</b>	<b>168.233.813</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	–	–	–	163.678	163.678
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.376.440	1.376.440
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.540.118</b>	<b>1.540.118</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>5.521.790</b>	<b>62.780.828</b>	<b>96.286.036</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2021 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	32.669.415	128.570.880	49.544.114	2.520.352.431	2.731.136.840
Barmittel und Bargegenwerte	397.401.682	–	–	–	397.401.682
Margen auf Derivatkontrakte	50.734.594	–	–	–	50.734.594
Forderungen	–	–	–	12.902.491	12.902.491
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>480.805.691</b>	<b>128.570.880</b>	<b>49.544.114</b>	<b>2.533.254.922</b>	<b>3.192.175.607</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	20.968.937	–	–	44.019.460	64.988.397
Banküberziehung	10	–	–	–	10
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.458.441	5.458.441
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>20.968.947</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>49.477.901</b>	<b>70.446.848</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>459.836.744</b>	<b>128.570.880</b>	<b>49.544.114</b>
--------------------	--------------------	-------------------

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Weniger als 1 Jahr GBP	1-6 Jahre GBP	Über 6 Jahre GBP	Unver- zinslich GBP	Summe 2021 GBP
--	------------------------------	------------------	------------------------	---------------------------	----------------------

### Vermögenswerte

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.268.513	2.472.414	877.186	51.297.194	58.915.307
Barmittel und Bargegenwerte	6.793.574	–	–	–	6.793.574
Margen auf Derivatkontrakte	591.125	–	–	–	591.125
Forderungen	–	–	–	258.543	258.543
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>11.653.212</b>	<b>2.472.414</b>	<b>877.186</b>	<b>51.555.737</b>	<b>66.558.549</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	423.460	–	–	180.785	604.245
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	57.258	57.258
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>423.461</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>238.043</b>	<b>661.504</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>11.229.751</b>	<b>2.472.414</b>	<b>877.186</b>
-------------------	------------------	----------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	6 Jahre USD		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	32.392.855	10.979.940	4.325.195	340.765.144	388.463.134
Barmittel und Bargegenwerte	50.536.285	–	–	–	50.536.285
Margen auf Derivatkontrakte	1.513.097	–	–	–	1.513.097
Forderungen	–	–	–	3.316.294	3.316.294
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>84.442.237</b>	<b>10.979.940</b>	<b>4.325.195</b>	<b>344.081.438</b>	<b>443.828.810</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.860.573	–	–	362.098	3.222.671
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.996.804	2.996.804
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>2.860.573</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.358.902</b>	<b>6.219.475</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>81.581.664</b>	<b>10.979.940</b>	<b>4.325.195</b>		

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	6 Jahre USD		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	116.058	650.718.926	49.851.123	85.495.748	786.181.855
Barmittel und Bargegenwerte	4.463.781	–	–	–	4.463.781
Forderungen	–	–	–	16.500.236	16.500.236
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>4.579.839</b>	<b>650.718.926</b>	<b>49.851.123</b>	<b>101.995.984</b>	<b>807.145.872</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	1.769.339	1.769.339
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	12.803.161	12.803.161
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>14.572.500</b>	<b>14.572.500</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>4.579.839</b>	<b>650.718.926</b>	<b>49.851.123</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	Weniger als		Über		Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	6 Jahre USD	USD		
<b>Vermögenswerte</b>						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	1.568.110	3.866.625	24.323.376	–	29.758.111
Barmittel und Bargegenwerte	2.876.300	–	–	–	–	2.876.300
Forderungen	–	–	–	57.974	–	57.974
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>2.876.300</b>	<b>1.568.110</b>	<b>3.866.625</b>	<b>24.381.350</b>	<b>–</b>	<b>32.692.385</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	136.007	–	136.007
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.277	–	5.277
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>141.284</b>	<b>–</b>	<b>141.284</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>2.876.300</b>	<b>1.568.110</b>	<b>3.866.625</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Weniger als		Über		Unver- zinslich	Summe 2021
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	6 Jahre EUR	EUR		
<b>Vermögenswerte</b>						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	15.913.323	197.953.131	89.640.187	1.546.746	–	305.053.387
Barmittel und Bargegenwerte	22.038.050	–	–	–	–	22.038.050
Margen auf Derivatkontrakte	3.234.182	–	–	–	–	3.234.182
Forderungen	–	–	–	3.130.232	–	3.130.232
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>41.185.555</b>	<b>197.953.131</b>	<b>89.640.187</b>	<b>4.676.978</b>	<b>–</b>	<b>333.455.851</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	4.219.461	–	4.219.461
Margen auf Derivatkontrakte	12.011	–	–	–	–	12.011
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	601.536	–	601.536
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>12.011</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.820.997</b>	<b>–</b>	<b>4.833.008</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>41.173.544</b>	<b>197.953.131</b>	<b>89.640.187</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2021 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	644.689	1.811.439	516.289	62.669.734	65.642.151
Barmittel und Bargegenwerte	13.218.317	–	–	–	13.218.317
Margen auf Derivatkontrakte	660.451	–	–	–	660.451
Forderungen	–	–	–	437.381	437.381
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>14.523.457</b>	<b>1.811.439</b>	<b>516.289</b>	<b>63.107.115</b>	<b>79.958.300</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	484.867	–	–	993.467	1.478.334
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	83.163	83.163
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>484.867</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.076.630</b>	<b>1.561.497</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>14.038.590</b>	<b>1.811.439</b>	<b>516.289</b>
-------------------	------------------	----------------

#### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	7.131.983	32.232.714	52.023.217	1.951.732	93.339.646
Barmittel und Bargegenwerte	4.603.483	–	–	–	4.603.483
Margen auf Derivatkontrakte	1.129.078	–	–	–	1.129.078
Forderungen	–	–	–	529.962	529.962
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>12.864.544</b>	<b>32.232.714</b>	<b>52.023.217</b>	<b>2.481.694</b>	<b>99.602.169</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	122.825	–	–	162.053	284.878
Margen auf Derivatkontrakte	501.225	–	–	–	501.225
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	7.292.953	7.292.953
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>624.050</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>7.455.006</b>	<b>8.079.056</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>12.240.494</b>	<b>32.232.714</b>	<b>52.023.217</b>
-------------------	-------------------	-------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2021 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.519.202	96.288.463	891.859.486	3.695.769	993.362.920
Barmittel und Bargegenwerte	5.645.506	–	–	–	5.645.506
Forderungen	–	–	–	10.248.486	10.248.486
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>7.164.708</b>	<b>96.288.463</b>	<b>891.859.486</b>	<b>13.944.255</b>	<b>1.009.256.912</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	29.655	29.655
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.144.533	2.144.533
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.174.188</b>	<b>2.174.188</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**7.164.708    96.288.463    891.859.486**

#### Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund\*

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2021 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	36.675.038	456.281.108	457.677.641	34.951	950.668.738
Barmittel und Bargegenwerte	27.180.236	–	–	–	27.180.236
Margen auf Derivatkontrakte	2.078.380	–	–	–	2.078.380
Forderungen	–	–	–	7.427.155	7.427.155
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>65.933.654</b>	<b>456.281.108</b>	<b>457.677.641</b>	<b>7.462.106</b>	<b>987.354.509</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	206.623	1.295.007	–	605.016	2.106.646
Margen auf Derivatkontrakte	128.275	–	–	–	128.275
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	883.784	883.784
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>334.898</b>	<b>1.295.007</b>	<b>–</b>	<b>1.488.800</b>	<b>3.118.705</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**65.598.756    454.986.101    457.677.641**

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

Die nachfolgende Tabelle fasst das Zinsrisiko für die Gesellschaft zum 31. Dezember 2020 zusammen. Sie enthält die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert, kategorisiert nach vertraglicher Zinsanpassung oder Fälligkeitsterminen, und zwar dem jeweils früheren von beiden:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2020
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	6 Jahre EUR		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	152.491.698	92.273.911	127.192.776	14.773.040	386.731.425
Barmittel und Bargegenwerte	41.679.035	–	–	–	41.679.035
Margen auf Derivatkontrakte	8.566.338	–	–	–	8.566.338
Forderungen	–	–	–	10.508.661	10.508.661
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>202.737.071</b>	<b>92.273.911</b>	<b>127.192.776</b>	<b>25.281.701</b>	<b>447.485.459</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	1.419.338	14.055.434	375.984	2.634.934	18.485.690
Banküberziehung	60	–	–	–	60
Margen auf Derivatkontrakte	454.563	–	–	–	454.563
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	7.947.970	7.947.970
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.873.961</b>	<b>14.055.434</b>	<b>375.984</b>	<b>10.582.904</b>	<b>26.888.283</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>200.863.110</b>	<b>78.218.477</b>	<b>126.816.792</b>		
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2020
	1 Monat GBP	1-3 Monate GBP	3 Monate GBP		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	26.004.349	38.499.077	86.054.551	68.366.035	218.924.012
Barmittel und Bargegenwerte	31.868.987	–	–	–	31.868.987
Margen auf Derivatkontrakte	5.188.797	–	–	–	5.188.797
Forderungen	–	–	–	8.554.480	8.554.480
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>63.062.133</b>	<b>38.499.077</b>	<b>86.054.551</b>	<b>76.920.515</b>	<b>264.536.276</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	20.405	444.453	–	13.600.393	14.065.251
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	9.131.446	9.131.446
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>20.406</b>	<b>444.453</b>	<b>–</b>	<b>22.731.839</b>	<b>23.196.698</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>63.041.727</b>	<b>38.054.624</b>	<b>86.054.551</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	Weniger als 1 Monat EUR	1-3 Monate EUR	Über 3 Monate EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.210.890	9.720.646	22.117.060	3.221.635	39.270.231
Barmittel und Bargegenwerte	218.390	–	–	–	218.390
Margen auf Derivatkontrakte	628.917	–	–	–	628.917
Forderungen	–	–	–	640.764	640.764
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>5.058.197</b>	<b>9.720.646</b>	<b>22.117.060</b>	<b>3.862.399</b>	<b>40.758.302</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.878	18.373	260.829	5.790.125	6.071.205
Banküberziehung	2.129	–	–	–	2.129
Margen auf Derivatkontrakte	522.478	–	–	–	522.478
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	939.470	939.470
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>526.485</b>	<b>18.373</b>	<b>260.829</b>	<b>6.729.595</b>	<b>7.535.282</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>4.531.712</b>	<b>9.702.273</b>	<b>21.856.231</b>		

#### BNY Mellon Dynamic Total Return Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	13.441.216	–	–	1.704.233	15.145.449
Barmittel und Bargegenwerte	2.044.645	–	–	–	2.044.645
Margen auf Derivatkontrakte	116.070	–	–	–	116.070
Forderungen	–	–	–	1	1
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>15.601.931</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.704.234</b>	<b>17.306.165</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	123.086	–	–	144.295	267.381
Banküberziehung	517.446	–	–	–	517.446
Margen auf Derivatkontrakte	137.699	–	–	–	137.699
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	17.569	17.569
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>778.231</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>161.864</b>	<b>940.095</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>14.823.700</b>	<b>–</b>	<b>–</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	43.763.960	–	–	463.063.914	506.827.874
Barmittel und Bargegenwerte	31.795.217	–	–	–	31.795.217
Forderungen	–	–	–	411.762	411.762
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>75.559.177</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>463.475.676</b>	<b>539.034.853</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	998.353	–	–	8.127	1.006.480
Margen auf Derivatkontrakte	70.860	–	–	–	70.860
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.744.671	1.744.671
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.069.213</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.752.798</b>	<b>2.822.011</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>74.489.964</b>	<b>–</b>	<b>–</b>		
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	13.904.028	11.482.975	24.869	25.411.872
Barmittel und Bargegenwerte	500.737	–	–	–	500.737
Margen auf Derivatkontrakte	287.943	–	–	–	287.943
Forderungen	–	–	–	378.052	378.052
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>788.680</b>	<b>13.904.028</b>	<b>11.482.975</b>	<b>402.921</b>	<b>26.578.604</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	43.183	43.183
Margen auf Derivatkontrakte	71.397	–	–	–	71.397
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	128.412	128.412
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>71.397</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>171.595</b>	<b>242.992</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>717.283</b>	<b>13.904.028</b>	<b>11.482.975</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	41.386	20.849.075	21.331.754	992.308	43.214.523
Barmittel und Bargegenwerte	706.906	–	–	–	706.906
Margen auf Derivatkontrakte	283.703	–	–	–	283.703
Forderungen	–	–	–	391.939	391.939
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.031.995</b>	<b>20.849.075</b>	<b>21.331.754</b>	<b>1.384.247</b>	<b>44.597.071</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	44.678	–	–	345.060	389.738
Margen auf Derivatkontrakte	660	–	–	–	660
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	38.584	38.584
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>45.338</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>383.644</b>	<b>428.982</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**986.657    20.849.075    21.331.754**

#### BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.034.553	532.145.136	637.728.138	5.338.922	1.177.246.749
Barmittel und Bargegenwerte	16.666.631	–	–	–	16.666.631
Forderungen	–	–	–	58.148.726	58.148.726
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>18.701.184</b>	<b>532.145.136</b>	<b>637.728.138</b>	<b>63.487.648</b>	<b>1.252.062.106</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	396.547	–	–	49.500	446.047
Margen auf Derivatkontrakte	191.842	–	–	–	191.842
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	48.073.307	48.073.307
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>588.389</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>48.122.807</b>	<b>48.711.196</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**18.112.795    532.145.136    637.728.138**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte					
Vermögenswerte	54.862	401.082.033	334.410.088	9.442.896	744.989.879
Barmittel und Bargegenwerte	14.680.942	–	–	–	14.680.942
Margen auf Derivatkontrakte	2.412.368	–	–	–	2.412.368
Forderungen	–	–	–	14.972.878	14.972.878
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>17.148.172</b>	<b>401.082.033</b>	<b>334.410.088</b>	<b>24.415.774</b>	<b>777.056.067</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten					
Verbindlichkeiten	–	–	–	333.500	333.500
Margen auf Derivatkontrakte	134.822	–	–	–	134.822
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.910.932	5.910.932
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>134.822</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.244.432</b>	<b>6.379.254</b>

**Zinssensitivitätslücke insgesamt** **17.013.350** **401.082.033** **334.410.088**

#### BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte					
Vermögenswerte	–	130.961.678	238.755.919	10.309.826	380.027.423
Barmittel und Bargegenwerte	7.524.437	–	–	–	7.524.437
Margen auf Derivatkontrakte	1.380.000	–	–	–	1.380.000
Forderungen	–	–	–	5.834.782	5.834.782
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>8.904.437</b>	<b>130.961.678</b>	<b>238.755.919</b>	<b>16.144.608</b>	<b>394.766.642</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten					
Verbindlichkeiten	–	228.094	–	1.598.114	1.826.208
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	482.499	482.499
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>228.094</b>	<b>–</b>	<b>2.080.613</b>	<b>2.308.707</b>

**Zinssensitivitätslücke insgesamt** **8.904.437** **130.733.584** **238.755.919**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	435.256	8.310.648	29.046.819	17.292	37.810.015
Barmittel und Bargegenwerte	1.055.348	–	–	–	1.055.348
Margen auf Derivatkontrakte	56.220	–	–	–	56.220
Forderungen	–	–	–	467.836	467.836
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.546.824</b>	<b>8.310.648</b>	<b>29.046.819</b>	<b>485.128</b>	<b>39.389.419</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	31.711	–	–	1.722	33.433
Margen auf Derivatkontrakte	23.417	–	–	–	23.417
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	58.181	58.181
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>55.128</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>59.903</b>	<b>115.031</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>1.491.696</b>	<b>8.310.648</b>	<b>29.046.819</b>
------------------	------------------	-------------------

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	–	37.550.830	126.263.008	1.165.896	164.979.734
Barmittel und Bargegenwerte	1.440.472	–	–	–	1.440.472
Margen auf Derivatkontrakte	503.000	–	–	–	503.000
Forderungen	–	–	–	3.427.724	3.427.724
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.943.472</b>	<b>37.550.830</b>	<b>126.263.008</b>	<b>4.593.620</b>	<b>170.350.930</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	–	–	–	939.928	939.928
Banküberziehung	1.076	–	–	–	1.076
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.741.285	4.741.285
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.076</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.681.213</b>	<b>5.682.289</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>1.942.396</b>	<b>37.550.830</b>	<b>126.263.008</b>
------------------	-------------------	--------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	20.000	7.656.624	20.064.316	69.009	27.809.949
Barmittel und Bargegenwerte	883.156	–	–	–	883.156
Margen auf Derivatkontrakte	78.989	–	–	–	78.989
Forderungen	–	–	–	579.892	579.892
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>982.145</b>	<b>7.656.624</b>	<b>20.064.316</b>	<b>648.901</b>	<b>29.351.986</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	550	–	–	89.046	89.596
Margen auf Derivatkontrakte	8.378	–	–	–	8.378
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	990.021	990.021
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>8.928</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.079.067</b>	<b>1.087.995</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>973.217</b>	<b>7.656.624</b>	<b>20.064.316</b>
----------------	------------------	-------------------

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Weniger als 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.736.978	48.962.924	99.266.772	9.769.646	163.736.320
Barmittel und Bargegenwerte	1.378.019	–	–	–	1.378.019
Margen auf Derivatkontrakte	1.231.209	–	–	–	1.231.209
Forderungen	–	–	–	2.797.283	2.797.283
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>8.346.206</b>	<b>48.962.924</b>	<b>99.266.772</b>	<b>12.566.929</b>	<b>169.142.831</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	2.857.770	2.857.770
Banküberziehung	448	–	–	–	448
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	688.673	688.673
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>448</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.546.443</b>	<b>3.546.891</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>8.345.758</b>	<b>48.962.924</b>	<b>99.266.772</b>
------------------	-------------------	-------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Euroland Bond Fund	Weniger als		Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	18.984.608	82.156.246	314.811.076	15.827.587	431.779.517
Barmittel und Bargegenwerte	12.518.692	–	–	–	12.518.692
Margen auf Derivatkontrakte	1.476.820	–	–	–	1.476.820
Forderungen	–	–	–	5.450.772	5.450.772
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>32.980.120</b>	<b>82.156.246</b>	<b>314.811.076</b>	<b>21.278.359</b>	<b>451.225.801</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	153.163	–	–	633.155	786.318
Banküberziehung	22	–	–	–	22
Margen auf Derivatkontrakte	4.723.319	–	–	–	4.723.319
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.808.026	2.808.026
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>4.876.504</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.441.181</b>	<b>8.317.685</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>28.103.616</b>	<b>82.156.246</b>	<b>314.811.076</b>		
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>					
BNY Mellon European Credit Fund	Weniger als		Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	767.372	17.945.309	19.532.334	2.095.275	40.340.290
Barmittel und Bargegenwerte	1.339.272	–	–	–	1.339.272
Margen auf Derivatkontrakte	867.954	–	–	–	867.954
Forderungen	–	–	–	289.292	289.292
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>2.974.598</b>	<b>17.945.309</b>	<b>19.532.334</b>	<b>2.384.567</b>	<b>42.836.808</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	4.300	112.022	–	8.081	124.403
Margen auf Derivatkontrakte	613.805	–	–	–	613.805
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.599.861	1.599.861
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>618.105</b>	<b>112.022</b>	<b>–</b>	<b>1.607.942</b>	<b>2.338.069</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>2.356.493</b>	<b>17.833.287</b>	<b>19.532.334</b>		



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Bond Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	25.608.647	191.621.397	368.746.690	18.593.619	604.570.353
Barmittel und Bargegenwerte	9.973.908	–	–	–	9.973.908
Margen auf Derivatkontrakte	1.237.172	–	–	–	1.237.172
Forderungen	–	–	–	4.540.460	4.540.460
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>36.819.727</b>	<b>191.621.397</b>	<b>368.746.690</b>	<b>23.134.079</b>	<b>620.321.893</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	13.115	–	–	3.033.181	3.046.296
Banküberziehung	1.196.446	–	–	–	1.196.446
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.195.853	1.195.853
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.209.561</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.229.034</b>	<b>5.438.595</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>35.610.166</b>	<b>191.621.397</b>	<b>368.746.690</b>		
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
	<b>Weniger als</b>		<b>Über</b>	<b>Unver-</b>	<b>Summe</b>
	<b>1 Jahr</b>	<b>1-6 Jahre</b>	<b>6 Jahre</b>	<b>zinslich</b>	<b>2020</b>
	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	13.477.412	357.991.136	402.508.577	17.134.592	791.111.717
Barmittel und Bargegenwerte	18.869.816	–	–	–	18.869.816
Margen auf Derivatkontrakte	7.218.304	–	–	–	7.218.304
Forderungen	–	–	–	5.939.232	5.939.232
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>39.565.532</b>	<b>357.991.136</b>	<b>402.508.577</b>	<b>23.073.824</b>	<b>823.139.069</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.105.231	6.823.006	–	3.014.696	10.942.933
Banküberziehung	793.393	–	–	–	793.393
Margen auf Derivatkontrakte	6.872.987	–	–	–	6.872.987
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.147.952	1.147.952
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>8.771.611</b>	<b>6.823.006</b>	<b>–</b>	<b>4.162.648</b>	<b>19.757.265</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>30.793.921</b>	<b>351.168.130</b>	<b>402.508.577</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	22.535.184	249.152.358	183.184.934	30.186.343	485.058.819
Barmittel und Bargegenwerte	12.334.176	–	–	–	12.334.176
Margen auf Derivatkontrakte	4.106.192	–	–	–	4.106.192
Forderungen	–	–	–	4.125.067	4.125.067
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>38.975.552</b>	<b>249.152.358</b>	<b>183.184.934</b>	<b>34.311.410</b>	<b>505.624.254</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	10.800	–	–	5.173.432	5.184.232
Banküberziehung	1.645.000	–	–	–	1.645.000
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	660.909	660.909
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.655.800</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.834.341</b>	<b>7.490.141</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>37.319.752</b>	<b>249.152.358</b>	<b>183.184.934</b>		
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	67.083.025	81.359.833	550.506	148.993.364
Barmittel und Bargegenwerte	3.903.316	–	–	–	3.903.316
Forderungen	–	–	–	2.901.801	2.901.801
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>3.903.316</b>	<b>67.083.025</b>	<b>81.359.833</b>	<b>3.452.307</b>	<b>155.798.481</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	122.171	122.171
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.252.017	2.252.017
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.374.188</b>	<b>2.374.188</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>3.903.316</b>	<b>67.083.025</b>	<b>81.359.833</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	102.928	1.269.608	2.248.547	16.758.260	20.379.343
Barmittel und Bargegenwerte	446.608	–	–	–	446.608
Forderungen	–	–	–	72.518	72.518
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>549.536</b>	<b>1.269.608</b>	<b>2.248.547</b>	<b>16.830.778</b>	<b>20.898.469</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	126.199	126.199
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	27.545	27.545
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>153.744</b>	<b>153.744</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>549.536</b>	<b>1.269.608</b>	<b>2.248.547</b>		

#### BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	86.220.107	207.268.996	177.045.396	2.410.900.151	2.881.434.650
Barmittel und Bargegenwerte	91.403.260	–	–	–	91.403.260
Margen auf Derivatkontrakte	10.064.465	–	–	–	10.064.465
Forderungen	–	–	–	64.600.301	64.600.301
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>187.687.832</b>	<b>207.268.996</b>	<b>177.045.396</b>	<b>2.475.500.452</b>	<b>3.047.502.676</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	8.313.488	–	–	16.084.605	24.398.093
Banküberziehung	1.203.141	–	–	–	1.203.141
Margen auf Derivatkontrakte	2.809.531	–	–	–	2.809.531
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	92.210.965	92.210.965
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>12.326.160</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>108.295.570</b>	<b>120.621.730</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>175.361.672</b>	<b>207.268.996</b>	<b>177.045.396</b>		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Weniger als		Über 6 Jahre GBP	Unver- zinslich GBP	Summe 2020 GBP
	1 Jahr GBP	1-6 Jahre GBP			
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	1.977.958	4.353.966	3.955.028	50.687.482	60.974.434
Barmittel und Bargegenwerte	2.075.704	–	–	–	2.075.704
Margen auf Derivatkontrakte	198.144	–	–	–	198.144
Forderungen	–	–	–	1.181.292	1.181.292
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>4.251.806</b>	<b>4.353.966</b>	<b>3.955.028</b>	<b>51.868.774</b>	<b>64.429.574</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	185.509	–	–	257.658	443.167
Banküberziehung	898	–	–	–	898
Margen auf Derivatkontrakte	65.415	–	–	–	65.415
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.157.589	1.157.589
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>251.822</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.415.247</b>	<b>1.667.069</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>3.999.984</b>	<b>4.353.966</b>	<b>3.955.028</b>
------------------	------------------	------------------

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Weniger als		Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Summe 2020 USD
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD			

### Vermögenswerte

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Vermögenswerte	9.025.840	23.486.652	17.487.887	241.344.592	291.344.971
Barmittel und Bargegenwerte	11.167.248	–	–	–	11.167.248
Margen auf Derivatkontrakte	4.085.613	–	–	–	4.085.613
Forderungen	–	–	–	536.217	536.217
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>24.278.701</b>	<b>23.486.652</b>	<b>17.487.887</b>	<b>241.880.809</b>	<b>307.134.049</b>

### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle					
Verbindlichkeiten	891.632	–	–	4.790.803	5.682.435
Banküberziehung	11	–	–	–	11
Margen auf Derivatkontrakte	271.606	–	–	–	271.606
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	357.120	357.120
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>1.163.249</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.147.923</b>	<b>6.311.172</b>

### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>23.115.452</b>	<b>23.486.652</b>	<b>17.487.887</b>
-------------------	-------------------	-------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte					
Vermögenswerte	13.565.001	542.173.803	92.099.559	43.485.213	691.323.576
Barmittel und Bargegenwerte	194.717	–	–	–	194.717
Margen auf Derivatkontrakte	13.596.505	–	–	–	13.596.505
Forderungen	–	–	–	10.874.787	10.874.787
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>27.356.223</b>	<b>542.173.803</b>	<b>92.099.559</b>	<b>54.360.000</b>	<b>715.989.585</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten					
Verbindlichkeiten	–	46.988	–	11.621.219	11.668.207
Margen auf Derivatkontrakte	327.110	–	–	–	327.110
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.277.789	2.277.789
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>327.110</b>	<b>46.988</b>	<b>–</b>	<b>13.899.008</b>	<b>14.273.106</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**27.029.113    542.126.815    92.099.559**

#### BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	Weniger als		Über	Unver-	Summe
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre	zinslich	2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte					
Vermögenswerte	60.184	1.763.363	4.050.430	22.735.175	28.609.152
Barmittel und Bargegenwerte	1.459.778	–	–	–	1.459.778
Forderungen	–	–	–	63.387	63.387
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.519.962</b>	<b>1.763.363</b>	<b>4.050.430</b>	<b>22.798.562</b>	<b>30.132.317</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten					
Verbindlichkeiten	–	–	–	128.731	128.731
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	13.427	13.427
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>142.158</b>	<b>142.158</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

**1.519.962    1.763.363    4.050.430**

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

#### BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.756.867	146.211.066	105.475.954	4.971.038	265.414.925
Barmittel und Bargegenwerte	6.404.396	–	–	–	6.404.396
Margen auf Derivatkontrakte	291.146	–	–	–	291.146
Forderungen	–	–	–	6.347.810	6.347.810
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>15.452.409</b>	<b>146.211.066</b>	<b>105.475.954</b>	<b>11.318.848</b>	<b>278.458.277</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	5.487	–	–	2.744.706	2.750.193
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.386.200	4.386.200
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>5.487</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>7.130.906</b>	<b>7.136.393</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>15.446.922</b>	<b>146.211.066</b>	<b>105.475.954</b>
-------------------	--------------------	--------------------

#### BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	Weniger als 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Summe 2020 EUR
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	850.575	1.868.519	2.688.138	27.831.048	33.238.280
Barmittel und Bargegenwerte	835.974	–	–	–	835.974
Margen auf Derivatkontrakte	89.561	–	–	–	89.561
Forderungen	–	–	–	434.379	434.379
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.776.110</b>	<b>1.868.519</b>	<b>2.688.138</b>	<b>28.265.427</b>	<b>34.598.194</b>

#### Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	91.148	–	–	204.318	295.466
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	55.352	55.352
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>91.148</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>259.670</b>	<b>350.818</b>

#### Zinssensitivitätslücke insgesamt

<b>1.684.962</b>	<b>1.868.519</b>	<b>2.688.138</b>
------------------	------------------	------------------

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	Weniger als		Über	Unver- zinslich	Summe 2020
	1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	6 Jahre USD		
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	6.713.169	32.091.138	51.579.791	1.763.033	92.147.131
Barmittel und Bargegenwerte	2.518.429	–	–	–	2.518.429
Margen auf Derivatkontrakte	83	–	–	–	83
Forderungen	–	–	–	607.623	607.623
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>9.231.681</b>	<b>32.091.138</b>	<b>51.579.791</b>	<b>2.370.656</b>	<b>95.273.266</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	48.837	–	–	332.738	381.575
Margen auf Derivatkontrakte	102.845	–	–	–	102.845
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.836.588	1.836.588
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>151.682</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.169.326</b>	<b>2.321.008</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>9.079.999</b>	<b>32.091.138</b>	<b>51.579.791</b>		
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	<b>Weniger als</b>		<b>Über</b>	<b>Unver-</b>	<b>Summe</b>
	<b>1 Jahr</b>	<b>1-6 Jahre</b>	<b>6 Jahre</b>	<b>zinslich</b>	<b>2020</b>
	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.739.222	62.604.894	524.102.820	2.183.004	590.629.940
Barmittel und Bargegenwerte	25.882.480	–	–	–	25.882.480
Forderungen	–	–	–	7.892.636	7.892.636
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>27.621.702</b>	<b>62.604.894</b>	<b>524.102.820</b>	<b>10.075.640</b>	<b>624.405.056</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	77.833	77.833
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	10.410.941	10.410.941
<b>Gesamtverbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>10.488.774</b>	<b>10.488.774</b>
<b>Zinssensitivitätslücke insgesamt</b>	<b>27.621.702</b>	<b>62.604.894</b>	<b>524.102.820</b>		

Bei jenen Fonds, die vorwiegend zinstragende Wertpapiere halten und damit dem Risiko von Schwankungen der jeweils herrschenden Marktzinsen ausgesetzt sind, überwachen die Anlageverwalter täglich das Risiko von Zinsschwankungen, dem die Fonds ausgesetzt sind. Obgleich es sich vorwiegend um eine Anlageentscheidung handelt, verwenden die Anlageverwalter eigene Systeme und Verfahren, um die Fonds optimal zu positionieren und vom Risiko von Schwankungen der vorherrschenden Marktzinsen zu profitieren bzw. dies zu begrenzen.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### ZINSRISIKO Forts.

Die Anlageverwalter werden sich bemühen, an liquiden Märkten zinstragende Wertpapiere zu erwerben. Jedoch werden nicht alle Wertpapiere, in denen die Fonds anlegen, an einer Börse notiert oder von einer Ratingagentur eingestuft sein, weshalb ihre Liquidität möglicherweise gering ist. Überdies können der Erwerb und die Veräußerung einiger Wertpapierbeteiligungen zeitaufwändig sein und müssen unter Umständen zu ungünstigen Kursen erfolgen. Möglicherweise können die Fonds ihre Anlagen aufgrund von widrigen Marktbedingungen und einer dadurch bedingten eingeschränkten Liquidität nicht zu einem angemessenen Preis veräußern. Die Finanzmärkte von Schwellenländern weisen in der Regel eine geringere Liquidität auf als die Finanzmärkte höher entwickelter Länder. Der Erwerb und die Veräußerung von Anlagen können unter Umständen länger dauern, als normalerweise an einem Aktienmarkt in einem Industrieland zu erwarten wäre. Zudem müssen Transaktionen möglicherweise zu ungünstigen Kursen durchgeführt werden.

Die nachfolgende Tabelle veranschaulicht die Auswirkungen eines Anstiegs der Marktzinsen um 25 Basispunkte („Bp.“) an den Hauptmärkten, an denen die aufgeführten Fonds investiert waren.

Bei einem angenommenen Anstieg der Zinsen um 25 Bp. bei ansonsten konstanten Variablen hätte sich der Gesamtertrag der Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 umgehend wie nachfolgend aufgeführt verändert (ein Rückgang um 25 Bp. hätte analoge, aber entgegengesetzte Auswirkungen auf die Gesamterträge der Fonds).

Fonds	Funktionale Währung	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2021	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2020
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	USD	0,928	0,920
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>	USD	1,588	1,638
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	USD	1,508	1,618
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	USD	0,973	0,915
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	USD	1,300	1,300
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	USD	1,200	1,650
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	USD	1,933	2,165
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b> >	USD	k. A.	1,053
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund</b> *>	EUR	k. A.	0,040
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b> >	EUR	k. A.	0,287
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b> >	GBP	k. A.	0,291
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b> >	USD	k. A.	0,292
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>	USD	0,265	0,415
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	USD	0,052	0,079
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b> >	EUR	k. A.	1,033
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b> >	EUR	k. A.	0,262
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund</b> *	EUR	1,148	k. A.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Zu beachten ist, dass künftige Marktbedingungen erheblich abweichen können und die Tabelle nur der Veranschaulichung dient.

Bei Fonds, die den VaR-Ansatz verwenden, wurde die Analyse der Zinsrisikosensitivität bei der Berechnung des Marktpreisrisikos berücksichtigt.

### WÄHRUNGSRISIKO

Das Währungsrisiko wird als das Risiko definiert, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Wechselkursveränderungen schwankt. Das Risiko betrifft Finanzinstrumente, die auf eine andere als die funktionale Währung lauten, in der sie bewertet werden.

Die Anlageverwalter überwachen die Währungsposition der Gesellschaft auf täglicher Basis, und dürfen durch Verwendung von FDI, wie z. B. Devisenterminkontrakte oder Optionen, eingreifen, um das Währungsrisiko der Gesellschaft zu steuern. Die Anlageverwalter von abgesicherten Anteilsklassen, bei denen es sich nicht um die Basisanteilsklasse handelt, dürfen ebenfalls Derivate wie Devisenterminkontrakte oder Optionen als Schlüsselkomponente ihrer Betriebsstrategie verwenden. Aus Finanzinstrumenten, die auf die funktionale Währung lauten, darf kein Währungsrisiko entstehen.



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2021 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
	Australischer Dollar	(1.099.512)	12.655.841	–	–	(13.755.353)
	Brasilianischer Real	(163.687)	3.122.537	–	–	(3.286.224)
	Kanadischer Dollar	1.712.586	566	–	–	1.712.020
	Chilenischer Peso	48.530	1.582.968	–	–	(1.534.438)
	Chinesischer Yuan	86.000	16.397.058	–	–	(16.311.058)
	Kolumbianischer Peso	44.626	1.286.778	–	–	(1.242.152)
	Tschechische Krone	(1.423.430)	24	–	–	(1.423.454)
	Ägyptisches Pfund	2.741.605	2.741.605	–	–	–
	Hongkong-Dollar	39	39	–	–	–
	Ungarischer Forint	883.859	1	–	–	883.858
	Indische Rupie	1.180.737	–	–	–	1.180.737
	Indonesische Rupiah	(1.204.428)	–	–	–	(1.204.428)
	Japanischer Yen	(294.515)	24.510.932	–	–	(24.805.447)
	Kasachischer Tenge	607.118	607.118	–	–	–
	Koreanischer Won	(18.561)	–	–	–	(18.561)
	Mexikanischer Peso	(279.310)	3.856.323	–	–	(4.135.633)
	Neuseeländischer Dollar	148.788	22.332	–	–	126.456
	Norwegische Krone	(3.579)	14.138	–	–	(17.717)
	Polnischer Zloty	(131.637)	–	–	–	(131.637)
	Rumänischer Leu	(53.493)	528.932	–	–	(582.425)
	Russischer Rubel	1.268.185	2.719.569	–	–	(1.451.384)
	Südafrikanischer Rand	80.306	1.372.979	–	–	(1.292.673)
	Pfund Sterling	2.383.940	48.162.168	(247.049)	–	(45.531.179)
	Schwedische Krone	504.453	462	–	–	503.991
	Schweizer Franken	(191.749)	–	–	–	(191.749)
	Thailändischer Baht	911.624	125	–	–	911.499
	US-Dollar	(2.527.078)	92.989.192	(6.328.817)	38.545.235	(127.732.688)
		<b>5.211.417</b>	<b>212.571.687</b>	<b>(6.575.866)</b>	<b>38.545.235</b>	<b>(239.329.639)</b>

### BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Kanadischer Dollar	61.307	61.307	–	–	–
Dänische Krone	136.493	154.893	(18.400)	–	–
Euro	(3.518.927)	3.987.911	(1.960.105)	1.275.598	(6.822.331)
Norwegische Krone	170.879	170.879	–	–	–
Schwedische Krone	17.549	218.250	(200.701)	–	–
Schweizer Franken	2.363.751	249.077	(145.535)	2.260.209	–
US-Dollar	3.287.932	180.212	(76.933)	3.184.653	–
	<b>2.518.984</b>	<b>5.022.529</b>	<b>(2.401.674)</b>	<b>6.720.460</b>	<b>(6.822.331)</b>

### BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	5.017	5.017	–	–	–
Dänische Krone	40.351	40.351	–	–	–
Hongkong-Dollar	205.477	299.350	(93.873)	–	–
Japanischer Yen	117.802	242.232	(124.430)	–	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Forts.</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		54.386	111.916	(57.530)	–	–
Schwedische Krone		4.860	4.860	–	–	–
Schweizer Franken		159.552	1.790.306	(1.630.754)	–	–
US-Dollar		1.884.955	12.343.169	(9.581.011)	–	(877.203)
		<b>2.472.400</b>	<b>14.837.201</b>	<b>(11.487.598)</b>	<b>–</b>	<b>(877.203)</b>

### BNY Mellon Asian Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.209.365	–	–	3.209.365	–
Chinesischer Yuan	9.460.697	–	–	9.460.697	–
Euro	1.700.678	–	(47.055)	1.703.630	44.103
Hongkong-Dollar	12.405.687	–	–	12.405.687	–
Indische Rupie	16.928.641	7.075	(311.766)	17.233.332	–
Indonesische Rupiah	903.771	–	–	903.771	–
Koreanischer Won	4.117.514	–	–	4.117.514	–
Philippinischer Peso	11	–	–	11	–
Taiwan-Dollar	6.511.683	539.902	–	5.971.781	–
	<b>55.238.047</b>	<b>546.977</b>	<b>(358.821)</b>	<b>55.005.788</b>	<b>44.103</b>

### BNY Mellon Asian Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.273.553	–	–	1.273.553	–
Chinesischer Yuan	209.001	–	–	209.001	–
Euro	6.700	17.268	–	–	(10.568)
Hongkong-Dollar	2.584.477	14.468	–	2.570.009	–
Indonesische Rupiah	762.735	–	–	762.735	–
Koreanischer Won	1.631.246	–	–	1.631.246	–
Neuseeländischer Dollar	705.032	–	–	705.032	–
Singapur-Dollar	2.587.372	–	–	2.587.372	–
Pfund Sterling	612.953	–	(327)	612.953	327
Taiwan-Dollar	2.633.758	5.926	–	2.627.832	–
Thailändischer Baht	519.217	–	–	519.217	–
	<b>13.526.044</b>	<b>37.662</b>	<b>(327)</b>	<b>13.498.950</b>	<b>(10.241)</b>

### BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.216.244	41.623	–	3.174.621	–
Kanadischer Dollar	7.254.272	912	–	7.253.360	–
Dänische Krone	2.714.423	11.441	–	2.702.982	–
Euro	7.016.558	3.088	–	7.013.470	–
Hongkong-Dollar	510	510	–	–	–
Japanischer Yen	3.143.068	8.416	–	3.134.652	–
Koreanischer Won	4.572.724	62.657	–	4.510.067	–
Singapur-Dollar	1.018.489	28.971	–	989.518	–
Pfund Sterling	65	65	–	–	–
Schweizer Franken	1.066.885	13.169	–	1.053.716	–
	<b>30.003.238</b>	<b>170.852</b>	<b>–</b>	<b>29.832.386</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Brazil Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	33.209.721	2.216.232	–	30.993.489	–
Euro	538.777	538.777	–	–	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		5.873	5.873	-	-	-
		<b>33.754.371</b>	<b>2.760.882</b>	<b>-</b>	<b>30.993.489</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(1.030.659)	15.516	(27.422)	-	(1.018.753)
Brasilianischer Real		94.338	6.117	-	-	88.221
Kanadischer Dollar		(1.381.004)	41.780	(8)	-	(1.422.776)
Tschechische Krone		522.770	-	-	-	522.770
Euro		(1.255.536)	593.518	(24.805)	-	(1.824.249)
Hongkong-Dollar		(2.451)	15	(2.466)	-	-
Ungarischer Forint		(192.477)	-	-	-	(192.477)
Indische Rupie		2.246.714	-	-	-	2.246.714
Indonesische Rupiah		1.654.374	-	-	-	1.654.374
Israelischer Schekel		257.473	-	-	-	257.473
Japanischer Yen		(1.472.418)	1.565	(24.808)	-	(1.449.175)
Koreanischer Won		(423.739)	462	(15.779)	-	(408.422)
Malaysischer Ringgit		671.383	-	-	-	671.383
Mexikanischer Peso		791.020	-	-	-	791.020
Neuseeländischer Dollar		(136.825)	-	-	-	(136.825)
Norwegische Krone		(623.715)	-	-	-	(623.715)
Philippinischer Peso		864.780	-	-	-	864.780
Polnischer Zloty		(222.190)	-	-	-	(222.190)
Russischer Rubel		720.060	-	-	-	720.060
Singapur-Dollar		(189)	-	(189)	-	-
Südafrikanischer Rand		219.292	8.052	-	-	211.240
Pfund Sterling		(1.187.592)	34.796	(4.573)	-	(1.217.815)
Schwedische Krone		(1.188.126)	18.845	(13)	-	(1.206.958)
Schweizer Franken		(219.895)	-	-	-	(219.895)
		<b>(1.294.612)</b>	<b>720.666</b>	<b>(100.063)</b>	<b>-</b>	<b>(1.915.215)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		6.004.334	141.054	-	-	5.863.280
Pfund Sterling		29.901	29.901	-	-	-
		<b>6.034.235</b>	<b>170.955</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5.863.280</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		(295.788)	38.847.142	-	-	(39.142.930)
Pfund Sterling		(50.925)	4.435.986	-	-	(4.486.911)
		<b>(346.713)</b>	<b>43.283.128</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(43.629.841)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar		(7.856)	827.467	(2.888)	-	(832.435)
Euro		(39.486)	4.743.663	(3.872)	-	(4.779.277)
Japanischer Yen		(314)	-	(314)	-	-
Pfund Sterling		(532)	866.261	-	-	(866.793)
		<b>(48.188)</b>	<b>6.437.391</b>	<b>(7.074)</b>	<b>-</b>	<b>(6.478.505)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>						
Euro		130.943	130.943	-	-	-
Pfund Sterling		337	337	-	-	-
		<b>131.280</b>	<b>131.280</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		770.561	31.380.619	-	-	(30.610.058)
Hongkong-Dollar		1.396	1.396	-	-	-
Kasachischer Tenge		809.477	809.477	-	-	-
Russischer Rubel		3.119.307	3.318.311	-	-	(199.004)
Pfund Sterling		1.090	1.090	-	-	-
Schweizer Franken		(4)	-	(4)	-	-
		<b>4.701.827</b>	<b>35.510.893</b>	<b>(4)</b>	<b>-</b>	<b>(30.809.062)</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		24.078	470.305	-	-	(446.227)
Pfund Sterling		400	400	-	-	-
		<b>24.478</b>	<b>470.705</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(446.227)</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso		525	525	-	-	-
Brasilianischer Real		9.776.406	5.990.963	-	-	3.785.443
Chilenischer Peso		4.404.385	6.559.098	-	-	(2.154.713)
Chinesischer Yuan		11.081.077	18.025.181	-	-	(6.944.104)
Kolumbianischer Peso		6.742.758	9.692.356	-	-	(2.949.598)
Tschechische Krone		3.590.553	2.825.036	-	-	765.517
Euro		29.978	-	(118.027)	-	148.005
Hongkong-Dollar		(3.393.412)	-	-	-	(3.393.412)
Ungarischer Forint		5.697.077	1.892.062	-	-	3.805.015
Indische Rupie		1.702.738	-	-	-	1.702.738
Indonesische Rupiah		8.477.078	8.091.698	-	-	385.380
Malaysischer Ringgit		9.724.083	4.230.735	-	-	5.493.348
Mexikanischer Peso		11.239.291	14.109.632	-	-	(2.870.341)
Peruanischer neuer Sol		1.238.469	1.640.324	-	-	(401.855)
Philippinischer Peso		154.384	-	-	-	154.384
Polnischer Zloty		10.045.445	-	-	-	10.045.445
Rumänischer Leu		1.159.424	560.719	-	-	598.705
Russischer Rubel		10.987.052	13.666.414	-	-	(2.679.362)
Südafrikanischer Rand		9.555.564	13.561.669	-	-	(4.006.105)
Pfund Sterling		22.713	22.713	-	-	-
Schweizer Franken		37	37	-	-	-
Taiwan-Dollar		(2.263.646)	-	-	-	(2.263.646)
Thailändischer Baht		11.589.862	4.153.250	-	-	7.436.612
Türkische Lira		746.836	-	-	-	746.836
Uruguayischer Peso		118.994	118.994	-	-	-
		<b>112.427.671</b>	<b>105.141.406</b>	<b>(118.027)</b>	<b>-</b>	<b>7.404.292</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso		818	818	-	-	-

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
	Brasilianischer Real	1.191.310	863.681	–	–	327.629
	Chilenischer Peso	835.323	1.332.556	–	–	(497.233)
	Chinesischer Yuan	1.366.146	1.967.394	–	–	(601.248)
	Kolumbianischer Peso	1.097.552	831.394	–	–	266.158
	Tschechische Krone	232.963	287.058	–	–	(54.095)
	Euro	(4.350)	356.867	–	–	(361.217)
	Hongkong-Dollar	(982.371)	–	–	–	(982.371)
	Ungarischer Forint	873.475	268.721	–	–	604.754
	Indische Rupie	421.525	–	–	–	421.525
	Indonesische Rupiah	636.645	845.550	–	–	(208.905)
	Malaysischer Ringgit	1.185.376	391.706	–	–	793.670
	Mexikanischer Peso	1.367.220	1.716.426	–	–	(349.206)
	Peruanischer neuer Sol	8.874	245.994	–	–	(237.120)
	Philippinischer Peso	20.023	–	–	–	20.023
	Polnischer Zloty	1.424.483	–	–	–	1.424.483
	Rumänischer Leu	(129.018)	24.086	–	–	(153.104)
	Russischer Rubel	1.660.374	2.298.424	–	–	(638.050)
	Südafrikanischer Rand	1.125.840	1.878.849	–	–	(753.009)
	Pfund Sterling	421	421	–	–	–
	Taiwan-Dollar	(553.352)	–	–	–	(553.352)
	Thailändischer Baht	1.521.496	748.775	–	–	772.721
	Türkische Lira	23.472	–	–	–	23.472
	Uruguayischer Peso	39.755	39.755	–	–	–
		<b>13.364.000</b>	<b>14.098.475</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(734.475)</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
	Brasilianischer Real	3.327.012	6.195.099	–	–	(2.868.087)
	Chilenischer Peso	865.371	3.964.811	–	–	(3.099.440)
	Chinesischer Yuan	4.147.044	2.201.959	–	–	1.945.085
	Kolumbianischer Peso	1.647.822	3.886.934	–	–	(2.239.112)
	Tschechische Krone	(4.107)	431.425	–	–	(435.532)
	Ägyptisches Pfund	4.787.229	4.787.229	–	–	–
	Euro	1.135.672	13.131.720	–	–	(11.996.048)
	Ungarischer Forint	2.939.216	623.456	–	–	2.315.760
	Indische Rupie	1.891.944	–	–	–	1.891.944
	Indonesische Rupiah	1.621.101	743.339	–	–	877.762
	Israelischer Schekel	250	250	–	–	–
	Kasachischer Tenge	485.905	485.905	–	–	–
	Malaysischer Ringgit	3.546.826	1.638.184	(191)	–	1.908.833
	Mexikanischer Peso	4.264.529	7.361.110	–	–	(3.096.581)
	Peruanischer neuer Sol	914.353	914.353	–	–	–
	Polnischer Zloty	3.073.612	34	–	–	3.073.578
	Rumänischer Leu	1.429.540	167	–	–	1.429.373
	Russischer Rubel	4.935.063	5.994.493	–	–	(1.059.430)
	Südafrikanischer Rand	3.510.235	7.379.268	–	–	(3.869.033)
	Pfund Sterling	488	488	–	–	–
	Thailändischer Baht	5.693.585	1.349.687	–	–	4.343.898
	Türkische Lira	739	739	–	–	–
		<b>50.213.429</b>	<b>61.090.650</b>	<b>(191)</b>	<b>–</b>	<b>(10.877.030)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Chinesischer Yuan		20.246	4.107.121	-	-	(4.086.875)
Indische Rupie		(431.615)	-	-	-	(431.615)
Japanischer Yen		1.959	1.959	-	-	-
Mexikanischer Peso		(104.236)	5.033.984	-	-	(5.138.220)
Norwegische Krone		(366.294)	17.395.709	-	-	(17.762.003)
Russischer Rubel		(77.876)	1.480.784	-	-	(1.558.660)
Pfund Sterling		(94.668)	47.854	-	-	(142.522)
Schwedische Krone		(697.549)	-	-	-	(697.549)
Schweizer Franken		3.588	3.588	-	-	-
Taiwan-Dollar		(1.137.134)	-	-	-	(1.137.134)
US-Dollar		215.125	33.412.096	(95.931)	2.426.564	(35.527.604)
		<b>(2.668.454)</b>	<b>61.483.095</b>	<b>(95.931)</b>	<b>2.426.564</b>	<b>(66.482.182)</b>
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		193.181	394	-	-	192.787
US-Dollar		434.825	303.450	(6.052)	1.473.494	(1.336.067)
		<b>628.006</b>	<b>303.844</b>	<b>(6.052)</b>	<b>1.473.494</b>	<b>(1.143.280)</b>
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone		125.442	-	-	125.442	-
Euro		210.723	-	-	210.723	-
Hongkong-Dollar		14.230	-	-	14.230	-
Japanischer Yen		431.601	-	-	431.601	-
Koreanischer Won		65.619	-	-	65.619	-
Norwegische Krone		111.332	-	-	111.332	-
Pfund Sterling		351.075	-	-	351.075	-
		<b>1.310.022</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1.310.022</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		18.572	-	-	18.572	-
Kanadischer Dollar		92.634	-	-	92.634	-
Dänische Krone		133.246	-	-	133.246	-
Euro		527.859	-	-	527.859	-
Hongkong-Dollar		67.173	-	-	67.173	-
Japanischer Yen		166.995	-	-	166.995	-
Mexikanischer Peso		75.356	722	-	74.634	-
Norwegische Krone		146.573	-	-	146.573	-
Pfund Sterling		122.466	-	-	122.466	-
Schweizer Franken		246.629	-	-	246.629	-
		<b>1.597.503</b>	<b>722</b>	<b>-</b>	<b>1.596.781</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		33.081	-	-	33.081	-
Dänische Krone		113.744	-	-	113.744	-
Euro		181.349	-	-	181.349	-
Hongkong-Dollar		101.406	-	-	101.406	-
Japanischer Yen		85.303	-	-	85.303	-
Südafrikanischer Rand		22.032	-	-	22.032	-

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
	Pfund Sterling	231.347	–	–	231.347	–
	Schweizer Franken	327.017	–	–	327.017	–
		<b>1.095.279</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.095.279</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Global Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	7.857.473	15.249.838	–	–	(7.392.365)
Kanadischer Dollar	9.019.659	19.880.257	–	–	(10.860.598)
Kolumbianischer Peso	6.038.346	6.038.346	–	–	–
Tschechische Krone	(189.065)	9.951.584	(754)	–	(10.139.895)
Dänische Krone	1.793.647	5.760.251	–	–	(3.966.604)
Euro	85.578.388	101.752.074	–	–	(16.173.686)
Ungarischer Forint	6.641.449	–	–	–	6.641.449
Indische Rupie	(50.900)	2.219.627	–	–	(2.270.527)
Indonesische Rupiah	(293.244)	6.287.192	–	–	(6.580.436)
Japanischer Yen	86.559.107	32.179.621	–	–	54.379.486
Koreanischer Won	3	–	–	–	3
Malaysischer Ringgit	(53.528)	4.323.281	–	–	(4.376.809)
Mexikanischer Peso	5.774.323	6.876.991	–	–	(1.102.668)
Neuseeländischer Dollar	6.614.435	15.460.797	–	–	(8.846.362)
Philippinischer Peso	(6.414.759)	–	–	–	(6.414.759)
Polnischer Zloty	4.427.926	–	–	–	4.427.926
Südafrikanischer Rand	(6.524.614)	–	–	–	(6.524.614)
Pfund Sterling	24.585.475	15.237.801	–	–	9.347.674
Schwedische Krone	1.028.815	4.140.511	–	–	(3.111.696)
	<b>232.392.936</b>	<b>245.358.171</b>	<b>(754)</b>	<b>–</b>	<b>(12.964.481)</b>

### BNY Mellon Global Credit Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(195.724)	11.271.197	–	–	(11.466.921)
Brasilianischer Real	60.186	611.483	–	–	(551.297)
Kanadischer Dollar	605.010	268.669	–	–	336.341
Chilenischer Peso	5.916	–	–	–	5.916
Chinesischer Yuan	270.956	–	–	–	270.956
Kolumbianischer Peso	60.988	–	–	–	60.988
Tschechische Krone	(73.135)	–	–	–	(73.135)
Euro	(6.793.877)	161.266.539	(8.335.500)	–	(159.724.916)
Ungarischer Forint	7.971	3	–	–	7.968
Indische Rupie	50.407	–	–	–	50.407
Indonesische Rupiah	16.625	–	–	–	16.625
Japanischer Yen	120.484	584.021	–	–	(463.537)
Mexikanischer Peso	(107.912)	7	–	–	(107.919)
Neuseeländischer Dollar	(157.321)	19.710	–	–	(177.031)
Norwegische Krone	260.371	12.761	–	–	247.610
Polnischer Zloty	(63.991)	92	–	–	(64.083)
Russischer Rubel	(474)	–	–	–	(474)
Südafrikanischer Rand	(12.418)	59	–	–	(12.477)
Pfund Sterling	639.788	63.741.131	–	–	(63.101.343)
Schwedische Krone	177.728	–	–	–	177.728
Schweizer Franken	(274.446)	136	–	–	(274.582)
	<b>(5.402.868)</b>	<b>237.775.808</b>	<b>(8.335.500)</b>	<b>–</b>	<b>(234.843.176)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>						
Australischer Dollar		(301.050)	11.245.072	-	-	(11.546.122)
Kanadischer Dollar		(175.901)	28.569.286	-	-	(28.745.187)
Kolumbianischer Peso		5.579.121	5.579.121	-	-	-
Tschechische Krone		(423.788)	8.637.981	-	-	(9.061.769)
Euro		(16.415.959)	87.717.181	-	-	(104.133.140)
Ungarischer Forint		6.600.250	-	-	-	6.600.250
Indische Rupie		(88.382)	3.117.922	-	-	(3.206.304)
Indonesische Rupiah		(294.629)	5.573.776	-	-	(5.868.405)
Japanischer Yen		6.384.640	6.696.264	-	-	(311.624)
Koreanischer Won		(3)	-	-	-	(3)
Malaysischer Ringgit		(39.815)	3.260.921	-	-	(3.300.736)
Mexikanischer Peso		5.742.551	7.140.918	-	-	(1.398.367)
Neuseeländischer Dollar		6.644.275	11.459.580	-	-	(4.815.305)
Philippinischer Peso		(6.433.636)	-	-	-	(6.433.636)
Polnischer Zloty		4.445.117	-	-	-	4.445.117
Südafrikanischer Rand		(6.600.153)	-	-	-	(6.600.153)
Pfund Sterling		(6.670.303)	42.564.131	-	6.620.068	(55.854.502)
Schwedische Krone		219.454	1.703.660	-	-	(1.484.206)
Schweizer Franken		(1)	-	(1)	-	-
		<b>(1.828.212)</b>	<b>223.265.813</b>	<b>(1)</b>	<b>6.620.068</b>	<b>(231.714.092)</b>

### BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	590.098	7.917	-	590.098	(7.917)
Chinesischer Yuan	7.588.545	-	-	7.588.545	-
Euro	1.430.921	-	(3.576)	1.430.921	3.576
Hongkong-Dollar	10.140.030	-	-	10.140.030	-
Ungarischer Forint	509.439	-	(3)	509.442	-
Indische Rupie	13.846.778	69.516	(185.048)	13.962.310	-
Japanischer Yen	1.240.358	-	-	1.240.358	-
Koreanischer Won	2.966.899	-	-	2.966.899	-
Malaysischer Ringgit	409	409	-	-	-
Mexikanischer Peso	884.631	8.476	-	876.155	-
Südafrikanischer Rand	595.960	-	-	595.960	-
Taiwan-Dollar	3.832.177	292.743	-	3.539.434	-
	<b>43.626.245</b>	<b>379.061</b>	<b>(188.627)</b>	<b>43.440.152</b>	<b>(4.341)</b>

### BNY Mellon Global Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	6.457.303	-	-	6.457.303	-
Euro	73.000.437	173.036	-	72.827.401	-
Hongkong-Dollar	18.941.621	-	-	18.941.621	-
Indische Rupie	4.858.344	225	-	4.858.119	-
Japanischer Yen	30.805.605	-	-	30.805.605	-
Koreanischer Won	10.067.267	-	-	10.067.267	-
Pfund Sterling	35.898.836	-	-	35.898.836	-
Schwedische Krone	8.247.163	-	-	8.247.163	-
Schweizer Franken	22.483.145	-	-	22.483.145	-
	<b>210.759.721</b>	<b>173.261</b>	<b>-</b>	<b>210.586.460</b>	<b>-</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		3.827.877	53.555	–	3.774.322	–
Euro		59.914.527	–	(544.528)	59.968.762	490.293
Hongkong-Dollar		9.907.815	164.197	–	9.743.618	–
Japanischer Yen		4.127.328	–	–	4.127.328	–
Koreanischer Won		9.268.104	–	–	9.268.104	–
Pfund Sterling		76.345.244	27.074	–	76.318.170	–
Schwedische Krone		7.709.802	–	–	7.709.802	–
Schweizer Franken		48.023.798	–	–	48.023.798	–
Taiwan-Dollar		1.813	1.813	–	–	–
		<b>219.126.308</b>	<b>246.639</b>	<b>(544.528)</b>	<b>218.933.904</b>	<b>490.293</b>

### BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		608.812	34.673.733	–	–	(34.064.921)
Pfund Sterling		(111.077)	9.301.315	–	–	(9.412.392)
		<b>497.735</b>	<b>43.975.048</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(43.477.313)</b>

### BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar		17.708.884	22.544	–	17.686.340	–
Euro		99.769.037	15.312	–	99.753.725	–
Hongkong-Dollar		5.627.429	27.980	–	5.599.449	–
Israelischer Schekel		1.595	1.595	–	–	–
Norwegische Krone		863	863	–	–	–
Singapur-Dollar		376.631	376.631	–	–	–
Pfund Sterling		10.922.392	559	–	10.921.833	–
		<b>134.406.831</b>	<b>445.484</b>	<b>–</b>	<b>133.961.347</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Global Leaders Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		2.430.773	–	–	2.430.773	–
Dänische Krone		3.086.481	–	–	3.086.481	–
Euro		9.836.452	–	–	9.836.452	–
Hongkong-Dollar		4.335.799	–	–	4.335.799	–
Japanischer Yen		3.893.123	–	–	3.893.123	–
Pfund Sterling		369.186	369.186	–	–	–
Schweizer Franken		2.788.052	–	–	2.788.052	–
		<b>26.739.866</b>	<b>369.186</b>	<b>–</b>	<b>26.370.680</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Global Opportunities Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone		531.933	–	–	531.933	–
Euro		5.218.877	79.412	–	5.139.465	–
Hongkong-Dollar		1.053.958	–	–	1.053.958	–
Indische Rupie		645.133	–	–	645.133	–
Japanischer Yen		2.700.131	–	–	2.700.131	–
Koreanischer Won		773.642	–	–	773.642	–
Malaysischer Ringgit		1	1	–	–	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		3.199.519	–	–	3.199.519	–
Schwedische Krone		689.990	–	–	689.990	–
Schweizer Franken		1.829.076	–	–	1.829.076	–
		<b>16.642.260</b>	<b>79.413</b>	<b>–</b>	<b>16.562.847</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	51.519.309	–	–	16.182.426	35.336.883
Chinesischer Yuan	16.810.648	–	–	16.810.648	–
Dänische Krone	33.236.724	–	–	33.236.724	–
Hongkong-Dollar	17.550.005	391.627	–	76.119.019	(58.960.641)
Ungarischer Forint	60.835.708	–	–	–	60.835.708
Indische Rupie	26.946.783	4.330.873	–	22.615.910	–
Japanischer Yen	(7.125.210)	5.557.554	–	81.860.777	(94.543.541)
Koreanischer Won	23.691.757	–	–	23.691.757	–
Norwegische Krone	11.209.716	–	–	11.209.716	–
Russischer Rubel	23.206.326	–	–	–	23.206.326
Pfund Sterling	50.528.000	16.627.532	–	509.063.663	(475.163.195)
Schwedische Krone	41.857.260	–	(11)	–	41.857.271
Schweizer Franken	6.637.857	–	–	66.802.975	(60.165.118)
US-Dollar	287.473.151	193.309.664	(18.441.377)	1.258.922.413	(1.146.317.549)
	<b>644.378.034</b>	<b>220.217.250</b>	<b>(18.441.388)</b>	<b>2.116.516.028</b>	<b>(1.673.913.856)</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Australischer Dollar	832.711	–	–	–	832.711
Chinesischer Yuan	326.267	–	–	326.267	–
Dänische Krone	23.121	–	–	722.169	(699.048)
Euro	1.642.871	2.031.228	(53.116)	8.261.993	(8.597.234)
Hongkong-Dollar	(58.491)	6.682	–	1.422.311	(1.487.484)
Ungarischer Forint	544.344	–	–	–	544.344
Indische Rupie	594.097	101.169	–	492.928	–
Japanischer Yen	(46.640)	98.819	–	1.682.065	(1.827.524)
Koreanischer Won	(59.685)	–	–	491.842	(551.527)
Neuseeländischer Dollar	(1)	–	(1)	–	–
Norwegische Krone	224.899	–	–	224.899	–
Russischer Rubel	470.319	–	–	–	470.319
Schweizer Franken	382.131	–	–	1.422.599	(1.040.468)
US-Dollar	4.514.394	2.793.535	(370.344)	25.717.995	(23.626.792)
	<b>9.390.337</b>	<b>5.031.433</b>	<b>(423.461)</b>	<b>40.765.068</b>	<b>(35.982.703)</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.236.276	–	–	1.236.276	–
Chinesischer Yuan	(27.499)	–	–	2.082.938	(2.110.437)
Dänische Krone	710.890	–	–	5.344.629	(4.633.739)
Euro	(19.506.674)	11.758.408	(354.812)	53.872.419	(84.782.689)
Hongkong-Dollar	659.260	40.213	–	9.111.945	(8.492.898)
Indische Rupie	(277.756)	405.237	–	3.019.964	(3.702.957)
Japanischer Yen	(4.985.130)	640.422	–	10.885.248	(16.510.800)
Koreanischer Won	3.316.789	–	–	3.316.789	–
Norwegische Krone	1.508.650	–	–	1.508.650	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Russischer Rubel		2.975.399	–	–	–	2.975.399
Pfund Sterling		(2.084.971)	2.075.217	–	62.446.156	(66.606.344)
Schweizer Franken		237.958	–	–	10.019.374	(9.781.416)
		<b>(16.236.808)</b>	<b>14.919.497</b>	<b>(354.812)</b>	<b>162.844.388</b>	<b>(193.645.881)</b>

### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(98.446)	9.795.718	–	–	(9.894.164)
Euro		2.787.146	358.532.589	–	–	(355.745.443)
Pfund Sterling		(472.335)	79.817.510	–	–	(80.289.845)
Schwedische Krone		96	96	–	–	–
Schweizer Franken		482	482	–	–	–
		<b>2.216.943</b>	<b>448.146.395</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(445.929.452)</b>

### BNY Mellon Global Unconstrained Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		202.980	535.292	–	177.681	(509.993)
Kolumbianischer Peso		148.726	148.726	–	–	–
Dänische Krone		199.331	–	–	199.331	–
Euro		2.377.779	778.539	–	2.116.747	(517.507)
Hongkong-Dollar		924.368	–	–	924.368	–
Japanischer Yen		1.805.065	103.912	–	1.909.503	(208.350)
Koreanischer Won		431.210	–	–	431.210	–
Mexikanischer Peso		298.010	298.010	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		171.060	307.814	–	142.631	(279.385)
Pfund Sterling		4.159.932	2.102	–	5.183.330	(1.025.500)
Schweizer Franken		1.081.751	–	–	1.081.751	–
Thailändischer Baht		121.785	–	–	121.785	–
		<b>11.921.997</b>	<b>2.174.395</b>	<b>–</b>	<b>12.288.337</b>	<b>(2.540.735)</b>

### BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

		JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Euro		11.944.583	11.944.583	–	–	–
Pfund Sterling		141.445.557	141.445.557	–	–	–
US-Dollar		70.904.524	70.904.524	–	–	–
		<b>224.294.664</b>	<b>224.294.664</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		31.626.987	1	–	31.626.986	–
Kanadischer Dollar		55.090.830	57.181	–	55.033.649	–
Dänische Krone		48.942.572	–	–	48.942.572	–
Hongkong-Dollar		27.386.509	–	–	27.386.509	–
Japanischer Yen		126.833.204	–	–	126.833.204	–
Singapur-Dollar		561.191	561.191	–	–	–
Pfund Sterling		91.567.066	355.629	–	91.211.437	–
Schweizer Franken		92.625.484	–	–	92.625.484	–
US-Dollar		989.332.928	26.507.158	–	962.944.588	(118.818)
		<b>1.463.966.771</b>	<b>27.481.160</b>	<b>–</b>	<b>1.436.604.429</b>	<b>(118.818)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		2	2	-	-	-
Chinesischer Yuan		12.592.324	125.790	-	12.466.534	-
Euro		152.092.851	3.376.563	-	148.716.288	-
Hongkong-Dollar		17.315.867	137.728	-	17.178.139	-
Japanischer Yen		62.467.791	808.063	-	61.659.728	-
Koreanischer Won		30.379.111	177.215	-	30.201.896	-
Singapur-Dollar		189.232	189.232	-	-	-
Pfund Sterling		287.128	287.128	-	-	-
Schweizer Franken		19.541.016	119.406	-	19.421.610	-
Taiwan-Dollar		29.512.812	884.392	-	28.628.420	-
		<b>324.378.134</b>	<b>6.105.519</b>	<b>-</b>	<b>318.272.615</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone		473.596	10.278	-	463.318	-
Norwegische Krone		34.429	34.429	-	-	-
Pfund Sterling		445.728	445.728	-	-	-
Schwedische Krone		2.132.167	31.432	-	2.100.735	-
Schweizer Franken		3.921	3.921	-	-	-
US-Dollar		1.241.222	84.496	-	1.156.726	-
		<b>4.331.063</b>	<b>610.284</b>	<b>-</b>	<b>3.720.779</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		390.568	1.491	-	389.077	-
Pfund Sterling		225.123	2	-	225.121	-
Schweizer Franken		292.720	2.879	-	289.841	-
		<b>908.411</b>	<b>4.372</b>	<b>-</b>	<b>904.039</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(36.909)	14.155.896	-	-	(14.192.805)
Kanadischer Dollar		(125.992)	21.638.651	-	-	(21.764.643)
Kolumbianischer Peso		4.254.731	5.782.363	-	-	(1.527.632)
Tschechische Krone		(322.900)	7.971.697	-	-	(8.294.597)
Ungarischer Forint		4.929.853	-	-	-	4.929.853
Indische Rupie		(80.373)	3.086.932	-	-	(3.167.305)
Indonesische Rupiah		(190.758)	4.819.858	-	-	(5.010.616)
Japanischer Yen		4.885.770	6.402.803	-	-	(1.517.033)
Koreanischer Won		1	-	-	-	1
Malaysischer Ringgit		(27.836)	3.276.698	(1)	-	(3.304.533)
Mexikanischer Peso		3.979.898	5.322.497	-	-	(1.342.599)
Neuseeländischer Dollar		4.967.049	8.512.490	-	-	(3.545.441)
Norwegische Krone		(9.883)	4.182.119	-	-	(4.192.002)
Philippinischer Peso		(4.822.752)	-	-	-	(4.822.752)
Polnischer Zloty		3.373.143	-	-	-	3.373.143
Südafrikanischer Rand		(4.978.293)	-	-	-	(4.978.293)
Pfund Sterling		(5.090.128)	41.236.786	-	-	(46.326.914)
Schwedische Krone		(34.892)	2.207.625	-	-	(2.242.517)
US-Dollar		28.304	97.018.065	-	-	(96.989.761)
		<b>10.698.033</b>	<b>225.614.480</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>(214.916.446)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		821.413	–	–	–	821.413
Chinesischer Yuan		1.082.114	–	–	1.082.114	–
Dänische Krone		869.999	–	–	869.999	–
Hongkong-Dollar		77.693	8.986	–	2.090.397	(2.021.690)
Ungarischer Forint		1.465.344	–	–	99.207	1.366.137
Indonesische Rupiah		125.927	–	–	125.927	–
Japanischer Yen		(201.326)	127.546	–	2.262.105	(2.590.977)
Koreanischer Won		532.005	–	–	532.005	–
Norwegische Krone		286.471	–	–	286.471	–
Südafrikanischer Rand		69.404	–	–	69.404	–
Pfund Sterling		867.760	1.160.842	–	16.248.952	(16.542.034)
Schwedische Krone		967.631	–	–	–	967.631
Schweizer Franken		193.888	–	–	1.927.041	(1.733.153)
Taiwan-Dollar		684.387	46.512	–	637.875	–
US-Dollar		6.618.073	2.369.422	(421.967)	27.323.739	(22.653.121)
		<b>14.460.783</b>	<b>3.713.308</b>	<b>(421.967)</b>	<b>53.555.236</b>	<b>(42.385.794)</b>
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		73.035	34.911	(5.381)	–	43.505
Kanadischer Dollar		222.038	114.801	(2.671)	–	109.908
Euro		(1.137.535)	32.796.268	(5.673)	–	(33.928.130)
Indische Rupie		(140.442)	–	–	–	(140.442)
Japanischer Yen		(5.064)	1.372.309	–	–	(1.377.373)
Koreanischer Won		(42.744)	1.031.512	–	–	(1.074.256)
Mexikanischer Peso		(60.273)	2.845.846	–	–	(2.906.119)
Russischer Rubel		(19.515)	1.451.277	–	–	(1.470.792)
Pfund Sterling		57.739	3.109.590	–	–	(3.051.851)
Schwedische Krone		(218.591)	–	–	–	(218.591)
Taiwan-Dollar		(381.549)	–	–	–	(381.549)
		<b>(1.652.901)</b>	<b>42.756.514</b>	<b>(13.725)</b>	<b>–</b>	<b>(44.395.690)</b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		595.145	595.145	–	–	–
Pfund Sterling		1.156.931	1.156.931	–	–	–
		<b>1.752.076</b>	<b>1.752.076</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		1.259.374	1.259.374	–	–	–
Pfund Sterling		9.491	9.491	–	–	–
		<b>1.268.865</b>	<b>1.268.865</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		(173.922)	13.061.767	–	–	(13.235.689)
US-Dollar		303.383	11.446.771	(96.334)	–	(11.047.054)
		<b>129.461</b>	<b>24.508.538</b>	<b>(96.334)</b>	<b>–</b>	<b>(24.282.743)</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2020 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		1.336.734	16.381.732	–	–	(15.044.998)
Brasilianischer Real		625.405	3.277.496	–	–	(2.652.091)
Kanadischer Dollar		69.517	69.517	–	–	–
Chinesischer Yuan		3.095.142	–	–	–	3.095.142
Kolumbianischer Peso		(138.793)	2.532.308	–	–	(2.671.101)
Ägyptisches Pfund		2.128.251	2.128.251	–	–	–
Hongkong-Dollar		36	36	–	–	–
Indische Rupie		2.720.383	–	–	–	2.720.383
Indonesische Rupiah		1.137.272	3.622.277	(60)	–	(2.484.945)
Japanischer Yen		1.469.882	11.264.391	–	–	(9.794.509)
Koreanischer Won		1.604.199	–	–	–	1.604.199
Malaysischer Ringgit		1.368.164	1.368.164	–	–	–
Mexikanischer Peso		1.465.632	2.280.595	–	–	(814.963)
Neuseeländischer Dollar		32.191	21.822	–	–	10.369
Norwegische Krone		59	59	–	–	–
Polnischer Zloty		75	75	–	–	–
Rumänischer Leu		(17.936)	1.727.109	–	–	(1.745.045)
Russischer Rubel		(18.191)	2.640.342	–	–	(2.658.533)
Südafrikanischer Rand		4.060	228.062	–	–	(224.002)
Pfund Sterling		322.316	34.333.066	(97.513)	–	(33.913.237)
Schwedische Krone		472	472	–	–	–
Thailändischer Baht		128	128	–	–	–
Türkische Lira		593.360	–	–	–	593.360
Ukrainische Hrywnja		78.900	78.900	–	–	–
US-Dollar		(18.448.328)	94.185.129	(5.360.812)	–	(107.272.645)
		<b>(571.070)</b>	<b>176.139.931</b>	<b>(5.458.385)</b>	<b>–</b>	<b>(171.252.616)</b>

### BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Dänische Krone	(45.919)	534.095	(96.471)	–	(483.543)
Euro	(8.738.670)	8.526.789	(4.994.576)	–	(12.270.883)
Norwegische Krone	(1)	–	(1)	–	–
Schwedische Krone	(391.894)	364.079	(397.146)	–	(358.827)
Schweizer Franken	2.227.379	1.270.472	(753.963)	2.542.827	(831.957)
US-Dollar	8.434.850	–	–	8.434.850	–
	<b>1.485.745</b>	<b>10.695.435</b>	<b>(6.242.157)</b>	<b>10.977.677</b>	<b>(13.945.210)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone		(59.367)	1.186	(60.553)	–	–
Hongkong-Dollar		18.229	108.521	(90.292)	–	–
Japanischer Yen		23.200	222.097	(198.897)	–	–
Pfund Sterling		82.445	82.445	–	–	–
Schweizer Franken		78.144	125.100	(46.956)	–	–
US-Dollar		1.626.974	8.488.494	(5.062.067)	–	(1.799.453)
		<b>1.769.625</b>	<b>9.027.843</b>	<b>(5.458.765)</b>	<b>–</b>	<b>(1.799.453)</b>

### BNY Mellon Asian Equity Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		4.752.406	–	–	4.693.043	59.363
Euro		753.452	2.092	–	1.027.154	(275.794)
Hongkong-Dollar		17.613.584	–	–	17.595.504	18.080
Indische Rupie		18.251.853	233.408	–	18.018.445	–
Indonesische Rupiah		1.223.612	–	–	1.223.612	–
Koreanischer Won		5.491.493	–	–	5.491.493	–
Taiwan-Dollar		3.843.121	44.799	–	3.798.322	–
		<b>51.929.521</b>	<b>280.299</b>	<b>–</b>	<b>51.847.573</b>	<b>(198.351)</b>

### BNY Mellon Asian Income Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		4.159.415	–	–	4.159.415	–
Euro		(4.153)	14.236	–	–	(18.389)
Hongkong-Dollar		6.091.921	30.148	–	6.091.921	(30.148)
Indonesische Rupiah		1.056.407	–	–	1.056.407	–
Koreanischer Won		4.980.687	–	–	4.980.687	–
Neuseeländischer Dollar		2.345.052	–	–	2.345.052	–
Singapur-Dollar		7.776.190	11.674	–	7.801.117	(36.601)
Pfund Sterling		1.020.085	–	–	1.020.085	–
Taiwan-Dollar		5.106.938	99.465	–	5.007.473	–
Thailändischer Baht		1.335.382	–	–	1.335.382	–
		<b>33.867.924</b>	<b>155.523</b>	<b>–</b>	<b>33.797.539</b>	<b>(85.138)</b>

### BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		266.207	4.615	–	261.592	–
Kanadischer Dollar		895	895	–	–	–
Dänische Krone		420.782	2.500	–	418.282	–
Euro		1.292.945	9.190	–	1.283.755	–
Hongkong-Dollar		509.997	513	–	509.484	–
Japanischer Yen		119.292	847	–	118.445	–
Koreanischer Won		2.738	2.738	–	–	–
Singapur-Dollar		207.074	3.707	–	203.367	–
Pfund Sterling		66	66	–	–	–
Schweizer Franken		659.857	3.310	–	656.547	–
		<b>3.479.853</b>	<b>28.381</b>	<b>–</b>	<b>3.451.472</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Brazil Equity Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real		51.256.484	641.426	–	50.615.058	–
Euro		2.012.914	2.012.914	–	–	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		931.765	931.765	-	-	-
		<b>54.201.163</b>	<b>3.586.105</b>	<b>-</b>	<b>50.615.058</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(673.606)	7.399	(7.103)	-	(673.902)
Kanadischer Dollar		(594.335)	1.179	(15.117)	-	(580.397)
Euro		(1.656.444)	556.529	(524.469)	-	(1.688.504)
Hongkong-Dollar		(31.886)	12	(31.898)	-	-
Japanischer Yen		24.420	2	(14.417)	-	38.835
Neuseeländischer Dollar		(165.077)	-	-	-	(165.077)
Norwegische Krone		(417.187)	-	-	-	(417.187)
Pfund Sterling		2.297.111	548	(47.514)	-	2.344.077
Schwedische Krone		(507.252)	-	-	-	(507.252)
Schweizer Franken		(64.074)	13.251	(14)	-	(73.311)
		<b>(1.788.330)</b>	<b>578.920</b>	<b>(640.532)</b>	<b>-</b>	<b>(1.726.718)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		111.552	111.552	-	-	-
Pfund Sterling		1	1	-	-	-
		<b>111.553</b>	<b>111.553</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		15.576	5.422.820	-	-	(5.407.244)
Pfund Sterling		(4.069)	309.116	-	-	(313.185)
		<b>11.507</b>	<b>5.731.936</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(5.720.429)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		254	254	-	-	-
Kanadischer Dollar		1.279	1.703.311	(1.899)	-	(1.700.133)
Euro		(59.539)	10.472.796	(26)	-	(10.532.309)
Japanischer Yen		(449)	-	(449)	-	-
Pfund Sterling		8.854	2.074.510	-	-	(2.065.656)
		<b>(49.601)</b>	<b>14.250.871</b>	<b>(2.374)</b>	<b>-</b>	<b>(14.298.098)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		265.276	265.276	-	-	-
Pfund Sterling		341	341	-	-	-
		<b>265.617</b>	<b>265.617</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Kolumbianischer Peso		(54.554)	5.272.388	-	-	(5.326.942)
Euro		2.692.637	36.134.827	-	-	(33.442.190)
Hongkong-Dollar		44.836	44.836	-	-	-
Kasachischer Tenge		817.262	817.262	-	-	-



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Russischer Rubel		(16.609)	3.654.595	–	–	(3.671.204)
Pfund Sterling		1.790	1.790	–	–	–
Schweizer Franken		89.255	89.255	–	–	–
		<b>3.574.617</b>	<b>46.014.953</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(42.440.336)</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	17.334	545.116	(183)	–	(527.599)
Pfund Sterling	404	404	–	–	–
	<b>17.738</b>	<b>545.520</b>	<b>(183)</b>	<b>–</b>	<b>(527.599)</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso	642	642	–	–	–
Brasilianischer Real	15.142.530	8.766.329	–	–	6.376.201
Chilenischer Peso	8.058.769	9.082.334	–	–	(1.023.565)
Chinesischer Yuan	15.432.896	22.162.154	–	–	(6.729.258)
Kolumbianischer Peso	12.984.494	15.173.998	–	–	(2.189.504)
Tschechische Krone	11.329.865	234.438	–	–	11.095.427
Dominikanischer Peso	259.330	259.330	–	–	–
Euro	(2.922.524)	6.729	–	–	(2.929.253)
Hongkong-Dollar	(11.932.220)	–	–	–	(11.932.220)
Ungarischer Forint	6.712.424	1.440.558	–	–	5.271.866
Indische Rupie	1.745.119	2.911.257	–	–	(1.166.138)
Indonesische Rupiah	15.902.939	16.771.781	–	–	(868.842)
Malaysischer Ringgit	12.280.021	3.895.724	(1.076)	–	8.385.373
Mexikanischer Peso	19.468.213	27.328.492	–	–	(7.860.279)
Peruanischer neuer Sol	4.585.890	2.612.987	–	–	1.972.903
Philippinischer Peso	(3.134.430)	–	–	–	(3.134.430)
Polnischer Zloty	18.990.293	3.247.743	–	–	15.742.550
Rumänischer Leu	2.581.984	1.901.868	–	–	680.116
Russischer Rubel	20.067.662	20.484.938	–	–	(417.276)
Südafrikanischer Rand	12.938.110	20.850.831	–	–	(7.912.721)
Pfund Sterling	6.469	6.469	–	–	–
Schweizer Franken	38	38	–	–	–
Taiwan-Dollar	(3.488.560)	–	–	–	(3.488.560)
Thailändischer Baht	17.984.911	7.213.536	–	–	10.771.375
Türkische Lira	2.863.576	–	–	–	2.863.576
Uruguayischer Peso	626.063	626.063	–	–	–
	<b>178.484.504</b>	<b>164.978.239</b>	<b>(1.076)</b>	<b>–</b>	<b>13.507.341</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso	999	999	–	–	–
Brasilianischer Real	1.301.094	918.387	–	–	382.707
Chilenischer Peso	929.087	1.002.842	–	–	(73.755)
Chinesischer Yuan	1.262.632	1.584.020	–	–	(321.388)
Kolumbianischer Peso	1.249.032	1.135.823	–	–	113.209
Tschechische Krone	1.374.993	–	–	–	1.374.993
Euro	(711.387)	285.424	(550)	–	(996.261)
Hongkong-Dollar	(988.117)	–	–	–	(988.117)
Ungarischer Forint	453.432	184.654	–	–	268.778

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Indische Rupie		293.015	208.758	-	-	84.257
Indonesische Rupiah		1.312.222	1.777.443	-	-	(465.221)
Malaysischer Ringgit		998.952	282.061	-	-	716.891
Mexikanischer Peso		1.830.582	2.474.557	-	-	(643.975)
Peruanischer neuer Sol		321.841	194.735	-	-	127.106
Philippinischer Peso		(410.918)	-	-	-	(410.918)
Polnischer Zloty		1.791.421	-	-	-	1.791.421
Rumänischer Leu		111.933	54.423	-	-	57.510
Russischer Rubel		2.347.331	2.182.458	-	-	164.873
Südafrikanischer Rand		1.038.820	1.619.200	-	-	(580.380)
Pfund Sterling		425	425	-	-	-
Taiwan-Dollar		(600.887)	-	-	-	(600.887)
Thailändischer Baht		1.508.830	784.440	-	-	724.390
Türkische Lira		184.451	-	-	-	184.451
Uruguayischer Peso		90.922	90.922	-	-	-
		<b>15.690.705</b>	<b>14.781.571</b>	<b>(550)</b>	<b>-</b>	<b>909.684</b>

### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real		6.686.837	10.691.355	-	-	(4.004.518)
Chilenischer Peso		1.505.855	-	-	-	1.505.855
Chinesischer Yuan		4.917.306	-	-	-	4.917.306
Kolumbianischer Peso		3.093.939	7.650.910	-	-	(4.556.971)
Tschechische Krone		1.561.658	32	-	-	1.561.626
Ägyptisches Pfund		5.376.527	5.376.527	-	-	-
Euro		861.053	10.667.048	-	-	(9.805.995)
Ungarischer Forint		2.349.307	3	-	-	2.349.304
Indonesische Rupiah		6.983.773	13.125.634	(258)	-	(6.141.603)
Israelischer Schekel		242	242	-	-	-
Kasachischer Tenge		490.753	490.753	-	-	-
Koreanischer Won		2.115.400	-	-	-	2.115.400
Malaysischer Ringgit		4.032.732	4.032.922	(190)	-	-
Mexikanischer Peso		9.780.737	8.833.871	-	-	946.866
Peruanischer neuer Sol		1.565.815	791.154	-	-	774.661
Polnischer Zloty		4.568.101	238	-	-	4.567.863
Rumänischer Leu		151.637	4.926.365	-	-	(4.774.728)
Russischer Rubel		4.172.812	7.715.639	-	-	(3.542.827)
Südafrikanischer Rand		4.223.822	5.828.638	-	-	(1.604.816)
Pfund Sterling		865	865	-	-	-
Thailändischer Baht		4.912.344	2.400.212	-	-	2.512.132
Türkische Lira		2.925.617	-	-	-	2.925.617
Ukrainische Hrywnja		324.004	324.004	-	-	-
		<b>72.601.136</b>	<b>82.856.412</b>	<b>(448)</b>	<b>-</b>	<b>(10.254.828)</b>

### BNY Mellon Euroland Bond Fund

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(1.673.645)	11.338.147	-	-	(13.011.792)
Kanadischer Dollar		(1.025.185)	-	(22)	-	(1.025.163)
Chilenischer Peso		2.277.540	-	-	-	2.277.540
Tschechische Krone		2.209.273	-	-	-	2.209.273
Indische Rupie		4.393.455	-	-	-	4.393.455
Japanischer Yen		(129.347)	248.762	-	-	(378.109)
Koreanischer Won		(281.954)	287.417	-	-	(569.371)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Mexikanischer Peso		2.334.310	6.714.994	–	–	(4.380.684)
Neuseeländischer Dollar		(1.756.708)	9.359	–	–	(1.766.067)
Norwegische Krone		(1.816.227)	4.119	–	–	(1.820.346)
Polnischer Zloty		2.172.995	–	–	–	2.172.995
Russischer Rubel		8.874.189	3.320.386	–	–	5.553.803
Südafrikanischer Rand		156.733	4.043.648	–	–	(3.886.915)
Pfund Sterling		6.136.691	525.349	–	–	5.611.342
Schwedische Krone		(2.170.456)	238	–	–	(2.170.694)
Schweizer Franken		1.718.924	3.441	–	–	1.715.483
Thailändischer Baht		389.291	–	–	–	389.291
US-Dollar		(17.319.251)	55.556.882	(79.973)	15.230.641	(88.026.801)
		<b>4.490.628</b>	<b>82.052.742</b>	<b>(79.995)</b>	<b>15.230.641</b>	<b>(92.712.760)</b>

### BNY Mellon European Credit Fund

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		178.659	465.397	–	–	(286.738)
US-Dollar		472.817	512.058	–	2.007.896	(2.047.137)
		<b>651.476</b>	<b>977.455</b>	<b>–</b>	<b>2.007.896</b>	<b>(2.333.875)</b>

### BNY Mellon Global Bond Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		11.263.118	39.662.148	–	–	(28.399.030)
Kanadischer Dollar		10.218.517	22.974.670	–	–	(12.756.153)
Kolumbianischer Peso		5.270.743	5.270.743	–	–	–
Tschechische Krone		(156.743)	6.745.774	–	–	(6.902.517)
Dänische Krone		2.262.954	11.821.549	–	–	(9.558.595)
Euro		152.339.419	138.407.896	(1.209.560)	–	15.141.083
Indische Rupie		6.070.572	–	–	–	6.070.572
Indonesische Rupiah		5.869.377	5.869.377	–	–	–
Japanischer Yen		129.728.882	53.863.977	–	–	75.864.905
Malaysischer Ringgit		4.293.537	8.432.273	–	–	(4.138.736)
Mexikanischer Peso		9.917.537	9.917.537	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		(81.074)	18.644.966	–	–	(18.726.040)
Norwegische Krone		51.415	6.820.313	–	–	(6.768.898)
Peruanischer neuer Sol		4.350.439	4.350.439	–	–	–
Philippinischer Peso		150.937	6.013.831	–	–	(5.862.894)
Pfund Sterling		47.202.917	31.726.584	–	–	15.476.333
Schwedische Krone		1.518.902	7.263.461	–	–	(5.744.559)
		<b>390.271.449</b>	<b>377.785.538</b>	<b>(1.209.560)</b>	<b>–</b>	<b>13.695.471</b>

### BNY Mellon Global Credit Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		1.661.414	8.602.512	–	–	(6.941.098)
Brasilianischer Real		(45.509)	754.694	–	–	(800.203)
Kanadischer Dollar		62.859	62.859	–	–	–
Chinesischer Yuan		2.781.420	–	–	–	2.781.420
Euro		94.591	212.906.852	(5.259.335)	–	(207.552.926)
Indische Rupie		2.785.007	–	–	–	2.785.007
Indonesische Rupiah		214.718	165.906	–	–	48.812
Japanischer Yen		1.410.812	2.630.389	(2.518)	–	(1.217.059)
Koreanischer Won		1.663.397	–	–	–	1.663.397
Mexikanischer Peso		342.283	1.516.611	–	–	(1.174.328)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
	Neuseeländischer Dollar	23.981	20.706	-	-	3.275
	Polnischer Zloty	100	100	-	-	-
	Südafrikanischer Rand	63	63	-	-	-
	Pfund Sterling	2.282.661	79.712.574	(16.829)	-	(77.413.084)
	Schwedische Krone	21.401	21.401	-	-	-
	Schweizer Franken	140	140	-	-	-
		<b>13.299.338</b>	<b>306.394.807</b>	<b>(5.278.682)</b>	<b>-</b>	<b>(287.816.787)</b>

### BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(84.681)	35.033.822	-	-	(35.118.503)
Kanadischer Dollar	(212.549)	12.331.555	-	-	(12.544.104)
Kolumbianischer Peso	4.972.277	4.972.277	-	-	-
Tschechische Krone	(132.381)	5.233.204	-	-	(5.365.585)
Dänische Krone	(104.656)	2.385.651	-	-	(2.490.307)
Euro	(11.640.613)	106.278.087	(10.800)	-	(117.907.900)
Indische Rupie	4.873.608	712.716	-	-	4.160.892
Indonesische Rupiah	4.670.298	4.670.298	-	-	-
Japanischer Yen	8.330.202	21.164.701	-	-	(12.834.499)
Malaysischer Ringgit	3.815.288	7.193.559	-	-	(3.378.271)
Mexikanischer Peso	8.599.734	8.599.734	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	(46.844)	11.843.062	-	-	(11.889.906)
Norwegische Krone	(364.790)	12.118.679	-	-	(12.483.469)
Peruanischer neuer Sol	3.689.750	3.689.750	-	-	-
Philippinischer Peso	70.005	4.562.216	-	-	(4.492.211)
Pfund Sterling	662.230	38.099.587	-	6.139.869	(43.577.226)
Schwedische Krone	26.520	2.691.729	-	-	(2.665.209)
Schweizer Franken	(1)	-	(1)	-	-
Türkische Lira	2.522.717	-	-	-	2.522.717
	<b>29.646.114</b>	<b>281.580.627</b>	<b>(10.801)</b>	<b>6.139.869</b>	<b>(258.063.581)</b>

### BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.186.270	-	-	1.186.270	-
Euro	2.156.430	689	-	2.304.003	(148.262)
Hongkong-Dollar	13.232.020	-	-	12.802.271	429.749
Indische Rupie	12.849.089	51.232	-	12.797.857	-
Indonesische Rupiah	701.952	-	-	675.924	26.028
Koreanischer Won	4.472.258	-	-	4.367.637	104.621
Malaysischer Ringgit	424	424	-	-	-
Südafrikanischer Rand	1.006.115	-	-	970.778	35.337
Taiwan-Dollar	3.335.324	5.844	-	3.329.480	-
	<b>38.939.882</b>	<b>58.189</b>	<b>-</b>	<b>38.434.220</b>	<b>447.473</b>

### BNY Mellon Global Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar	5.853.036	23.961	-	5.853.036	(23.961)
Euro	75.686.058	-	-	75.686.058	-
Hongkong-Dollar	23.393.193	-	-	23.393.193	-
Indische Rupie	229	229	-	-	-
Japanischer Yen	25.621.447	-	-	25.621.447	-
Koreanischer Won	12.826.694	-	-	12.826.694	-

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Equity Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		28.029.688	-	-	27.564.032	465.656
Schwedische Krone		7.102.263	-	-	7.102.263	-
Schweizer Franken		18.670.382	-	-	18.670.382	-
Thailändischer Baht		5.010.149	-	-	5.010.149	-
		<b>202.193.139</b>	<b>24.190</b>	<b>-</b>	<b>201.727.254</b>	<b>441.695</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		89.036.313	-	(567.918)	88.984.514	619.717
Hongkong-Dollar		23.318.009	-	-	23.318.009	-
Japanischer Yen		14.093.351	-	-	14.093.351	-
Koreanischer Won		45.284.836	-	-	45.284.836	-
Neuseeländischer Dollar		3.157.650	-	-	3.157.650	-
Pfund Sterling		112.237.681	-	(28.873)	112.237.682	28.872
Schwedische Krone		30.688.607	-	-	30.688.607	-
Schweizer Franken		104.969.047	-	-	104.969.047	-
Taiwan-Dollar		1.785	1.785	-	-	-
		<b>422.787.279</b>	<b>1.785</b>	<b>(596.791)</b>	<b>422.733.696</b>	<b>648.589</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		(214.520)	26.650.560	-	-	(26.865.080)
Pfund Sterling		(57.567)	7.600.470	-	-	(7.658.037)
		<b>(272.087)</b>	<b>34.251.030</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(34.523.117)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar		12.583.573	22.402	-	12.561.171	-
Euro		66.161.734	20.857	-	65.887.383	253.494
Hongkong-Dollar		2.809.119	11	-	2.809.108	-
Israelischer Schekel		1.543	1.543	-	-	-
Norwegische Krone		886	886	-	-	-
Singapur-Dollar		940.181	940.181	-	-	-
Pfund Sterling		6.376.453	13.869	-	6.791.935	(429.351)
		<b>88.873.489</b>	<b>999.749</b>	<b>-</b>	<b>88.049.597</b>	<b>(175.857)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		1.180.185	-	-	1.180.185	-
Dänische Krone		977.978	-	-	977.978	-
Euro		6.529.869	-	-	6.529.869	-
Hongkong-Dollar		2.281.466	-	-	1.923.046	358.420
Japanischer Yen		3.979.570	-	-	3.345.737	633.833
Pfund Sterling		324.393	2.133	-	322.260	-
Schweizer Franken		1.151.999	-	-	1.151.999	-
		<b>16.425.460</b>	<b>2.133</b>	<b>-</b>	<b>15.431.074</b>	<b>992.253</b>
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		352.739	264.443	-	366.575	(278.279)
Kanadischer Dollar		63.313	-	-	63.313	-

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund Forts.</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Kolumbianischer Peso		167.648	167.648	-	-	-
Hongkong-Dollar		1.655.707	-	-	1.655.707	-
Indonesische Rupiah		190.482	97.997	-	92.485	-
Japanischer Yen		200.379	-	-	200.379	-
Koreanischer Won		615.742	-	-	615.742	-
Mexikanischer Peso		700.312	405.333	-	294.979	-
Neuseeländischer Dollar		391.394	-	-	391.394	-
Peruanischer neuer Sol		160.638	160.638	-	-	-
Singapur-Dollar		108.149	-	-	108.149	-
Pfund Sterling		4.292.950	233.869	-	8.070.969	(4.011.888)
Schweizer Franken		390.526	-	-	390.526	-
Taiwan-Dollar		328.910	98.600	-	230.310	-
Thailändischer Baht		95.973	-	-	95.973	-
US-Dollar		1.231.024	1.596.152	-	2.289.520	(2.654.648)
		<b>10.945.886</b>	<b>3.024.680</b>	<b>-</b>	<b>14.866.021</b>	<b>(6.944.815)</b>

### BNY Mellon Global Opportunities Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar		623.510	2.769	-	636.243	(15.502)
Euro		7.295.578	-	(2.006)	7.309.764	(12.180)
Hongkong-Dollar		1.604.575	-	-	1.639.221	(34.646)
Japanischer Yen		2.407.964	-	-	2.407.964	-
Koreanischer Won		966.407	-	-	966.407	-
Malaysischer Ringgit		1	1	-	-	-
Pfund Sterling		3.590.779	-	-	3.593.876	(3.097)
Schwedische Krone		697.906	-	-	697.906	-
Schweizer Franken		1.713.397	-	-	1.748.241	(34.844)
Thailändischer Baht		532.138	-	-	532.138	-
		<b>19.432.255</b>	<b>2.770</b>	<b>(2.006)</b>	<b>19.531.760</b>	<b>(100.269)</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		3.726.250	13.919.834	-	11.362.441	(21.556.025)
Kanadischer Dollar		5.434.530	-	-	2.368.575	3.065.955
Dänische Krone		32.600.372	-	-	32.600.372	-
Hongkong-Dollar		20.026.488	-	-	105.823.459	(85.796.971)
Ungarischer Forint		29.184.141	7.595.386	-	-	21.588.755
Indische Rupie		20.294.962	4.040.109	-	16.254.853	-
Indonesische Rupiah		4.177.665	4.177.665	-	-	-
Japanischer Yen		(1.443.225)	3.105.531	-	29.958.552	(34.507.308)
Koreanischer Won		12.786.813	-	-	27.181.274	(14.394.461)
Mexikanischer Peso		30.108.891	30.108.891	-	-	-
Neuseeländischer Dollar		5.568.980	10.751.181	-	-	(5.182.201)
Norwegische Krone		36.156.218	-	-	-	36.156.218
Pfund Sterling		133.546.360	31.388.390	-	409.031.967	(306.873.997)
Schweizer Franken		1.673.947	-	-	97.914.271	(96.240.324)
US-Dollar		(51.778.572)	239.072.263	(3.753.868)	1.275.887.475	(1.562.984.442)
		<b>282.063.821</b>	<b>344.159.250</b>	<b>(3.753.868)</b>	<b>2.008.383.240</b>	<b>(2.066.724.801)</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

		GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Australischer Dollar		80.343	326.330	-	133.846	(379.833)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.</b>						
		<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>
Kanadischer Dollar		36.178	–	–	75.546	(39.368)
Dänische Krone		99.825	–	–	725.086	(625.261)
Euro		402.462	2.374.984	(95.395)	7.144.133	(9.021.260)
Hongkong-Dollar		55.548	–	–	2.026.644	(1.971.096)
Ungarischer Forint		828.371	158.219	–	–	670.152
Indische Rupie		468.107	101.884	–	366.223	–
Indonesische Rupiah		147.205	147.205	–	–	–
Japanischer Yen		(23.892)	69.386	–	536.633	(629.911)
Koreanischer Won		405.734	–	–	615.402	(209.668)
Mexikanischer Peso		895.607	895.607	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		114.071	207.038	–	–	(92.967)
Schweizer Franken		46.638	–	–	2.099.515	(2.052.877)
US-Dollar		18.951	5.269.062	(91.012)	26.461.385	(31.620.484)
		<b>3.575.148</b>	<b>9.549.715</b>	<b>(186.407)</b>	<b>40.184.413</b>	<b>(45.972.573)</b>

### BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

		<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Australischer Dollar		797.126	1.461.000	–	2.298.064	(2.961.938)
Kanadischer Dollar		146.902	–	–	297.744	(150.842)
Dänische Krone		1.041.460	–	–	3.517.062	(2.475.602)
Euro		7.173.184	13.664.345	(463.595)	34.812.050	(40.839.616)
Hongkong-Dollar		2.109.184	–	–	10.121.693	(8.012.509)
Ungarischer Forint		2.207.146	927.410	–	–	1.279.736
Indische Rupie		730.935	413.321	–	1.689.630	(1.372.016)
Indonesische Rupiah		61.262	562.070	–	–	(500.808)
Japanischer Yen		2.984.107	319.604	–	2.664.503	–
Koreanischer Won		2.858.784	–	–	2.858.784	–
Mexikanischer Peso		4.573.964	4.573.964	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		171.618	–	–	–	171.618
Pfund Sterling		7.655.581	3.793.909	–	43.204.867	(39.343.195)
Schweizer Franken		409.608	–	(11)	10.330.842	(9.921.223)
		<b>32.920.861</b>	<b>25.715.623</b>	<b>(463.606)</b>	<b>111.795.239</b>	<b>(104.126.395)</b>

### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

		<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Euro		(1.894.143)	318.704.176	(46.988)	–	(320.551.331)
Norwegische Krone		42.423	42.423	–	–	–
Pfund Sterling		(116.245)	47.754.138	–	–	(47.870.383)
Schwedische Krone		105	105	–	–	–
Schweizer Franken		496	496	–	–	–
		<b>(1.967.364)</b>	<b>366.501.338</b>	<b>(46.988)</b>	<b>–</b>	<b>(368.421.714)</b>

### BNY Mellon Global Unconstrained Fund

		<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Australischer Dollar		283.648	619.569	–	208.783	(544.704)
Kolumbianischer Peso		205.357	205.357	–	–	–
Euro		2.569.066	1.026.749	–	2.233.972	(691.655)
Hongkong-Dollar		801.423	–	–	801.423	–
Japanischer Yen		1.932.779	111.651	–	2.053.901	(232.773)
Koreanischer Won		1.037.043	–	–	1.037.043	–
Mexikanischer Peso		360.299	360.299	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		200.725	339.817	–	157.202	(296.294)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts.</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Peruanischer neuer Sol		122.751	122.751	-	-	-
Südafrikanischer Rand		368.518	-	-	368.518	-
Pfund Sterling		2.776.941	-	-	3.815.644	(1.038.703)
Schweizer Franken		1.190.103	-	-	1.190.103	-
Thailändischer Baht		108.008	-	-	108.008	-
		<b>11.956.661</b>	<b>2.786.193</b>	<b>-</b>	<b>11.974.597</b>	<b>(2.804.129)</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>						
		JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Euro		44.062.710	44.062.710	-	-	-
Pfund Sterling		100.442.507	100.442.507	-	-	-
US-Dollar		75.333.011	75.333.011	-	-	-
		<b>219.838.228</b>	<b>219.838.228</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		30.770.732	1	-	30.770.731	-
Kanadischer Dollar		44.976.862	2.635	-	44.974.227	-
Dänische Krone		36.016.968	-	-	36.016.968	-
Hongkong-Dollar		51.232.211	-	-	51.232.211	-
Japanischer Yen		140.699.749	-	-	140.699.749	-
Singapur-Dollar		946.739	946.739	-	-	-
Pfund Sterling		89.219.241	7.557.516	-	81.661.725	-
Schweizer Franken		125.538.352	-	-	125.538.352	-
US-Dollar		913.782.341	26.789.119	-	887.127.027	(133.805)
		<b>1.433.183.195</b>	<b>35.296.010</b>	<b>-</b>	<b>1.398.020.990</b>	<b>(133.805)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		2	2	-	-	-
Euro		55.485.772	1.110.130	-	53.913.058	462.584
Hongkong-Dollar		19.842.304	2.854	-	19.595.146	244.304
Japanischer Yen		28.938.405	244.857	-	28.444.157	249.391
Koreanischer Won		32.313.706	106.864	-	32.206.842	-
Singapur-Dollar		7	7	-	-	-
Pfund Sterling		54	54	-	-	-
Schweizer Franken		11.899.500	1.040.495	-	10.766.902	92.103
Taiwan-Dollar		15.532.789	342.295	-	15.190.494	-
		<b>164.012.539</b>	<b>2.847.558</b>	<b>-</b>	<b>160.116.599</b>	<b>1.048.382</b>
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker</b>						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		113.804	48.446	-	-	65.358
		<b>113.804</b>	<b>48.446</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>65.358</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone		1.165.479	36	-	1.165.443	-
Norwegische Krone		545.967	17	-	545.950	-



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.</b>						
Pfund Sterling		351.587	4.138	–	347.449	–
Schwedische Krone		1.045.718	2.494	–	1.043.224	–
Schweizer Franken		3.747	3.747	–	–	–
US-Dollar		642.194	7.659	–	634.535	–
		<b>3.754.692</b>	<b>18.091</b>	<b>–</b>	<b>3.736.601</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		281.842	1	–	281.841	–
Singapur-Dollar		3.783	3.783	–	–	–
Pfund Sterling		6.838	6.838	–	–	–
Schweizer Franken		566.900	–	–	566.900	–
		<b>859.363</b>	<b>10.622</b>	<b>–</b>	<b>848.741</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(32.835)	16.502.505	–	–	(16.535.340)
Kanadischer Dollar		(89.102)	7.363.521	–	–	(7.452.623)
Kolumbianischer Peso		3.257.266	5.058.653	–	–	(1.801.387)
Tschechische Krone		(64.277)	2.584.228	–	–	(2.648.505)
Indische Rupie		2.642.583	–	–	–	2.642.583
Indonesische Rupiah		2.520.075	3.141.286	–	–	(621.211)
Japanischer Yen		4.279.908	14.344.498	–	–	(10.064.590)
Malaysischer Ringgit		2.499.457	3.950.587	(1)	–	(1.451.129)
Mexikanischer Peso		3.878.558	3.878.558	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		(84.668)	6.133.594	–	–	(6.218.262)
Norwegische Krone		(125.006)	6.481.349	–	–	(6.606.355)
Peruanischer neuer Sol		2.497.383	2.497.383	–	–	–
Philippinischer Peso		51.259	2.027.523	–	–	(1.976.264)
Singapur-Dollar		1.693.605	–	–	–	1.693.605
Pfund Sterling		(53.536)	29.690.905	–	–	(29.744.441)
Schwedische Krone		22.342	2.297.555	–	–	(2.275.213)
US-Dollar		(18.650.616)	94.618.991	–	–	(113.269.607)
		<b>4.242.396</b>	<b>200.571.136</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>	<b>(196.328.739)</b>

### BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Kanadischer Dollar		4.946	–	–	–	4.946
Kolumbianischer Peso		328.742	399.395	–	–	(70.653)
Dänische Krone		420.125	–	–	420.125	–
Hongkong-Dollar		342.986	4.317	–	1.780.075	(1.441.406)
Ungarischer Forint		287.375	53.514	–	–	233.861
Indonesische Rupiah		301.832	301.832	–	–	–
Japanischer Yen		(6.763)	–	–	822.611	(829.374)
Koreanischer Won		306.391	–	–	306.391	–
Malaysischer Ringgit		304.939	304.939	–	–	–
Mexikanischer Peso		467.814	467.814	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		81.584	114.650	–	–	(33.066)
Norwegische Krone		379.160	–	–	–	379.160
Peruanischer neuer Sol		196.496	196.496	–	–	–
Südafrikanischer Rand		186.087	–	–	186.087	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2020	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbind- lichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.</b>						
Pfund Sterling		1.610.059	1.015.014	–	5.675.870	(5.080.825)
Schweizer Franken		20.539	–	–	1.181.271	(1.160.732)
Taiwan-Dollar		209.585	4.393	–	205.192	–
US-Dollar		(1.178.576)	1.384.026	(39.318)	13.580.066	(16.103.350)
		<b>4.263.321</b>	<b>4.246.390</b>	<b>(39.318)</b>	<b>24.157.688</b>	<b>(24.101.439)</b>

### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(2.839)	4.231.448	–	–	(4.234.287)
Kanadischer Dollar	86.397	–	–	–	86.397
Chilenischer Peso	464.488	–	–	–	464.488
Euro	2.305.178	30.974.414	(34.329)	–	(28.634.907)
Japanischer Yen	33.017	33.017	–	–	–
Koreanischer Won	4.059	22.431	–	–	(18.372)
Mexikanischer Peso	63.996	1.353.021	–	–	(1.289.025)
Neuseeländischer Dollar	4.984	4.984	–	–	–
Norwegische Krone	417	417	–	–	–
Russischer Rubel	(21.288)	1.973.261	–	–	(1.994.549)
Singapur-Dollar	10.429	10.429	–	–	–
Südafrikanischer Rand	1.404	1.559.521	–	–	(1.558.117)
Pfund Sterling	122.856	–	–	–	122.856
	<b>3.073.098</b>	<b>40.162.943</b>	<b>(34.329)</b>	<b>–</b>	<b>(37.055.516)</b>

### BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	8.726	8.726	–	–	–
Pfund Sterling	1	1	–	–	–
	<b>8.727</b>	<b>8.727</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	103.787	103.787	–	–	–
Pfund Sterling	97.737	97.737	–	–	–
	<b>201.524</b>	<b>201.524</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	2.016.696	2.016.696	–	–	–
Pfund Sterling	9.588	9.588	–	–	–
	<b>2.026.284</b>	<b>2.026.284</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Die folgende Tabelle veranschaulicht die Auswirkung einer Veränderung der Landeswährungen gegenüber der funktionalen Währung der Fonds auf das den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibende Nettovermögen. Im Interesse konsistenter Vergleiche zwischen den Fonds geht die Tabelle von einem Anstieg des Werts der Landeswährungen um 5 % aus (ein Rückgang um 5 % hätte ähnliche negative Folgen).

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft darüber, wie sich per 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 ein Anstieg bzw. Rückgang des Wechselkurses zwischen den vom Fonds gehaltenen Landeswährungen und seiner funktionalen Währung um 5 % bei ansonsten konstanten Variablen wertmäßig auf das Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibende Nettovermögen ausgewirkt hätte.

Fonds	Funktionale Währung	Anstieg/(Rückgang) des Nettoinventarwerts 2021	Anstieg/(Rückgang) des Nettoinventarwerts 2020
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	2.761.902	2.596.476
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	676.302	1.693.396
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	1.500.162	173.993
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	1.687.719	2.710.058
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	(17.336)	575
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	(2.409)	(2.480)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	6.564	13.281
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	235.091	178.731
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	2.510.671	3.630.057
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	11.619.647	19.513.572
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	USD	k. A.	1.482.306
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	2.181.312	1.946.994
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	10.537.986	10.109.657
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	10.956.315	21.139.364
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	6.720.342	4.443.674
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	1.336.993	821.273
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*>	EUR	k. A.	547.294
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	832.113	971.613
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	k. A.	14.103.191
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	GBP	k. A.	178.757
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	USD	k. A.	1.646.043
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	110.847	(98.368)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	596.100	597.833
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	11.214.733	10.991.911
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	73.198.339	71.659.160
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	16.218.907	8.200.627
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*	USD	k. A.	5.690
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	216.553	187.735
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	45.421	42.968
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	EUR	k. A.	212.120
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	k. A.	213.166
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	USD	k. A.	436
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	87.604	10.076

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Der BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund war zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

Bei Fonds, die den VaR-Ansatz verwenden, wurde die Analyse der Währungsrisikosensitivität bei der Berechnung des Marktpreisrisikos berücksichtigt.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO

Das Kreditrisiko besteht darin, dass eine Partei eines Finanzinstruments der anderen Partei einen finanziellen Verlust verursacht, indem sie einer Verpflichtung nicht nachkommt. Dies schließt das Kontrahenten- und das Emittentenrisiko ein. Finanzielle Vermögenswerte, die die Gesellschaft einem potenziellen Kreditrisiko aussetzen, bestehen vorwiegend aus zinstragenden Wertpapieren wie Anleihen, Derivate und Anlagen in Barguthaben sowie Einlagen und Forderungen im Zusammenhang mit Maklern.

Der Umfang des Kreditrisikos, dem die Gesellschaft im Zusammenhang mit diesen finanziellen Vermögenswerten ausgesetzt ist, entspricht in etwa ihren Buchwerten, zu denen sie in der Bilanz ausgewiesen sind.

Die Anlageverwalter steuern das Emittentenrisiko, indem sie diversifizierte Portfolios mit einer begrenzten Konzentration des Risikos (10 %) auf einen Emittenten in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften der Zentralbank und den Anlagezielen der Fonds aufbauen. Daneben nehmen die Anlageverwalter bei Bedarf nur solche Schuldinstrumente in das Portfolio auf, deren Bonität mindestens den in den jeweiligen Anlagezielen der Fonds enthaltenen Angaben entspricht oder besser ist.

Im Wesentlichen werden alle Vermögenswerte der Gesellschaft von der Verwahrstelle verwahrt. Der Konkurs oder die Insolvenz der Verwahrstelle kann zu Verzögerungen oder Einschränkungen der Rechte der Gesellschaft an den Wertpapieren und anderen von der Verwahrstelle verwahrten Positionen führen.

Die Gesellschaft tätigt nur mit solchen Verwahrstellen Geschäfte, bei denen es sich um regulierte Institute handelt, die einer besonderen Aufsicht unterliegen oder denen von internationalen Ratingagenturen eine hohe Bonität bescheinigt wird. Im Interesse einer Risikobegrenzung kontrolliert der Verwaltungsrat vierteljährlich die Bonität der Verwahrstelle, The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin. Die Bewertung ihrer langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen durch Standard & Poor's beträgt AA- (31. Dezember 2020: AA) zum Ende des Geschäftsjahres.

Die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft werden getrennt vom Vermögen der Verwahrstelle oder ihrer Beauftragten verwahrt. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Verwahrstelle werden die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft somit von denen der Verwahrstelle oder ihren Beauftragten getrennt. Gleichwohl unterliegt die Gesellschaft jedoch mit Blick auf die von der Verwahrstelle gehaltenen Barmittel der Gesellschaft und in Bezug auf die von der globalen Unterdepotbank gehaltenen Sammelkonten für Zeichnungs- und Rücknahmebeträge dem Kreditrisiko der Verwahrstelle oder einer von ihr hinzugezogenen Depotbank. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Verwahrstelle wird die Gesellschaft mit Blick auf die Barmittelbestände der Gesellschaft als nicht bevorrechtigter Gläubiger der Verwahrstelle behandelt.

Das Kontrahenten-/Emittentenrisiko wird wie folgt überwacht:

- Jeder Anlageverwalter führt eine Liste mit zugelassenen Maklern, die einer laufenden Überwachung unterliegt. Das Handelssystem erlaubt ausschließlich den Handel mit zugelassenen Maklern. Es werden neue Makler hinzugefügt, die einem formellen Überprüfungsprozess unterzogen werden, der eine Überprüfung der Kreditwürdigkeit sowie der Finanzkraft des Maklers vorsieht.
- Die Bewertung und Überprüfung des Kontrahenten- oder Emittentenhandelsrisikos wird täglich durchgeführt und beinhaltet eine Überprüfung sämtlicher gehaltenen offenen Positionen.

Durch die ständige Risikofunktion der Gesellschaft wird dieser Prozess kontrolliert, und es werden unabhängige Kontrollen durchgeführt.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Die Bewertung der langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen der Kontrahenten, mit denen die Fonds am 31. Dezember 2021 Geschäfte abgeschlossen haben, durch Standard & Poor's ist in nachstehender Tabelle aufgeführt (Bewertung für 31. Dezember 2020 ist identisch, sofern nicht anders angegeben):

Kontrahent	Rating	Kontrahent	Rating
Bank of America Merrill Lynch	A-	J.P. Morgan AG	A+
Bank of Montreal	A+	Lloyds Bank Plc	A+
Bank of New York Mellon Corporation	A	Morgan Stanley & Co. LLC	A+
Barclays Bank Plc	A	Nomura Holdings Inc	BBB+
BNP Paribas	A+	RBC Capital Markets LLC	AA-
Canadian Imperial Bank of Commerce	A+	Royal Bank of Canada	AA-
Citibank N.A.	A+	Royal Bank of Scotland Plc	A
Commonwealth Bank of Australia.	AA-	Skandinaviska Enskilda Banken AB	A+
Credit Suisse AG	BBB+	Societe Generale	A
Deutsche Bank AG	A- (31. Dezember 2020: BBB+)	Standard Chartered Bank	A+ (31. Dezember 2020: A)
Goldman Sachs & Co.	BBB+	State Street Corp	A
HSBC Bank plc	A+	Toronto Dominion Bank	AA-
ING Bank NV	A+	UBS AG	A+
		Westpac Banking Corp	AA-

Bei Fonds, die das Cash Sweep-Management verwenden, werden die Barguthaben automatisch in kurzfristige Anlageinstrumente investiert. Der Baranlage-Auto-Sweep ist Teil des täglichen Liquiditätssteuerungsverfahrens. Sämtliche Geldmarktfonds, die mittels des Cash Sweep-Managements verfügbar sind, weisen ein AAA-Rating durch Standard & Poor's und Moody's auf und zeichnen sich durch einen stabilen Nettoinventarwert aus. Je nach Wohnsitz des Anlegers und den steuerlichen Auswirkungen stehen Prime- und Staatsanleihenfonds in US-Dollar, Euro und Pfund Sterling neben einer Reihe von Fonds in weiteren Währungen zur Verfügung.

Die nachstehende Tabelle führt die Cash Sweep-Bilanzen zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020.:

Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>	USD	597.574	1.464.421
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>	USD	284.859	1.264.861
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>	USD	995.795	526.106
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>	USD	70.255	k. A.
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>	USD	77.480	k. A.
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>	USD	60.233	k. A.
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	USD	5.851.615	9.896.705
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>	USD	18.035.656	12.258.109
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>	USD	398.423	k. A.
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>	USD	8.333.721	8.033.206
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>	USD	4.351.444	12.577.522
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>	USD	2.000.000	2.000.000
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*</b>	EUR	k. A.	329.925
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>	USD	672.122	360.985
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	EUR	262.947.898	90.124.140
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>	GBP	2.945.355	997.664
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>	USD	36.943.574	10.969.805
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	USD	1.624.422	1.383.272
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>	EUR	3.507.852	816.903
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	USD	10.968.835	5.485.135

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Einzelheiten zu den Ratings von Standard & Poor's zu allen Anlagen in verzinslichen Wertpapieren wie Anleihen und ähnlichen Finanzinstrumenten in bestimmten Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
		%	%
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund<sup>^</sup></b>	AAA	2,66	35,03
	AA	8,78	6,39
	A	5,11	11,43
	BBB	1,66	17,75
	BB	4,37	11,46
	B	4,65	2,94
	CCC	0,57	0,06
	Ohne Rating	52,35	0,55
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund<sup>^</sup></b>	AAA	4,21	7,30
	AA+	k. A.	3,32
	AA	5,28	21,92
	AA-	8,42	25,94
	A+	11,63	12,63
	A	24,17	5,31
	Ohne Rating	46,29	23,58
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund<sup>^</sup></b>	AAA	k. A.	6,75
	AA+	7,92	k. A.
	AA	k. A.	46,88
	A-	1,32	5,15
	BBB	2,49	k. A.
	Ohne Rating	88,27	41,22
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund<sup>*</sup></b>	AA+	k. A.	71,13
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	AA+	5,42	7,65
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	BBB	2,48	k. A.
	BB	53,25	65,06
	B	29,95	28,45
	CCC	7,70	5,59
	CC und niedriger	k. A.	0,07
	Sonstiges	k. A.	0,83
	Ohne Rating	6,62	k. A.
<b>BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund</b>	AAA	0,57	0,46
	AA	4,42	6,70
	A	27,90	31,02
	BBB	61,36	60,89

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021 %	31. Dezember 2020 %
<b>BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund Forts.</b>	BB und niedriger	2,28	0,93
	Ohne Rating	3,47	k. A.
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	BBB	0,48	0,13
	BB	88,09	93,45
	B	9,03	5,98
	CCC	1,32	0,44
	CC und niedriger	k. A.	k. A.
	Ohne Rating	1,08	k. A.
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	BBB	2,15	k. A.
	BB	55,32	55,24
	B	31,82	32,60
	CCC	8,87	11,45
	CC und niedriger	k. A.	0,71
	Ohne Rating	1,84	k. A.
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund^</b>	AA	1,03	k. A.
	A	3,65	8,68
	BBB	27,63	33,37
	BB	15,71	18,73
	B	13,27	27,24
	CCC und niedriger	6,20	10,67
	Ohne Rating	32,51	1,31
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fonds</b>	AAA	k. A.	3,23
	AA	k. A.	2,51
	A	4,45	5,39
	BBB	29,07	34,23
	BB	20,37	32,22
	B	26,47	20,88
	CCC	2,33	1,54
	Ohne Rating	17,31	k. A.
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	AAA	k. A.	1,65
	AA	2,73	0,14
	AA-	k. A.	5,54
	A+	23,82	13,30
	A	4,08	3,83
	A-	5,54	6,42
	BBB+	12,38	16,55
	BBB	23,00	26,50
	BBB-	4,17	7,59
	BB	13,05	17,92

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021 %	31. Dezember 2020 %
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.</b>	BB-	5,45	0,16
	Sonstiges	k. A.	0,40
	Ohne Rating	5,78	k. A.
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>	AAA	k. A.	1,65
	AA	2,21	4,31
	A	17,61	9,90
	BBB	30,49	43,02
	BB	22,17	28,75
	B	13,37	11,25
	CCC	0,76	1,00
	Ohne Rating	13,39	0,13
	Sonstiges	k. A.	1,65
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund^</b>	AA	k. A.	1,68
	AA-	3,44	1,66
	A+	k. A.	1,34
	A	1,26	0,54
	A-	0,80	1,01
	BBB+	6,40	5,71
	BBB	4,49	9,58
	BBB-	11,82	26,61
	BB+	3,74	3,35
	BB	9,39	k. A.
	BB-	9,79	19,21
	B+	4,45	4,53
	B	12,57	14,36
	B-	7,76	6,40
	CCC+	3,52	2,53
	CCC	k. A.	1,09
CCC-	k. A.	0,24	
Ohne Rating	20,57	0,16	
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	AAA	20,70	33,78
	AA	27,73	10,90
	A	10,32	15,10
	BBB	25,82	27,83
	BB	6,51	6,54
	B	1,33	1,72
	Ohne Rating	7,59	k. A.
	Sonstiges	k. A.	4,13
<b>BNY Mellon European Credit Fund^</b>	AAA	0,28	0,47



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021 %	31. Dezember 2020 %
<b>BNY Mellon European Credit Fund^ cont'd</b>	AA	13,06	1,67
	A	29,05	42,65
	BBB	33,08	44,13
	BB und niedriger	3,53	2,63
	Ohne Rating	14,48	k. A.
	Insight EMD Fund	1,06	1,78
	Insight Short Dated HY Fund	2,56	2,96
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	AAA	29,09	43,58
	AA	42,22	19,73
	A	15,35	15,95
	BBB	11,94	20,74
	BB	1,40	k. A.
<b>BNY Mellon Global Credit Fund^</b>	AAA	3,39	28,85
	AA	9,25	4,94
	A	27,61	17,09
	BBB	23,76	25,54
	Below BBB	7,82	13,10
	Ohne Rating	25,67	8,07
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>	AAA	20,40	25,56
	AA	17,01	18,91
	A	5,68	10,31
	BBB	6,36	17,16
	BB	19,08	19,88
	B	19,26	8,18
	Ohne Rating	12,21	k. A.
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>	BBB	k. A.	3,10
	BB	29,51	36,49
	B	46,30	42,00
	CCC und niedriger	17,35	16,65
	Ohne Rating	6,84	k. A.
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*</b>	AAA	k. A.	25,03
	A-	k. A.	5,10
	BBB+	k. A.	2,12
	BBB	k. A.	13,86
	BBB-	k. A.	11,57
	BB+	k. A.	6,76
	BB	k. A.	7,27

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021 %	31. Dezember 2020 %
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* Forts.</b>	BB-	k. A.	3,78
	B+	k. A.	10,48
	B	k. A.	8,93
	B-	k. A.	2,41
	D	k. A.	2,69
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	AAA	k. A.	2,70
	AA	k. A.	3,57
	BBB	k. A.	22,64
	BB	36,30	57,55
	B und niedriger	22,77	13,54
	Ohne Rating	40,93	k. A.
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>	AAA	k. A.	3,11
	AA	k. A.	3,71
	BBB	k. A.	25,66
	BB	14,55	53,41
	B und niedriger	12,69	14,11
	Ohne Rating	72,76	k. A.
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>	AAA	k. A.	2,80
	AA	k. A.	1,60
	BBB	0,20	25,30
	BB	10,78	55,10
	B und niedriger	6,98	15,20
	Ohne Rating	82,04	k. A.
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund^</b>	BBB	k. A.	0,74
	BB	10,31	27,56
	B	46,59	54,46
	CCC	16,31	12,37
	Ohne Rating	15,18	k. A.
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	AAA	15,45	55,91
	AA+	56,41	12,84
	A+	1,92	1,91
	A	3,65	k. A.
	A-	k. A.	3,92
	BBB+	5,51	2,11
	BBB	k. A.	6,55
	BBB-	7,13	8,05
	BB+	2,81	k. A.
	BB	4,43	4,49

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2021 %	31. Dezember 2020 %
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts.</b>	BB-	k. A.	2,27
	B+	k. A.	1,95
	Ohne Rating	2,69	k. A.
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>	AAA	24,34	26,57
	AA	11,65	16,15
	A	6,78	12,61
	BBB	9,06	19,86
	BB	19,32	17,41
	B	16,23	7,40
	Ohne Rating	12,62	k. A.
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>	AA	k. A.	3,90
	A	k. A.	6,70
	BBB	k. A.	31,20
	BB	14,48	41,00
	B	47,47	17,20
	Ohne Rating	38,05	k. A.
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>	AAA	15,02	42,84
	AA	26,21	4,35
	A	7,88	10,71
	BBB	29,59	30,05
	BB	12,04	9,53
	B	2,74	2,72
	Ohne Rating	6,52	k. A.
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	AAA	6,68	8,51
	AA	50,50	54,06
	A	26,25	26,97
	BBB	3,55	9,51
	BB	0,96	0,95
	Ohne Rating	12,06	k. A.
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund<sup>^*</sup></b>	AAA	0,91	k. A.
	AA	14,77	k. A.
	A	39,40	k. A.
	BBB	25,47	k. A.
	BB	4,17	k. A.
	B	0,29	k. A.
	Ohne Rating	11,46	k. A.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

<sup>^</sup> Die Qualitätsaufschlüsselung der Kreditratings von Standard & Poor's zum 31. Dezember 2021 wurde den Daten des Administrators entnommen,

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

für das Vorjahr wurden sie vom Anlageverwalter geliefert.

Alle Transaktionen mit börsennotierten Wertpapieren werden bei Lieferung über anerkannte Makler abgewickelt bzw. bezahlt. Das Risiko eines Zahlungsausfalls des Maklers gilt als äußerst gering, da die verkauften Wertpapiere erst ausgehändigt werden, wenn die Zahlung beim Makler eingegangen ist. Bei einem Kauf werden die Wertpapiere erst bezahlt, wenn sie beim Makler eingegangen sind.

Credit Default Swaps bieten ein Maß an Schutz gegen Zahlungsausfälle von Emittenten von Schuldverschreibungen. Der Einsatz von Credit Default Swaps gewährleistet jedoch nicht, dass ihr Einsatz effektiv sein oder das gewünschte Ergebnis erzielen wird. Die Kreditereignisse werden im Vertrag festgehalten und dienen dazu, den Eintritt einer erheblichen Verschlechterung der Kreditwürdigkeit des Referenzvermögenswerts zu identifizieren. Als ein Sicherungsgeber im Rahmen von Credit Default Swaps erhalten die Fonds vom Sicherungsnehmer in der Regel einen festverzinslichen Ertrag während der Laufzeit des Swaps, sofern kein Kreditereignis eintritt. Als der Sicherungsgeber würden die Fonds ihren Portfolios effektiv Hebelwirkung hinzufügen, da die Fonds neben ihrem Gesamtvermögen dem Anlagerisiko auf die Nennbeträge der Swaps unterliegen würden.

Der höchstmögliche Betrag künftiger Zahlungen (nicht diskontiert), zu deren Leistung ein Fonds als Sicherungsgeber im Rahmen eines Credit Default Swaps aufgefordert werden könnte, entspricht dem Nennbetrag des Vertrags. Diese potenziellen Beträge würden zum Teil durch den Restwert der jeweiligen Verpflichtungen, durch Vorauszahlungen, die bei Vertragsabschluss geleistet wurden, oder durch Nettobeträge aus der Verrechnung des Kaufs von Schutz im Rahmen des eingegangenen Credit Default Swaps, von den Fonds für dasselbe Referenzunternehmen oder dieselben Referenzunternehmen ausgeglichen werden.

Das Höchstengagement für die Fonds als ein Sicherungsgeber ist nachstehend aufgeführt.

Fonds	Basis- Währung	31. Dezember 2021 Maximales Engagement	31. Dezember 2020 Maximales Engagement
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	288.191.277	423.891.915
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	USD	18.663.407	k. A.
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	4.796.951	1.055.155
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	1.800.000	4.000.000
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	47.300.000	21.300.000
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	235.301.515	491.443.566
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	5.464.805	5.863.920

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Sofern möglich begrenzt die Gesellschaft ihr Risiko von Zahlungsausfällen beim Handel mit von ihr gehaltenen derivativen Instrumenten durch Abschluss von bilateralen Globalverrechnungsverträgen zwischen den Fonds und den Kontrahenten (zugelassenen Maklern), mit denen die Fonds ein erhebliches Volumen an OTC-Derivatgeschäften (darunter Total Return Swaps) abwickeln. Derivate werden bei den Kontrahenten auf nicht getrennter Basis gehalten. Globalverrechnungsverträge führen nicht zu einer Aufrechnung der in der Bilanz enthaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, da die Transaktionen üblicherweise auf Bruttobasis abgewickelt werden. Das mit günstigen Kontrakten verbundene Kreditrisiko verringert sich durch Globalverrechnungsverträge jedoch, sofern im Falle eines Ausfalls alle Beträge des Kontrahenten gekündigt und auf Nettobasis reguliert werden. Das Gesamtkreditrisiko der Gesellschaft im Zusammenhang mit einem Globalverrechnungsvertrag unterliegenden derivativen Instrumenten kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da sich jede Transaktion im Rahmen des Vertrags darauf auswirkt.

Bestimmte außerbörsliche (OTC-) Derivate werden über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Bei dieser Vereinbarung werden mit Kontrahenten abgeschlossene außerbörsliche Transaktionen an Clearingstellen übergeben, die nach der Annahme den Kontrahenten in Bezug auf die Risiken der Transaktion wirksam ersetzen.

Die Gesellschaft setzt ein Risikomanagementverfahren ein, das es ihr ermöglicht, die mit Positionen in derivativen Finanzinstrumenten verbundenen Risiken zu bewerten, zu überwachen und zu verwalten; nähere Angaben zu diesem Verfahren wurden der Zentralbank mitgeteilt.

Zur Bereitstellung von Einschuss- bzw. Sicherheitsleistungen für Transaktionen mit derivativen Finanzinstrumenten sind die Fonds der Gesellschaft berechtigt, alle Anlagen oder liquiden Mittel, die Bestandteil des Vermögens der betreffenden Fonds sind, zu übertragen und hypothekarisch oder anderweitig zu belasten. Zudem können die Fonds einem Kreditrisiko in Verbindung mit den Kontrahenten ausgesetzt sein, mit denen sie Transaktionen tätigen oder bei denen sie Einschuss- bzw. Sicherheitsleistungen im Zusammenhang mit Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten hinterlegen, und tragen gegebenenfalls das Ausfallrisiko von Kontrahenten.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### KREDITRISIKO Forts.

Die Fonds können Barmittel und zulässige Sachsicherheiten im Zusammenhang mit dem Handel mit derivativen Finanzinstrumenten zur Verringerung des Kontrahentenrisikos annehmen. Barsicherheiten, die jeder Fonds erhalten hat, werden in der Bilanz als ein Vermögenswert ausgewiesen, dem eine entsprechende Verbindlichkeit gegenübersteht.

Zum 31. Dezember 2021, wurden die folgenden Sachsicherheiten für Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten entgegengenommen:

Fonds	Kontrahent	Währung	Beizulegender Zeitwert
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	Goldman Sachs International	EUR	318.743
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>	Citigroup Global Markets Limited	USD	19.526

Zum 31. Dezember 2020 waren keine Sachsicherheiten für Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten entgegengenommen worden.

Fonds, die Wertpapierleihgeschäfte abschließen, unterliegen ebenfalls dem Kontrahentenrisiko. Um dieses Risiko zu minimieren, werden Sicherheiten gehalten, deren Wert den Betrag der entliehenen Wertpapiere übersteigt. Einzelheiten dazu sind in Erläuterung 14 zum Abschluss enthalten.

Einige Fonds besitzen Anlagen in fremdfinanzierten Darlehen, die bei den kreditabwickelnden Banken nicht separat gehalten werden. Diese Darlehen werden nicht von der Verwahrstelle gehalten. Entsprechend sind die Fonds dem Kreditrisiko des Schuldners ausgesetzt. Zudem gehen die Fonds das Kreditrisiko der kreditabwickelnden Banken ein.

### LIQUIDITÄTSRISIKO

Das Liquiditätsrisiko bezeichnet das Risiko, dass die Gesellschaft nicht ausreichende Barmittel aufbringen kann, um ihre Verpflichtungen bei Fälligkeit in vollem Umfang zu begleichen oder dies nur zu äußerst ungünstigen Bedingungen tun kann.

Die Gesellschaft muss täglich Einschussforderungen auf Derivate und Barrücknahmen einlösbarer, partizipierender Anteile abwickeln. Daher investiert jeder Fonds den Großteil seines Vermögens in Anlagen, die an einem aktiven Markt gehandelt werden und schnell verkauft werden können. Nur ein geringer Teil seines Vermögens wird in Anlagen investiert, die nicht aktiv an einer Börse gehandelt werden. Die börsennotierten Wertpapiere jedes Fonds gelten als rasch verwertbar, da sie an einer regulierten Börse gehandelt werden.

Die Anlageverwalter verwenden gegebenenfalls derivative Instrumente und Schuldtitel wie börsengehandelte Index-Futures, um ein Engagement an Märkten zu ermöglichen und zugleich eine ausreichende Liquidität aufrecht zu erhalten.

Erwirbt ein Fonds Wertpapiere an Freiverkehrsmärkten, kann aufgrund der oftmals begrenzten Liquidität und der vergleichsweise starken Kursschwankungen dieser Märkte nicht garantiert werden, dass der Fonds den Marktwert für diese Wertpapiere erzielt.

Um die Abrechnung sicherzustellen, kann die Gesellschaft kurzfristige Kredite aufnehmen. Ein Überziehungskreditlinie existiert und wurde zu Abrechnungszwecken in Anspruch genommen. Die Verwahrstelle ist berechtigt, verfügbare Barmittel des Fonds zu verwenden und vorhandene Wertpapiere zu verwerten, wenn dies erforderlich ist, um die Verpflichtungen des Fonds im Zusammenhang mit der Bereitstellung eines Überziehungskredits für den Fonds und/oder unbezahlter Beträge zu erfüllen.

Die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft werden zu Handelszwecken gehalten und vorwiegend zum Zweck der kurzfristigen Veräußerung erworben. Da diese Wertpapiere erwartungsgemäß nicht bis zur Fälligkeit oder Kündigung gehalten werden, repräsentiert der aktuelle Marktwert den geschätzten Cashflow, der für die Veräußerung der Wertpapiere ggf. erforderlich ist. Künftige Cashflows der Fonds sowie realisierte Verbindlichkeiten können aufgrund veränderter Marktbedingungen von den aktuellen Verbindlichkeiten abweichen.

Alle finanziellen Verbindlichkeiten sind mit Ausnahme der in den Tabellen dieser Erläuterung aufgeführten Verbindlichkeiten innerhalb von drei Monaten verwertbar.

Swaps und andere derivative Instruments sind in den nachfolgenden Tabellen basierend auf ihren vertraglichen Fälligkeits-/Abrechnungsterminen offen zu legen, die „Über 1 Jahr“ sein können. Da Swaps und sonstige derivative Instrumente jedoch zu Handelszwecken gehalten werden, können die jeweiligen Anlageverwalter je nach Marktbedingungen eine frühere Abrechnung wählen.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

In der nachfolgenden Tabelle sind die finanziellen Verbindlichkeiten der Fonds, die in Derivate investieren, bezüglich der relevanten Fälligkeitsgruppen auf der Basis der zum 31. Dezember 2021 verbleibenden Zeit bis zur vertraglichen Fälligkeit zusammengefasst. Die Tabellen wurden auf der Basis der nicht diskontierten Brutto-Mittelabflüsse in Bezug auf ihre finanziellen Verbindlichkeiten erstellt:

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	1.976.470	–	–	1.976.470
Optionen	19.519	4.546.691	98.098	–	4.664.308
Swaps	–	–	12.209	9.289.532	9.301.741
Terminkontrakte (Forwards)	257.814.349	123.606.806	–	–	381.421.155
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>257.833.868</b>	<b>130.129.967</b>	<b>110.307</b>	<b>9.289.532</b>	<b>397.363.674</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	247.049	–	–	–	247.049
Margen auf Derivatkontrakte	3.329.865	–	–	–	3.329.865
Antizipative Passiva	184.320	–	–	–	184.320
Sonstige Verbindlichkeiten	2.434.480	–	–	–	2.434.480
Einlösbare, partizipierende Anteile	420.833.229	–	–	–	420.833.229
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>684.862.811</b>	<b>130.129.967</b>	<b>110.307</b>	<b>9.289.532</b>	<b>824.392.617</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Terminkontrakte (Futures)	37.152	254.653	–	–	291.805
Swaps	912.697	–	2.764.140	–	3.676.837
Terminkontrakte (Forwards)	117.649.619	–	–	–	117.649.619
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>118.599.468</b>	<b>254.653</b>	<b>2.764.140</b>	<b>–</b>	<b>121.618.261</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	26.275	–	–	–	26.275
Antizipative Passiva	216.901	–	–	–	216.901
Sonstige Verbindlichkeiten	2.875.220	–	–	–	2.875.220
Einlösbare, partizipierende Anteile	123.705.871	–	–	–	123.705.871
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>245.423.735</b>	<b>254.653</b>	<b>2.764.140</b>	<b>–</b>	<b>248.442.528</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	15.470	–	–	15.470
Swaps	–	–	12.021.563	93.873	12.115.436
Terminkontrakte (Forwards)	5.915.525	–	–	–	5.915.525
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>5.915.525</b>	<b>15.470</b>	<b>12.021.563</b>	<b>93.873</b>	<b>18.046.431</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	705.341	–	–	–	705.341
Antizipative Passiva	60.658	–	–	–	60.658
Sonstige Verbindlichkeiten	1.359.810	–	–	–	1.359.810
Einlösbare, partizipierende Anteile	95.148.164	–	–	–	95.148.164
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>103.189.498</b>	<b>15.470</b>	<b>12.021.563</b>	<b>93.873</b>	<b>115.320.404</b>
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	44.164	–	–	–	44.164
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>44.164</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>44.164</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	47.055	–	–	–	47.055
Antizipative Passiva	124.766	–	–	–	124.766
Sonstige Verbindlichkeiten	328.967	–	–	–	328.967
Einlösbare, partizipierende Anteile	58.824.565	–	–	–	58.824.565
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>59.369.517</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>59.369.517</b>
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	328	–	–	–	328
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>328</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>328</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	327	–	–	–	327
Antizipative Passiva	26.794	–	–	–	26.794
Einlösbare, partizipierende Anteile	14.979.746	–	–	–	14.979.746
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>15.007.195</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>15.007.195</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	7.296.857	–	–	–	7.296.857
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>7.296.857</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>7.296.857</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	129.474	–	–	–	129.474
Sonstige Verbindlichkeiten	281.236	–	–	–	281.236
Einlösbare, partizipierende Anteile	95.125.353	–	–	–	95.125.353
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>102.832.920</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>102.832.920</b>
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	792.305	–	–	–	792.305
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>792.305</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>792.305</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	89.296	–	–	–	89.296
Sonstige Verbindlichkeiten	3.296.885	–	–	–	3.296.885
Einlösbare, partizipierende Anteile	42.616.239	–	–	–	42.616.239
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>46.794.725</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>46.794.725</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	3.263	109.102	7.759	–	120.124
Swaps	–	–	–	6.255	6.255
Terminkontrakte (Forwards)	452	13.780.919	–	–	13.781.371
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>3.715</b>	<b>13.890.021</b>	<b>7.759</b>	<b>6.255</b>	<b>13.907.750</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	189	–	–	–	189
Margen auf Derivatkontrakte	903.094	–	–	–	903.094
Antizipative Passiva	19.149	–	–	–	19.149
Einlösbare, partizipierende Anteile	24.751.005	–	–	–	24.751.005
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>25.677.152</b>	<b>13.890.021</b>	<b>7.759</b>	<b>6.255</b>	<b>39.581.187</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	2.533	–	–	–	2.533
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>2.533</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.533</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	4.656	–	–	–	4.656
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>4.656</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.656</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	3.087.954	–	–	–	3.087.954
Antizipative Passiva	307.090	–	–	–	307.090
Sonstige Verbindlichkeiten	6.185.614	–	–	–	6.185.614
Einlösbare, partizipierende Anteile	645.924.114	–	–	–	645.924.114
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>655.509.428</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>655.509.428</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	45.403.602	–	–	–	45.403.602
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>45.403.602</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>45.403.602</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	102.127	–	–	–	102.127
Antizipative Passiva	80.450	–	–	–	80.450
Sonstige Verbindlichkeiten	49.601	–	–	–	49.601
Einlösbare, partizipierende Anteile	191.298.660	–	–	–	191.298.660
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>236.934.440</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>236.934.440</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	7.074	–	–	7.074
Terminkontrakte (Forwards)	6.645.974	–	–	–	6.645.974
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>6.645.974</b>	<b>7.074</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.653.048</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	4.801	–	–	–	4.801
Antizipative Passiva	22.835	–	–	–	22.835
Einlösbare, partizipierende Anteile	20.691.305	–	–	–	20.691.305
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>27.364.915</b>	<b>7.074</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>27.371.989</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	1.062.188	–	–	1.062.188
Terminkontrakte (Forwards)	92.010.564	–	–	–	92.010.564
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>92.010.564</b>	<b>1.062.188</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>93.072.752</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	376.531	–	–	–	376.531
Sonstige Verbindlichkeiten	415.080	–	–	–	415.080
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.921.308.172	–	–	–	1.921.308.172
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>2.014.110.347</b>	<b>1.062.188</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.015.172.535</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	181.299.551	–	–	–	181.299.551
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>181.299.551</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>181.299.551</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	3.376.774	–	–	–	3.376.774
Antizipative Passiva	287.830	–	–	–	287.830
Sonstige Verbindlichkeiten	8.258	–	–	–	8.258
Einlösbare, partizipierende Anteile	726.611.703	–	–	–	726.611.703
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>911.584.116</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>911.584.116</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	247.063	–	–	247.063
Swaps	–	–	–	82.256	82.256
Terminkontrakte (Forwards)	4.460.334	2.506.198	–	–	6.966.532
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>4.460.334</b>	<b>2.753.261</b>	<b>–</b>	<b>82.256</b>	<b>7.295.851</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	4	–	–	–	4
Antizipative Passiva	382.252	–	–	–	382.252
Sonstige Verbindlichkeiten	113.427	–	–	–	113.427
Einlösbare, partizipierende Anteile	554.266.191	–	–	–	554.266.191
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>559.222.208</b>	<b>2.753.261</b>	<b>–</b>	<b>82.256</b>	<b>562.057.725</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	40.411	–	–	40.411
Terminkontrakte (Forwards)	404.008	446.227	–	–	850.235
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>404.008</b>	<b>486.638</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>890.646</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	31.067	–	–	–	31.067
Antizipative Passiva	47.433	–	–	–	47.433
Sonstige Verbindlichkeiten	396.910	–	–	–	396.910
Einlösbare, partizipierende Anteile	33.134.900	–	–	–	33.134.900
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>34.014.318</b>	<b>486.638</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>34.500.956</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	16.751.750	11.705.908	–	–	28.457.658
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>16.751.750</b>	<b>11.705.908</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>28.457.658</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	118.027	–	–	–	118.027
Antizipative Passiva	158.613	–	–	–	158.613
Sonstige Verbindlichkeiten	967.108	–	–	–	967.108
Einlösbare, partizipierende Anteile	113.559.730	–	–	–	113.559.730
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>131.555.228</b>	<b>11.705.908</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>143.261.136</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	1.441	–	–	1.441
Terminkontrakte (Forwards)	800.718	3.235.598	–	–	4.036.316
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>800.718</b>	<b>3.237.039</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.037.757</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	5.427	–	–	–	5.427
Antizipative Passiva	7.271	–	–	–	7.271
Sonstige Verbindlichkeiten	114.412	–	–	–	114.412
Einlösbare, partizipierende Anteile	27.883.288	–	–	–	27.883.288
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>28.811.116</b>	<b>3.237.039</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>32.048.155</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	70.322	–	–	70.322
Swaps	–	–	–	35.277	35.277
Terminkontrakte (Forwards)	871.124	36.068.564	–	–	36.939.688
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>871.124</b>	<b>36.138.886</b>	<b>–</b>	<b>35.277</b>	<b>37.045.287</b>

### Verbindlichkeiten

Banküberziehung	191	–	–	–	191
Margen auf Derivatkontrakte	28.331	–	–	–	28.331
Antizipative Passiva	118.276	–	–	–	118.276
Sonstige Verbindlichkeiten	50.433	–	–	–	50.433
Einlösbare, partizipierende Anteile	125.677.325	–	–	–	125.677.325
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>126.745.680</b>	<b>36.138.886</b>	<b>–</b>	<b>35.277</b>	<b>162.919.843</b>

### BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	261.581	–	–	261.581
Terminkontrakte (Forwards)	108.207	26.095.674	–	–	26.203.881
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>108.207</b>	<b>26.357.255</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>26.465.462</b>

### Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	4.016.798	–	–	–	4.016.798
Antizipative Passiva	292.647	–	–	–	292.647
Sonstige Verbindlichkeiten	337.131	–	–	–	337.131
Einlösbare, partizipierende Anteile	275.922.173	–	–	–	275.922.173
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>280.676.956</b>	<b>26.357.255</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>307.034.211</b>

### BNY Mellon European Credit Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	6.997	–	–	6.997
Swaps	–	–	–	111.371	111.371
Terminkontrakte (Forwards)	899.910	505.930	–	–	1.405.840
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>899.910</b>	<b>512.927</b>	<b>–</b>	<b>111.371</b>	<b>1.524.208</b>

### Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	614.360	–	–	–	614.360
Antizipative Passiva	12.996	–	–	–	12.996
Sonstige Verbindlichkeiten	1.433	–	–	–	1.433
Einlösbare, partizipierende Anteile	40.738.209	–	–	–	40.738.209
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>42.266.908</b>	<b>512.927</b>	<b>–</b>	<b>111.371</b>	<b>42.891.206</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	33.206	–	–	–	33.206
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>33.206</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>33.206</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.073	–	–	–	13.073
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.164.937	–	–	–	2.164.937
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>2.211.216</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.211.216</b>
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	15.811	–	–	–	15.811
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.766.825	–	–	–	2.766.825
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>2.782.636</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.782.636</b>
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.677	–	–	–	13.677
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.351.576	–	–	–	2.351.576
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>2.365.253</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.365.253</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	344.785	147.523.024	–	–	147.867.809
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>344.785</b>	<b>147.523.024</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>147.867.809</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	754	–	–	–	754
Antizipative Passiva	367.929	–	–	–	367.929
Sonstige Verbindlichkeiten	2.256.401	–	–	–	2.256.401
Einlösbare, partizipierende Anteile	434.682.361	–	–	–	434.682.361
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>437.652.230</b>	<b>147.523.024</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>585.175.254</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	160.987	–	–	160.987
Optionen	10.492	3.657.272	–	–	3.667.764
Swaps	–	–	–	4.948.648	4.948.648
Terminkontrakte (Forwards)	337.211.217	741.239	–	–	337.952.456
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>337.221.709</b>	<b>4.559.498</b>	<b>–</b>	<b>4.948.648</b>	<b>346.729.855</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	3.281.263	–	–	–	3.281.263
Antizipative Passiva	68.864	–	–	–	68.864
Sonstige Verbindlichkeiten	65.636	–	–	–	65.636
Einlösbare, partizipierende Anteile	442.961.954	–	–	–	442.961.954
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>783.599.426</b>	<b>4.559.498</b>	<b>–</b>	<b>4.948.648</b>	<b>793.107.572</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	39.999.802	153.971.798	–	–	193.971.600
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>39.999.802</b>	<b>153.971.798</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>193.971.600</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	14.610	–	–	–	14.610
Antizipative Passiva	349.032	–	–	–	349.032
Sonstige Verbindlichkeiten	3.523.167	–	–	–	3.523.167
Einlösbare, partizipierende Anteile	432.993.493	–	–	–	432.993.493
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>476.880.105</b>	<b>153.971.798</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>630.851.903</b>
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	118.191	–	–	–	118.191
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>118.191</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>118.191</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	3.579	–	–	–	3.579
Antizipative Passiva	71.389	–	–	–	71.389
Sonstige Verbindlichkeiten	185.813	–	–	–	185.813
Einlösbare, partizipierende Anteile	53.039.682	–	–	–	53.039.682
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>53.418.654</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>53.418.654</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	47.625	–	–	–	47.625
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>47.625</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>47.625</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	546.300	–	–	–	546.300
Sonstige Verbindlichkeiten	59.982	–	–	–	59.982
Einlösbare, partizipierende Anteile	505.772.156	–	–	–	505.772.156
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>506.426.063</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>506.426.063</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.886.645	–	–	–	1.886.645
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>1.886.645</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.886.645</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	544.528	–	–	–	544.528
Antizipative Passiva	657.547	–	–	–	657.547
Sonstige Verbindlichkeiten	686	–	–	–	686
Einlösbare, partizipierende Anteile	411.101.299	–	–	–	411.101.299
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>414.190.705</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>414.190.705</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	48.913.325	–	–	–	48.913.325
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>48.913.325</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>48.913.325</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	154.717	–	–	–	154.717
Sonstige Verbindlichkeiten	1.221.723	–	–	–	1.221.723
Einlösbare, partizipierende Anteile	166.693.695	–	–	–	166.693.695
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>216.983.460</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>216.983.460</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	2.567.171	–	–	–	2.567.171
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>2.567.171</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.567.171</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	194.921	–	–	–	194.921
Sonstige Verbindlichkeiten	1.120.125	–	–	–	1.120.125
Einlösbare, partizipierende Anteile	227.707.584	–	–	–	227.707.584
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>231.589.801</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>231.589.801</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	40.156	–	–	–	40.156
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>40.156</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>40.156</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	65.289	–	–	–	65.289
Sonstige Verbindlichkeiten	913	–	–	–	913
Einlösbare, partizipierende Anteile	65.357.060	–	–	–	65.357.060
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>65.463.418</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>65.463.418</b>
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.372	–	–	–	13.372
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>13.372</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>13.372</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	29.490	–	–	–	29.490
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>29.490</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>29.490</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	80.824	–	–	–	80.824
Sonstige Verbindlichkeiten	34.743	–	–	–	34.743
Einlösbare, partizipierende Anteile	37.198.450	–	–	–	37.198.450
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>37.343.507</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>37.343.507</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	2.277.516	–	–	2.277.516
Optionen	–	5.061.446	13.629.975	–	18.691.421
Terminkontrakte (Forwards)	632.247.393	1.488.345.232	–	–	2.120.592.625
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>632.247.393</b>	<b>1.495.684.194</b>	<b>13.629.975</b>	<b>–</b>	<b>2.141.561.562</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	10	–	–	–	10
Antizipative Passiva	2.757.756	–	–	–	2.757.756
Sonstige Verbindlichkeiten	2.700.685	–	–	–	2.700.685
Einlösbare, partizipierende Anteile	3.121.728.759	–	–	–	3.121.728.759
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>3.759.434.603</b>	<b>1.495.684.194</b>	<b>13.629.975</b>	<b>–</b>	<b>5.268.748.772</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>					
	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>
Terminkontrakte (Futures)	–	46.560	–	–	46.560
Optionen	–	104.674	272.226	–	376.900
Terminkontrakte (Forwards)	2.776.394	26.773.180	–	–	29.549.574
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>2.776.394</b>	<b>26.924.414</b>	<b>272.226</b>	<b>–</b>	<b>29.973.034</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Antizipative Passiva	53.087	–	–	–	53.087
Sonstige Verbindlichkeiten	4.171	–	–	–	4.171
Einlösbare, partizipierende Anteile	65.897.045	–	–	–	65.897.045
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>68.730.698</b>	<b>26.924.414</b>	<b>272.226</b>	<b>–</b>	<b>95.927.338</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>					
	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Terminkontrakte (Futures)	–	316.381	–	–	316.381
Optionen	–	709.932	1.834.260	–	2.544.192
Terminkontrakte (Forwards)	16.528.942	21.347.911	–	–	37.876.853
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>16.528.942</b>	<b>22.374.224</b>	<b>1.834.260</b>	<b>–</b>	<b>40.737.426</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	454.537	–	–	–	454.537
Sonstige Verbindlichkeiten	2.542.267	–	–	–	2.542.267
Einlösbare, partizipierende Anteile	437.609.335	–	–	–	437.609.335
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>457.135.081</b>	<b>22.374.224</b>	<b>1.834.260</b>	<b>–</b>	<b>481.343.565</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>					
	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Terminkontrakte (Forwards)	43.343.937	179.784.149	–	–	223.128.086
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>43.343.937</b>	<b>179.784.149</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>223.128.086</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	436.175	–	–	–	436.175
Sonstige Verbindlichkeiten	12.366.986	–	–	–	12.366.986
Einlösbare, partizipierende Anteile	792.573.372	–	–	–	792.573.372
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>848.720.470</b>	<b>179.784.149</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.028.504.619</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	33.190.081	509.993	–	–	33.700.074
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>33.190.081</b>	<b>509.993</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>33.700.074</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	5.277	–	–	–	5.277
Einlösbare, partizipierende Anteile	32.551.101	–	–	–	32.551.101
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>65.746.459</b>	<b>509.993</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>66.256.452</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>					
	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Terminkontrakte (Forwards)	658.244.344	–	–	–	658.244.344
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>658.244.344</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>658.244.344</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	20.287.178	–	–	–	20.287.178
Sonstige Verbindlichkeiten	31.716.481	–	–	–	31.716.481
Einlösbare, partizipierende Anteile	21.102.568.351	–	–	–	21.102.568.351
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>21.812.816.354</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>21.812.816.354</b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	12.430.585	–	–	–	12.430.585
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>12.430.585</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>12.430.585</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	1.798.898	–	–	–	1.798.898
Sonstige Verbindlichkeiten	1.061.725	–	–	–	1.061.725
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.600.784.047	–	–	–	1.600.784.047
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.616.075.255</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.616.075.255</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	31.585.817	–	–	–	31.585.817
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>31.585.817</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>31.585.817</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	1.020.690	–	–	–	1.020.690
Sonstige Verbindlichkeiten	1.782.085	–	–	–	1.782.085
Einlösbare, partizipierende Anteile	993.610.089	–	–	–	993.610.089
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.027.998.681</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.027.998.681</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker*</b>	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.159	–	–	–	13.159
Sonstige Verbindlichkeiten	36.082	–	–	–	36.082
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>49.241</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>49.241</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	106.255	–	–	–	106.255
Sonstige Verbindlichkeiten	123.828	–	–	–	123.828
Einlösbare, partizipierende Anteile	81.192.875	–	–	–	81.192.875
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>81.422.958</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>81.422.958</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	62.483	–	–	–	62.483
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>62.483</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>62.483</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	14.295	–	–	–	14.295
Einlösbare, partizipierende Anteile	4.976.550	–	–	–	4.976.550
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>5.053.328</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.053.328</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	6.365.898	233.751.446	–	–	240.117.344
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>6.365.898</b>	<b>233.751.446</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>240.117.344</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	12.011	–	–	–	12.011
Antizipative Passiva	161.814	–	–	–	161.814
Sonstige Verbindlichkeiten	439.722	–	–	–	439.722
Einlösbare, partizipierende Anteile	328.622.843	–	–	–	328.622.843
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>335.602.288</b>	<b>233.751.446</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>569.353.734</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	53.523	–	–	53.523
Optionen	–	124.286	307.058	–	431.344
Terminkontrakte (Forwards)	20.250.327	31.740.617	–	–	51.990.944
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>20.250.327</b>	<b>31.918.426</b>	<b>307.058</b>	<b>–</b>	<b>52.475.811</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	83.163	–	–	–	83.163
Einlösbare, partizipierende Anteile	78.396.803	–	–	–	78.396.803
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>98.730.293</b>	<b>31.918.426</b>	<b>307.058</b>	<b>–</b>	<b>130.955.777</b>
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	122.825	–	–	122.825
Terminkontrakte (Forwards)	–	40.921.736	–	–	40.921.736
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>41.044.561</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>41.044.561</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	501.225	–	–	–	501.225
Antizipative Passiva	83.654	–	–	–	83.654
Sonstige Verbindlichkeiten	7.209.299	–	–	–	7.209.299
Einlösbare, partizipierende Anteile	91.523.113	–	–	–	91.523.113
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>99.317.291</b>	<b>41.044.561</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>140.361.852</b>
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	10.286	–	–	–	10.286
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>10.286</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>10.286</b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	60.955	–	–	–	60.955
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>60.955</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>60.955</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	248.565	–	–	–	248.565
Sonstige Verbindlichkeiten	619	–	–	–	619
Einlösbare, partizipierende Anteile	297.752.469	–	–	–	297.752.469
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>298.062.608</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>298.062.608</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	4.625.185	–	–	–	4.625.185
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>4.625.185</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.625.185</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	619.176	–	–	–	619.176
Sonstige Verbindlichkeiten	1.525.357	–	–	–	1.525.357
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.007.082.724	–	–	–	1.007.082.724
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.013.852.442</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.013.852.442</b>
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	206.623	–	–	206.623
Swaps	–	–	–	1.295.007	1.295.007
Terminkontrakte (Forwards)	29.042.368	–	–	–	29.042.368
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>29.042.368</b>	<b>206.623</b>	<b>–</b>	<b>1.295.007</b>	<b>30.543.998</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	128.275	–	–	–	128.275
Antizipative Passiva	489.448	–	–	–	489.448
Sonstige Verbindlichkeiten	394.336	–	–	–	394.336
Einlösbare, partizipierende Anteile	984.235.804	–	–	–	984.235.804
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.014.290.231</b>	<b>206.623</b>	<b>–</b>	<b>1.295.007</b>	<b>1.015.791.861</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

In der nachfolgenden Tabelle sind die finanziellen Verbindlichkeiten der Fonds, die in Derivate investieren, bezüglich der relevanten Fälligkeitsgruppen auf der Basis der zum 31. Dezember 2020 verbleibenden Zeit bis zur vertraglichen Fälligkeit zusammengefasst. Die Tabellen wurden auf der Basis der nicht diskontierten Brutto-Mittelabflüsse in Bezug auf ihre finanziellen Verbindlichkeiten erstellt:

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Summe
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	767.997	–	–	767.997
Optionen	271.457	303.868	39.989	806	616.120
Swaps	–	–	127.307	14.430.612	14.557.919
Terminkontrakte (Forwards)	115.217.376	3.357.782	–	–	118.575.158
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>115.488.833</b>	<b>4.429.647</b>	<b>167.296</b>	<b>14.431.418</b>	<b>134.517.194</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	60	–	–	–	60
Margen auf Derivatkontrakte	454.563	–	–	–	454.563
Antizipative Passiva	277.806	–	–	–	277.806
Sonstige Verbindlichkeiten	7.670.164	–	–	–	7.670.164
Einlösbare, partizipierende Anteile	420.597.176	–	–	–	420.597.176
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>544.488.602</b>	<b>4.429.647</b>	<b>167.296</b>	<b>14.431.418</b>	<b>563.516.963</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Terminkontrakte (Futures)	20.405	444.453	–	–	464.858
Swaps	6.397.118	–	6.453.841	–	12.850.959
Terminkontrakte (Forwards)	168.938.460	–	–	–	168.938.460
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>175.355.983</b>	<b>444.453</b>	<b>6.453.841</b>	<b>–</b>	<b>182.254.277</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Antizipative Passiva	282.242	–	–	–	282.242
Sonstige Verbindlichkeiten	8.849.204	–	–	–	8.849.204
Einlösbare, partizipierende Anteile	241.339.578	–	–	–	241.339.578
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>425.827.008</b>	<b>444.453</b>	<b>6.453.841</b>	<b>–</b>	<b>432.725.302</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Gesamt
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	1.878	22.258	–	–	24.136
Swaps	–	–	5.763.799	256.944	6.020.743
Terminkontrakte (Forwards)	3.067.540	–	–	–	3.067.540
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>3.069.418</b>	<b>22.258</b>	<b>5.763.799</b>	<b>256.944</b>	<b>9.112.419</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	2.129	–	–	–	2.129
Margen auf Derivatkontrakte	522.478	–	–	–	522.478
Antizipative Passiva	42.682	–	–	–	42.682
Sonstige Verbindlichkeiten	896.788	–	–	–	896.788
Einlösbare, partizipierende Anteile	33.223.020	–	–	–	33.223.020
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>37.756.515</b>	<b>22.258</b>	<b>5.763.799</b>	<b>256.944</b>	<b>43.799.516</b>
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	18.080	–	–	–	18.080
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>18.080</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>18.080</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	312.982	–	–	–	312.982
Antizipative Passiva	132.527	–	–	–	132.527
Sonstige Verbindlichkeiten	1.168.877	–	–	–	1.168.877
Einlösbare, partizipierende Anteile	66.360.687	–	–	–	66.360.687
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>67.993.153</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>67.993.153</b>
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	66.749	–	–	–	66.749
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>66.749</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>66.749</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	5.009	–	–	–	5.009
Antizipative Passiva	46.037	–	–	–	46.037
Einlösbare, partizipierende Anteile	36.440.997	–	–	–	36.440.997
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>36.558.792</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>36.558.792</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Gesamt
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	101.835	–	–	–	101.835
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>101.835</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>101.835</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	35.294	–	–	–	35.294
Einlösbare, partizipierende Anteile	15.864.824	–	–	–	15.864.824
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>16.001.953</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>16.001.953</b>
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	572.272	–	–	–	572.272
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>572.272</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>572.272</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	209.284	–	–	–	209.284
Sonstige Verbindlichkeiten	3.422.194	–	–	–	3.422.194
Einlösbare, partizipierende Anteile	70.198.270	–	–	–	70.198.270
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>74.402.020</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>74.402.020</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	32.443	90.643	–	–	123.086
Terminkontrakte (Forwards)	1.135	11.747.906	–	–	11.749.041
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>33.578</b>	<b>11.838.549</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>11.872.127</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	517.446	–	–	–	517.446
Margen auf Derivatkontrakte	137.699	–	–	–	137.699
Antizipative Passiva	17.569	–	–	–	17.569
Einlösbare, partizipierende Anteile	16.366.070	–	–	–	16.366.070
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>17.072.362</b>	<b>11.838.549</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>28.910.911</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	998.353	–	–	998.353
Terminkontrakte (Forwards)	2.185.762	–	–	–	2.185.762
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>2.185.762</b>	<b>998.353</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.184.115</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	70.860	–	–	–	70.860
Antizipative Passiva	311.909	–	–	–	311.909
Sonstige Verbindlichkeiten	1.432.762	–	–	–	1.432.762
Einlösbare, partizipierende Anteile	536.212.842	–	–	–	536.212.842
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>540.214.135</b>	<b>998.353</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>541.212.488</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	5.871.302	–	–	–	5.871.302
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>5.871.302</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.871.302</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	71.397	–	–	–	71.397
Antizipative Passiva	19.462	–	–	–	19.462
Sonstige Verbindlichkeiten	108.950	–	–	–	108.950
Einlösbare, partizipierende Anteile	26.335.612	–	–	–	26.335.612
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>32.406.723</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>32.406.723</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	44.678	–	–	44.678
Terminkontrakte (Forwards)	29.759.006	–	–	–	29.759.006
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>29.759.006</b>	<b>44.678</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>29.803.684</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	660	–	–	–	660
Antizipative Passiva	38.584	–	–	–	38.584
Einlösbare, partizipierende Anteile	44.168.089	–	–	–	44.168.089
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>73.966.339</b>	<b>44.678</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>74.011.017</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	396.547	–	–	396.547
Terminkontrakte (Forwards)	3.414.118	–	–	–	3.414.118
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>3.414.118</b>	<b>396.547</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.810.665</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	191.842	–	–	–	191.842
Antizipative Passiva	128.514	–	–	–	128.514
Sonstige Verbindlichkeiten	47.944.793	–	–	–	47.944.793
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.203.350.910	–	–	–	1.203.350.910
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.255.030.177</b>	<b>396.547</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.255.426.724</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	20.387.229	–	–	–	20.387.229
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>20.387.229</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>20.387.229</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	134.822	–	–	–	134.822
Antizipative Passiva	313.167	–	–	–	313.167
Sonstige Verbindlichkeiten	5.597.765	–	–	–	5.597.765
Einlösbare, partizipierende Anteile	770.676.813	–	–	–	770.676.813
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>797.109.796</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>797.109.796</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Swaps	–	–	–	228.094	228.094
Terminkontrakte (Forwards)	45.102.102	–	–	–	45.102.102
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>45.102.102</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>228.094</b>	<b>45.330.196</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	273.928	–	–	–	273.928
Sonstige Verbindlichkeiten	208.571	–	–	–	208.571
Einlösbare, partizipierende Anteile	392.457.935	–	–	–	392.457.935
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>438.042.536</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>228.094</b>	<b>438.270.630</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	31.711	–	–	31.711
Terminkontrakte (Forwards)	578.438	–	–	–	578.438
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>578.438</b>	<b>31.711</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>610.149</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	23.417	–	–	–	23.417
Antizipative Passiva	58.181	–	–	–	58.181
Einlösbare, partizipierende Anteile	39.274.388	–	–	–	39.274.388
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>39.934.424</b>	<b>31.711</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>39.966.135</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	23.608.072	52.338.080	–	–	75.946.152
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>23.608.072</b>	<b>52.338.080</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>75.946.152</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1.076	–	–	–	1.076
Antizipative Passiva	321.343	–	–	–	321.343
Sonstige Verbindlichkeiten	4.419.942	–	–	–	4.419.942
Einlösbare, partizipierende Anteile	164.668.641	–	–	–	164.668.641
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>193.019.074</b>	<b>52.338.080</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>245.357.154</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	550	–	–	550
Terminkontrakte (Forwards)	2.031.562	4.711.848	–	–	6.743.410
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>2.031.562</b>	<b>4.712.398</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.743.960</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	8.378	–	–	–	8.378
Antizipative Passiva	20.021	–	–	–	20.021
Sonstige Verbindlichkeiten	970.000	–	–	–	970.000
Einlösbare, partizipierende Anteile	28.263.991	–	–	–	28.263.991
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>31.293.952</b>	<b>4.712.398</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>36.006.350</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Gesamt
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Optionen	3.138	–	–	–	3.138
Terminkontrakte (Forwards)	72.076.091	2.483.348	–	–	74.559.439
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>72.079.229</b>	<b>2.483.348</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>74.562.577</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	448	–	–	–	448
Antizipative Passiva	166.328	–	–	–	166.328
Sonstige Verbindlichkeiten	522.345	–	–	–	522.345
Einlösbare, partizipierende Anteile	165.595.940	–	–	–	165.595.940
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>238.364.290</b>	<b>2.483.348</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>240.847.638</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	153.163	–	–	153.163
Terminkontrakte (Forwards)	39.438.121	11.723.810	–	–	51.161.931
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>39.438.121</b>	<b>11.876.973</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>51.315.094</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	22	–	–	–	22
Margen auf Derivatkontrakte	4.723.319	–	–	–	4.723.319
Antizipative Passiva	508.891	–	–	–	508.891
Sonstige Verbindlichkeiten	2.299.135	–	–	–	2.299.135
Einlösbare, partizipierende Anteile	442.908.116	–	–	–	442.908.116
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>489.877.604</b>	<b>11.876.973</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>501.754.577</b>
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	4.300	–	–	4.300
Swaps	–	–	–	112.022	112.022
Terminkontrakte (Forwards)	256.515	–	–	–	256.515
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>256.515</b>	<b>4.300</b>	<b>–</b>	<b>112.022</b>	<b>372.837</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	613.805	–	–	–	613.805
Antizipative Passiva	16.371	–	–	–	16.371
Sonstige Verbindlichkeiten	1.583.490	–	–	–	1.583.490
Einlösbare, partizipierende Anteile	40.498.739	–	–	–	40.498.739
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>42.968.920</b>	<b>4.300</b>	<b>–</b>	<b>112.022</b>	<b>43.085.242</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>					
Terminkontrakte (Futures)	–	13.115	–	–	13.115
Terminkontrakte (Forwards)	1.981.583	136.873.733	–	–	138.855.316
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>1.981.583</b>	<b>136.886.848</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>138.868.431</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1.196.446	–	–	–	1.196.446
Antizipative Passiva	487.494	–	–	–	487.494
Sonstige Verbindlichkeiten	708.359	–	–	–	708.359
Einlösbare, partizipierende Anteile	614.883.298	–	–	–	614.883.298
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>619.257.180</b>	<b>136.886.848</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>756.144.028</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
Terminkontrakte (Futures)	–	552.754	–	–	552.754
Optionen	413.524	199.928	–	–	613.452
Swaps	–	–	16.829	6.823.006	6.839.835
Terminkontrakte (Forwards)	339.593.017	–	–	–	339.593.017
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>340.006.541</b>	<b>752.682</b>	<b>16.829</b>	<b>6.823.006</b>	<b>347.599.058</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	793.393	–	–	–	793.393
Margen auf Derivatkontrakte	6.872.987	–	–	–	6.872.987
Antizipative Passiva	151.664	–	–	–	151.664
Sonstige Verbindlichkeiten	996.288	–	–	–	996.288
Einlösbare, partizipierende Anteile	803.381.804	–	–	–	803.381.804
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.152.202.677</b>	<b>752.682</b>	<b>16.829</b>	<b>6.823.006</b>	<b>1.159.795.194</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>					
Terminkontrakte (Futures)	–	10.800	–	–	10.800
Terminkontrakte (Forwards)	1.293.650	292.018.146	–	–	293.311.796
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>1.293.650</b>	<b>292.028.946</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>293.322.596</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1.645.000	–	–	–	1.645.000
Antizipative Passiva	390.371	–	–	–	390.371
Sonstige Verbindlichkeiten	270.538	–	–	–	270.538
Einlösbare, partizipierende Anteile	498.134.113	–	–	–	498.134.113
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>501.733.672</b>	<b>292.028.946</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>793.762.618</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Gesamt
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	440.318	–	–	–	440.318
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>440.318</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>440.318</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	81.286	–	–	–	81.286
Sonstige Verbindlichkeiten	678.534	–	–	–	678.534
Einlösbare, partizipierende Anteile	54.195.828	–	–	–	54.195.828
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>55.395.966</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>55.395.966</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	502.280	12.137.707	–	–	12.639.987
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>502.280</b>	<b>12.137.707</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>12.639.987</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	1.676.710	–	–	–	1.676.710
Antizipative Passiva	468.260	–	–	–	468.260
Sonstige Verbindlichkeiten	467.019	–	–	–	467.019
Einlösbare, partizipierende Anteile	439.208.591	–	–	–	439.208.591
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>442.322.860</b>	<b>12.137.707</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>454.460.567</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	2.560.093	–	–	–	2.560.093
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>2.560.093</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.560.093</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	596.791	–	–	–	596.791
Antizipative Passiva	1.033.511	–	–	–	1.033.511
Sonstige Verbindlichkeiten	1.513.161	–	–	–	1.513.161
Einlösbare, partizipierende Anteile	769.230.682	–	–	–	769.230.682
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>774.934.238</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>774.934.238</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	34.539.571	–	–	–	34.539.571
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>34.539.571</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>34.539.571</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	130.794	–	–	–	130.794
Sonstige Verbindlichkeiten	2.121.223	–	–	–	2.121.223
Einlösbare, partizipierende Anteile	153.424.293	–	–	–	153.424.293
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>190.215.881</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>190.215.881</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2020	Gesamt
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	3.888.311	–	–	–	3.888.311
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>3.888.311</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.888.311</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	119.973	–	–	–	119.973
Sonstige Verbindlichkeiten	292.353	–	–	–	292.353
Einlösbare, partizipierende Anteile	146.439.027	–	–	–	146.439.027
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>150.739.664</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>150.739.664</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.025.763	–	–	–	1.025.763
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>1.025.763</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.025.763</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	40.412	–	–	–	40.412
Sonstige Verbindlichkeiten	992.252	–	–	–	992.252
Einlösbare, partizipierende Anteile	39.090.903	–	–	–	39.090.903
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>41.149.330</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>41.149.330</b>
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	6.143.521	–	–	–	6.143.521
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>6.143.521</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.143.521</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	27.545	–	–	–	27.545
Einlösbare, partizipierende Anteile	20.744.725	–	–	–	20.744.725
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>26.915.791</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>26.915.791</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	64.976	–	–	–	64.976
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>64.976</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>64.976</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Banküberziehung	9.156	–	–	–	9.156
Antizipative Passiva	97.305	–	–	–	97.305
Sonstige Verbindlichkeiten	502.909	–	–	–	502.909
Einlösbare, partizipierende Anteile	35.977.689	–	–	–	35.977.689
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>36.652.035</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>36.652.035</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Optionen	690.536	4.559.620	3.063.332	–	8.313.488
Terminkontrakte (Forwards)	315.648.661	504.682.316	–	–	820.330.977
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>316.339.197</b>	<b>509.241.936</b>	<b>3.063.332</b>	<b>–</b>	<b>828.644.465</b>

#### Verbindlichkeiten

Banküberziehung	1.203.141	–	–	–	1.203.141
Margen auf Derivatkontrakte	2.809.531	–	–	–	2.809.531
Antizipative Passiva	2.610.143	–	–	–	2.610.143
Sonstige Verbindlichkeiten	89.600.822	–	–	–	89.600.822
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.926.880.946	–	–	–	2.926.880.946
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>3.339.443.780</b>	<b>509.241.936</b>	<b>3.063.332</b>	<b>–</b>	<b>3.851.749.048</b>

#### BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Optionen	16.068	94.497	74.944	–	185.509
Terminkontrakte (Forwards)	3.686.696	8.876.305	–	–	12.563.001
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>3.702.764</b>	<b>8.970.802</b>	<b>74.944</b>	<b>–</b>	<b>12.748.510</b>

#### Verbindlichkeiten

Banküberziehung	898	–	–	–	898
Margen auf Derivatkontrakte	65.415	–	–	–	65.415
Antizipative Passiva	74.899	–	–	–	74.899
Sonstige Verbindlichkeiten	1.082.690	–	–	–	1.082.690
Einlösbare, partizipierende Anteile	62.762.505	–	–	–	62.762.505
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>67.689.171</b>	<b>8.970.802</b>	<b>74.944</b>	<b>–</b>	<b>76.734.917</b>

#### BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	USD	USD	USD	USD	USD
Optionen	71.810	463.595	356.227	–	891.632
Terminkontrakte (Forwards)	94.044.676	30.434.192	–	–	124.478.868
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>94.116.486</b>	<b>30.897.787</b>	<b>356.227</b>	<b>–</b>	<b>125.370.500</b>

#### Verbindlichkeiten

Banküberziehung	11	–	–	–	11
Margen auf Derivatkontrakte	271.606	–	–	–	271.606
Antizipative Passiva	292.462	–	–	–	292.462
Sonstige Verbindlichkeiten	64.658	–	–	–	64.658
Einlösbare, partizipierende Anteile	300.822.877	–	–	–	300.822.877
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>395.568.100</b>	<b>30.897.787</b>	<b>356.227</b>	<b>–</b>	<b>426.822.114</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Swaps	–	–	–	46.988	46.988
Terminkontrakte (Forwards)	90.151.334	301.617.883	–	–	391.769.217
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>90.151.334</b>	<b>301.617.883</b>	<b>–</b>	<b>46.988</b>	<b>391.816.205</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	327.110	–	–	–	327.110
Antizipative Passiva	390.383	–	–	–	390.383
Sonstige Verbindlichkeiten	1.887.406	–	–	–	1.887.406
Einlösbare, partizipierende Anteile	701.716.479	–	–	–	701.716.479
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>794.472.712</b>	<b>301.617.883</b>	<b>–</b>	<b>46.988</b>	<b>1.096.137.583</b>
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.353.136	1.765.425	–	–	3.118.561
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>1.353.136</b>	<b>1.765.425</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.118.561</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.427	–	–	–	13.427
Einlösbare, partizipierende Anteile	29.990.159	–	–	–	29.990.159
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>31.356.722</b>	<b>1.765.425</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>33.122.147</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>					
	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Terminkontrakte (Forwards)	4.436.363.139	–	–	–	4.436.363.139
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>4.436.363.139</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.436.363.139</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	13.573.776	–	–	–	13.573.776
Sonstige Verbindlichkeiten	1.664.661	–	–	–	1.664.661
Einlösbare, partizipierende Anteile	15.317.409.324	–	–	–	15.317.409.324
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>19.769.010.900</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>19.769.010.900</b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	5.086.757	–	–	–	5.086.757
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>5.086.757</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.086.757</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	1.791.169	–	–	–	1.791.169
Sonstige Verbindlichkeiten	2.227.276	–	–	–	2.227.276
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.571.112.825	–	–	–	1.571.112.825
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>1.580.218.027</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.580.218.027</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	14.824.184	–	–	–	14.824.184
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>14.824.184</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>14.824.184</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	446.284	–	–	–	446.284
Sonstige Verbindlichkeiten	1.589.355	–	–	–	1.589.355
Einlösbare, partizipierende Anteile	474.197.314	–	–	–	474.197.314
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>491.057.137</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>491.057.137</b>
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	109.951	–	–	–	109.951
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>109.951</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>109.951</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	6.995	–	–	–	6.995
Antizipative Passiva	70.463	–	–	–	70.463
Sonstige Verbindlichkeiten	616.867	–	–	–	616.867
Einlösbare, partizipierende Anteile	36.865.576	–	–	–	36.865.576
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>37.669.852</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>37.669.852</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	93.498	–	–	–	93.498
Sonstige Verbindlichkeiten	40.529	–	–	–	40.529
Einlösbare, partizipierende Anteile	60.661.744	–	–	–	60.661.744
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>60.795.771</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>60.795.771</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	20.319	–	–	–	20.319
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>20.319</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>20.319</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	3.013	–	–	–	3.013
Einlösbare, partizipierende Anteile	5.003.928	–	–	–	5.003.928
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>5.027.260</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.027.260</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Futures)	–	5.487	–	–	5.487
Terminkontrakte (Forwards)	43.265.547	112.734.091	–	–	155.999.638
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>43.265.547</b>	<b>112.739.578</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>156.005.125</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	126.705	–	–	–	126.705
Sonstige Verbindlichkeiten	4.259.495	–	–	–	4.259.495
Einlösbare, partizipierende Anteile	271.321.884	–	–	–	271.321.884
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>318.973.631</b>	<b>112.739.578</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>431.713.209</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Optionen	7.708	51.830	31.610	–	91.148
Terminkontrakte (Forwards)	6.575.246	5.045.641	–	–	11.620.887
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>6.582.954</b>	<b>5.097.471</b>	<b>31.610</b>	<b>–</b>	<b>11.712.035</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	49.992	–	–	–	49.992
Sonstige Verbindlichkeiten	5.360	–	–	–	5.360
Einlösbare, partizipierende Anteile	34.247.376	–	–	–	34.247.376
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>40.885.682</b>	<b>5.097.471</b>	<b>31.610</b>	<b>–</b>	<b>46.014.763</b>
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	–	48.837	–	–	48.837
Terminkontrakte (Forwards)	32.955.716	1.558.117	–	–	34.513.833
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>32.955.716</b>	<b>1.606.954</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>34.562.670</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Margen auf Derivatkontrakte	102.845	–	–	–	102.845
Antizipative Passiva	95.645	–	–	–	95.645
Sonstige Verbindlichkeiten	1.740.943	–	–	–	1.740.943
Einlösbare, partizipierende Anteile	92.952.258	–	–	–	92.952.258
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>127.847.407</b>	<b>1.606.954</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>129.454.361</b>
<b>BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund</b>					
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	21.570	–	–	–	21.570
Einlösbare, partizipierende Anteile	3.704.307	–	–	–	3.704.307
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>3.725.877</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.725.877</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2020
	USD	USD	USD	USD	USD
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>					
Terminkontrakte (Forwards)	389.410	–	–	–	389.410
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>389.410</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>389.410</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	198.430	–	–	–	198.430
Sonstige Verbindlichkeiten	463.554	–	–	–	463.554
Einlösbare, partizipierende Anteile	230.267.279	–	–	–	230.267.279
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>231.318.673</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>231.318.673</b>
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>					
Terminkontrakte (Forwards)	15.971.563	–	–	–	15.971.563
<b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>15.971.563</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>15.971.563</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>					
Antizipative Passiva	384.049	–	–	–	384.049
Sonstige Verbindlichkeiten	10.026.892	–	–	–	10.026.892
Einlösbare, partizipierende Anteile	613.916.282	–	–	–	613.916.282
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>640.298.786</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>640.298.786</b>

Einlösbare Anteile werden nach Wahl der Inhaber auf Verlangen zurückgenommen. Der Verwaltungsrat beabsichtigt jedoch nicht, dass die vertragliche Fälligkeit für die tatsächlichen Mittelabflüsse repräsentativ ist, da Inhaber dieser Instrumente üblicherweise einen mittleren bis langfristigen Anlagehorizont aufweisen.

Um die Gesamtliquidität der Gesellschaft zu steuern und einen ordnungsgemäßen Verkauf von Wertpapieren zu ermöglichen, darf der Verwaltungsrat gemäß den Bestimmungen des Prospekts den Rückkauf von Anteilen verweigern, die an einem Bewertungstag ein Zehntel der im Umlauf befindlichen Anteile eines Fonds übersteigen.

Nachfolgend ist die Anzahl der Anleger angegeben, die gemessen am Handelswert zum Ende des Geschäftsjahres mehr als 10 % des Nettovermögens des Fonds hielten:

Fonds	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	3	3
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	1	3
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	4	2
BNY Mellon Asian Equity Fund	2	1
BNY Mellon Asian Income Fund	2	1
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	1	2
BNY Mellon Brazil Equity Fund	2	1
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	4	4
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	4	1
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	1	1
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	2	2

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	3	2
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	3	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	2	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	2	1
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	2	2
BNY Mellon Euroland Bond Fund	1	1
BNY Mellon European Credit Fund	2	2
BNY Mellon Future Earth Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Future Food Fund*	2	k. A.
BNY Mellon Future Life Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Global Bond Fund	3	2
BNY Mellon Global Credit Fund	2	3
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	2	2
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	4	2
BNY Mellon Global Equity Fund	1	1
BNY Mellon Global Equity Income Fund	-	2
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	3	3
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	3	3
BNY Mellon Global Leaders Fund	4	3
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*	k. A.	2
BNY Mellon Global Opportunities Fund	1	1
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	3	3
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	2	1
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	3	1
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	2	2
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	1	1
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	3	3
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	-	1
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	1	1
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker*	k. A.	2
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	3	2
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	1	1
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	3	4
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	5	1
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	1	1
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund*	k. A.	1
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	5	3
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	2	3
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	1	k. A.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

### ANZAHL DER ANTEILSINHABER

Die Gesellschaft hatte am Ende des aktuellen Geschäftsjahres und des vorherigen Geschäftsjahres mindestens zehn Inhaber von einlösbaren, partizipierenden Anteilen.

### MANAGEMENT DES KAPITALRISIKOS

Das Kapital der Fonds wird durch das Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres dargestellt. Die Höhe des Nettovermögens kann täglich erheblich schwanken, da die Fonds täglichen Zeichnungen und Rücknahmen im Ermessen der Anteilshaber unterliegen. Das Ziel der Fonds bei der Kapitalverwaltung besteht darin, seine Fähigkeit zur Unternehmensfortführung zu bewahren, um Erträge für die Anteilshaber und Vorteile für sonstige Interessengruppen zu liefern und eine solide Kapitalbasis zu erhalten und so die Entwicklung der Anlagetätigkeit der Fonds zu unterstützen.

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### MANAGEMENT DES KAPITALRISIKOS Forts.

Im Rahmen ihrer Politik führt die Gesellschaft unter anderem folgende Maßnahmen durch, um die Kapitalstruktur zu erhalten oder anzupassen:

- Die Gesellschaft überwacht die Menge der täglichen Zeichnungen und Rücknahmen in Bezug auf die voraussichtlich liquidierbaren Anlagen und passt die Höhe der an die Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile zu zahlenden Ausschüttungen entsprechend an.
- Einlösbare, partizipierende Anteile werden in Übereinstimmung mit dem Prospekt und den Nachträgen für die Fonds ausgegeben und zurückgenommen; dies beinhaltet die Fähigkeit, Rücknahmen zu beschränken und das Erfordernis gewisser Mindestbestände und Mindestzeichnungen.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert anhand einer Zeitwerthierarchie (Fair-Value-Hierarchie) eingestuft, die die Bedeutung der Inputfaktoren für die Bewertungen widerspiegelt: Die Hierarchie für den beizulegenden Zeitwert hat folgende Stufen:

Stufe 1: Kursnotierungen (nicht angepasst) auf aktiven Märkten für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten.

Stufe 2: Andere Inputfaktoren als die Kursnotierungen der Stufe 1, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit entweder direkt (das heißt als Kurse) oder indirekt (das heißt abgeleitet von Kursen) beobachtbar sind.

Stufe 3: Inputfaktoren zu Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (das heißt nicht beobachtbare Inputfaktoren).

Zu den Instrumenten, deren Werte auf Kursnotierungen an aktiven Märkten basieren und die daher in die Stufe 1 eingestuft werden, gehören aktiv notierte Aktien, börsengehandelte Fonds (ETF) und Derivate, hoch liquide Staatsanleihen (der G7-Länder), Einlagenzertifikate und andere notierte Wertpapiere. Die Gesellschaft passt die Kursnotierungen für diese Instrumente nicht an.

Finanzinstrumente, die an Märkten gehandelt werden, die nicht als aktiv eingestuft werden, jedoch auf der Grundlage von Kursnotierungen, Händlernoteierungen oder alternativen Preisquellen bewertet werden, die durch beobachtbare Inputfaktoren untermauert werden, werden in Stufe 2 eingestuft. Dies beinhaltet Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating (Nicht-G7-Länder) und Unternehmensanleihen, OTC-Derivate, Organismen für gemeinsame Anlagen, Geldmarktinstrumente, Genussscheine und bestimmte börsennotierte Aktien. Da Anlagen der Stufe 2 Positionen beinhalten, die nicht an aktiven Märkten gehandelt werden und/oder Übertragungsbeschränkungen unterliegen, können die Bewertungen, die üblicherweise auf den verfügbaren Marktdaten basieren, angepasst werden, um die Illiquidität und/oder Nichtübertragbarkeit zu reflektieren.

Die in Stufe 3 eingestufteten Anlagen zeichnen sich durch umfangreiche nicht beobachtbare Inputfaktoren aus, da sie unregelmäßig gehandelt werden. Zu den Instrumenten der Stufe 3 zählen unter anderem Leveraged Loans und Unternehmensanleihen, die zum Anschaffungswert oder nach ihrem beizulegenden Zeitwert unter Verwendung der Notierung eines einzelnen Maklers bewertet werden. Nicht beobachtbare Inputfaktoren werden bei der Bewertung des beizulegenden Zeitwerts verwendet, sofern keine relevanten verfügbaren Inputfaktoren zur Verfügung stehen und dadurch Situationen entstehen, in denen es am Bewertungstag wenn überhaupt nur geringe Marktaktivitäten für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit gibt. Das Ziel der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert ist jedoch immer dasselbe und besteht darin, aus der Sicht eines Marktteilnehmers, der den Vermögenswert hält oder die Verbindlichkeit schuldet, einen Verkaufspreis zu ermitteln. Daher müssen nicht erkennbare Inputfaktoren jene Annahmen widerspiegeln, die Marktteilnehmer bei der Preisermittlung für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit verwenden würden, einschließlich der Risikoannahmen. Die Sensitivität nicht beobachtbarer Inputfaktoren, die bei der Feststellung des beizulegenden Zeitwerts der Wertpapiere der Stufe 3 verwendet werden, ist nicht unmittelbar bestimmbar.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2021 bewertet wurden:

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	138.437.871	178.868.048	372.797	317.678.716
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	38.545.235	–	38.545.235
	Credit Default Swaps	–	6.851.302	–	6.851.302
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.248.056	–	6.248.056
	Terminkontrakte (Futures)	3.776.347	–	–	3.776.347
	Zinsswaps	–	896.802	–	896.802
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	17.454.923	2.182.910	19.637.833
	Optionen	–	258.551	–	258.551
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>142.214.218</b>	<b>249.122.917</b>	<b>2.555.707</b>	<b>393.892.842</b>
	Credit Default Swaps	–	(9.301.741)	–	(9.301.741)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.644.555)	–	(5.644.555)
	Terminkontrakte (Futures)	(1.976.470)	–	–	(1.976.470)
	Optionen	–	(4.664.308)	–	(4.664.308)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.976.470)</b>	<b>(19.610.604)</b>	<b>–</b>	<b>(21.587.074)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	4.997.275	4.005.140	–	9.002.415
	Einlagenzertifikate	30.485.245	–	–	30.485.245
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	15.556.493	–	15.556.493
	Commercial Paper	–	41.977.848	–	41.977.848
	Aktien	11.322.670	–	23.683	11.346.353
	Aktienindex-Swaps	–	237.927	–	237.927
	Aktien-Swaps	–	5.566.346	–	5.566.346
	Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)	–	13.632.347	–	13.632.347
	Terminkontrakte (Forwards)	–	129.730	–	129.730
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>46.805.190</b>	<b>81.105.831</b>	<b>23.683</b>	<b>127.934.704</b>
	Aktienindex-Swaps	–	(1.162.066)	–	(1.162.066)
	Aktien-Swaps	–	(2.514.771)	–	(2.514.771)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.261.617)	–	(2.261.617)
	Terminkontrakte (Futures)	(291.805)	–	–	(291.805)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(291.805)</b>	<b>(5.938.454)</b>	<b>–</b>	<b>(6.230.259)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	55.728.794	29.031.083	–	84.759.877
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	6.876.198	–	6.876.198
	Aktien-Swaps	–	3.413.559	–	3.413.559
	Terminkontrakte (Forwards)	–	945.054	–	945.054
	Terminkontrakte (Futures)	3.315	–	–	3.315
	Total Return Swaps	–	9.692.356	–	9.692.356
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>55.732.109</b>	<b>49.958.250</b>	<b>–</b>	<b>105.690.359</b>
	Aktien-Swaps	–	(8.647.202)	–	(8.647.202)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(37.677)	–	(37.677)
	Terminkontrakte (Futures)	(15.470)	–	–	(15.470)
	Total Return Swaps	–	(3.468.234)	–	(3.468.234)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(15.470)</b>	<b>(12.153.113)</b>	<b>–</b>	<b>(12.168.583)</b>
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	58.137.558	–	–	58.137.558
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>58.137.558</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>58.137.558</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(61)	–	(61)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(61)</b>	<b>–</b>	<b>(61)</b>
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	194.610	–	194.610
	Aktien	12.724.072	1.732.579	–	14.456.651
	Terminkontrakte (Forwards)	–	15	–	15
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>12.724.072</b>	<b>1.927.204</b>	<b>–</b>	<b>14.651.276</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1)	–	(1)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>	<b>(1)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	92.751.964	–	–	92.751.964
	Terminkontrakte (Forwards)	–	275.976	–	275.976
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>92.751.964</b>	<b>275.976</b>	<b>–</b>	<b>93.027.940</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(51.332)	–	(51.332)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(51.332)</b>	<b>–</b>	<b>(51.332)</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	36.554.442	5.517.210	–	42.071.652
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.996	–	3.996
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>36.554.442</b>	<b>5.521.206</b>	<b>–</b>	<b>42.075.648</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.787)	–	(1.787)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1.787)</b>	<b>–</b>	<b>(1.787)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	21.154.917	–	–	21.154.917
	Credit Default Swaps	–	921.017	–	921.017
	Aktien-Swaps	–	18	–	18
	Terminkontrakte (Forwards)	–	249.524	–	249.524
	Terminkontrakte (Futures)	345.671	–	–	345.671
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>21.500.588</b>	<b>1.170.559</b>	<b>–</b>	<b>22.671.147</b>
	Aktien-Swaps	–	(6.255)	–	(6.255)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(182.082)	–	(182.082)
	Terminkontrakte (Futures)	(120.124)	–	–	(120.124)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(120.124)</b>	<b>(188.337)</b>	<b>–</b>	<b>(308.461)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	34.994.461	–	–	34.994.461
	Aktien	552.967.187	–	–	552.967.187
	Terminkontrakte (Forwards)	–	40.477	–	40.477
	Terminkontrakte (Futures)	2.927.226	–	–	2.927.226
	Optionen	19.386.988	–	–	19.386.988
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>610.275.862</b>	<b>40.477</b>	<b>–</b>	<b>610.316.339</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(37)	–	(37)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(37)</b>	<b>–</b>	<b>(37)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	183.957.110	–	183.957.110
	Credit Default Swaps	–	462.608	–	462.608
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.415.514	–	3.415.514
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>187.835.232</b>	<b>–</b>	<b>187.835.232</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(363.707)	–	(363.707)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(363.707)</b>	<b>–</b>	<b>(363.707)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	19.611.588	–	19.611.588
	Credit Default Swaps	–	43.971	–	43.971
	Terminkontrakte (Forwards)	–	496.198	–	496.198
	Terminkontrakte (Futures)	12.616	–	–	12.616
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>12.616</b>	<b>20.151.757</b>	<b>–</b>	<b>20.164.373</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(53.875)	–	(53.875)
	Terminkontrakte (Futures)	(7.074)	–	–	(7.074)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(7.074)</b>	<b>(53.875)</b>	<b>–</b>	<b>(60.949)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	1.870.934.871	–	1.870.934.871
	Terminkontrakte (Forwards)	–	14.611.501	–	14.611.501
	Terminkontrakte (Futures)	409.474	–	–	409.474
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>409.474</b>	<b>1.885.546.372</b>	<b>–</b>	<b>1.885.955.846</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.130.766)	–	(2.130.766)
	Terminkontrakte (Futures)	(1.062.188)	–	–	(1.062.188)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.062.188)</b>	<b>(2.130.766)</b>	<b>–</b>	<b>(3.192.954)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	699.088.728	11.281	699.100.009
	Credit Default Swaps	–	4.353.157	–	4.353.157
	Aktien	3.934	–	–	3.934
	Terminkontrakte (Forwards)	–	10.495.044	–	10.495.044
	Optionsscheine	–	3.742	–	3.742
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>3.934</b>	<b>713.940.671</b>	<b>11.281</b>	<b>713.955.886</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.088.433)	–	(4.088.433)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(4.088.433)</b>	<b>–</b>	<b>(4.088.433)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	502.246.150	–	502.246.150
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	28.749.161	–	28.749.161
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.201.624	–	1.201.624
	Terminkontrakte (Futures)	76.471	–	–	76.471
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>76.471</b>	<b>532.196.935</b>	<b>–</b>	<b>532.273.406</b>
	Credit Default Swaps	–	(82.256)	–	(82.256)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.371)	–	(10.371)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
-------	-----------------	---------	---------	---------	-----------------------------

#### BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.

	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	(247.063)	–	–	(247.063)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(247.063)</b>	<b>(92.627)</b>	<b>–</b>	<b>(339.690)</b>

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	31.911.805	–	31.911.805
Terminkontrakte (Forwards)	–	9.510	–	9.510
Terminkontrakte (Futures)	27.476	–	–	27.476
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>27.476</b>	<b>31.921.315</b>	<b>–</b>	<b>31.948.791</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.140)	–	(5.140)
Terminkontrakte (Futures)	(40.411)	–	–	(40.411)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(40.411)</b>	<b>(5.140)</b>	<b>–</b>	<b>(45.551)</b>

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	103.195.739	–	103.195.739
Terminkontrakte (Forwards)	–	910.828	–	910.828
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>104.106.567</b>	<b>–</b>	<b>104.106.567</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(481.453)	–	(481.453)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(481.453)</b>	<b>–</b>	<b>(481.453)</b>

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	26.531.803	–	26.531.803
Terminkontrakte (Forwards)	–	96.068	–	96.068
Terminkontrakte (Futures)	3.494	–	–	3.494
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>3.494</b>	<b>26.627.871</b>	<b>–</b>	<b>26.631.365</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(81.789)	–	(81.789)
Terminkontrakte (Futures)	(1.441)	–	–	(1.441)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.441)</b>	<b>(81.789)</b>	<b>–</b>	<b>(83.230)</b>

#### BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	114.981.928	–	114.981.928
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	4.014.000	–	4.014.000
Terminkontrakte (Forwards)	–	2.094.578	–	2.094.578
Terminkontrakte (Futures)	120.229	–	–	120.229
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>120.229</b>	<b>121.090.506</b>	<b>–</b>	<b>121.210.735</b>
Credit Default Swaps	–	(35.277)	–	(35.277)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(388.669)	–	(388.669)
	Terminkontrakte (Futures)	(70.322)	–	–	(70.322)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(70.322)</b>	<b>(423.946)</b>	<b>–</b>	<b>(494.268)</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	67.333.866	199.928.315	–	267.262.181
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.426.564	–	2.426.564
	Terminkontrakte (Forwards)	–	411.469	–	411.469
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>67.333.866</b>	<b>202.766.348</b>	<b>–</b>	<b>270.100.214</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(267.752)	–	(267.752)
	Terminkontrakte (Futures)	(261.581)	–	–	(261.581)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(261.581)</b>	<b>(267.752)</b>	<b>–</b>	<b>(529.333)</b>
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	38.083.369	–	38.083.369
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.473.494	–	1.473.494
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.141	–	3.141
	Terminkontrakte (Futures)	37.238	–	–	37.238
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>37.238</b>	<b>39.560.004</b>	<b>–</b>	<b>39.597.242</b>
	Credit Default Swaps	–	(111.371)	–	(111.371)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(29.711)	–	(29.711)
	Terminkontrakte (Futures)	(6.997)	–	–	(6.997)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(6.997)</b>	<b>(141.082)</b>	<b>–</b>	<b>(148.079)</b>
<b>BNY Mellon Future Earth Fund*</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.052.857	–	–	2.052.857
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	45.419	–	45.419
	Terminkontrakte (Forwards)	–	687	–	687
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.052.857</b>	<b>46.106</b>	<b>–</b>	<b>2.098.963</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(58)	–	(58)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(58)</b>	<b>–</b>	<b>(58)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Future Food Fund*</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.697.272	–	–	2.697.272
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.697.272</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.697.272</b>
<b>BNY Mellon Future Life Fund*</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.298.463	–	–	2.298.463
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.298.463</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.298.463</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	175.103.919	226.496.743	–	401.600.662
	Organismen für gemeinsame Anlagen	22.509.231	–	–	22.509.231
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.640.448	–	3.640.448
	Terminkontrakte (Futures)	231.888	–	–	231.888
	Optionen	196.188	–	–	196.188
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>198.041.226</b>	<b>230.137.191</b>	<b>–</b>	<b>428.178.417</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.982.261)	–	(1.982.261)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1.982.261)</b>	<b>–</b>	<b>(1.982.261)</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	55.052.378	376.828.674	–	431.881.052
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	850.000	–	850.000
	Credit Default Swaps	–	5.740.006	–	5.740.006
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.515.790	–	1.515.790
	Terminkontrakte (Futures)	554.831	–	–	554.831
	Optionen	–	54.460	–	54.460
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>55.607.209</b>	<b>384.988.930</b>	<b>–</b>	<b>440.596.139</b>
	Credit Default Swaps	–	(4.948.648)	–	(4.948.648)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.236.892)	–	(4.236.892)
	Terminkontrakte (Futures)	(160.987)	–	–	(160.987)
	Optionen	–	(3.667.764)	–	(3.667.764)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(160.987)</b>	<b>(12.853.304)</b>	<b>–</b>	<b>(13.014.291)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	47.739.829	326.031.282	–	373.771.111
	Organismen für gemeinsame Anlagen	13.148.875	6.620.068	–	19.768.943
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.430.962	–	5.430.962
	Terminkontrakte (Futures)	410.313	–	–	410.313
	Optionen	217.313	–	–	217.313
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>61.516.330</b>	<b>338.082.312</b>	<b>–</b>	<b>399.598.642</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.874.889)	–	(1.874.889)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1.874.889)</b>	<b>–</b>	<b>(1.874.889)</b>
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	52.483.572	–	–	52.483.572
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.329	–	2.329
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>52.483.572</b>	<b>2.329</b>	<b>–</b>	<b>52.485.901</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(255)	–	(255)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(255)</b>	<b>–</b>	<b>(255)</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	491.911.402	5.467.145	–	497.378.547
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.152	–	1.152
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>491.911.402</b>	<b>5.468.297</b>	<b>–</b>	<b>497.379.699</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(92)	–	(92)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(92)</b>	<b>–</b>	<b>(92)</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	390.269.867	15.017.423	–	405.287.290
	Terminkontrakte (Forwards)	–	33.009	–	33.009
	Optionsscheine	–	566.286	–	566.286
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>390.269.867</b>	<b>15.616.718</b>	<b>–</b>	<b>405.886.585</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.591)	–	(2.591)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(2.591)</b>	<b>–</b>	<b>(2.591)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	-	151.929.942	-	151.929.942
	Aktien	69.741	-	-	69.741
	Terminkontrakte (Forwards)	-	102.431	-	102.431
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	-	5.848.443	1.288.479	7.136.922
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>69.741</b>	<b>157.880.816</b>	<b>1.288.479</b>	<b>159.239.036</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(163.678)	-	(163.678)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(163.678)</b>	<b>-</b>	<b>(163.678)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	223.483.722	-	-	223.483.722
	Terminkontrakte (Forwards)	-	1.813.323	-	1.813.323
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>223.483.722</b>	<b>1.813.323</b>	<b>-</b>	<b>225.297.045</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(48.500)	-	(48.500)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(48.500)</b>	<b>-</b>	<b>(48.500)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	64.493.318	-	-	64.493.318
	Terminkontrakte (Forwards)	-	7.178	-	7.178
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>64.493.318</b>	<b>7.178</b>	<b>-</b>	<b>64.500.496</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(562)	-	(562)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(562)</b>	<b>-</b>	<b>(562)</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	36.531.985	-	-	36.531.985
	Terminkontrakte (Forwards)	-	608	-	608
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>36.531.985</b>	<b>608</b>	<b>-</b>	<b>36.532.593</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(51)	-	(51)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(51)</b>	<b>-</b>	<b>(51)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	182.410.297	–	182.410.297
	Organismen für gemeinsame Anlagen	117.419.475	33.340.073	–	150.759.548
	Aktien	1.929.659.458	43.237.692	–	1.972.897.150
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	209.989.824	–	209.989.824
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.678.463	–	2.678.463
	Terminkontrakte (Futures)	1.619.234	–	–	1.619.234
	Optionen	26.754.878	–	–	26.754.878
	Optionsscheine	–	184.027.446	–	184.027.446
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.075.453.045</b>	<b>655.683.795</b>	<b>–</b>	<b>2.731.136.840</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(44.019.460)	–	(44.019.460)
	Terminkontrakte (Futures)	(2.277.516)	–	–	(2.277.516)
	Optionen	(18.691.421)	–	–	(18.691.421)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(20.968.937)</b>	<b>(44.019.460)</b>	<b>–</b>	<b>(64.988.397)</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	3.598.596	3.449.812	–	7.048.408
	Organismen für gemeinsame Anlagen	2.288.129	803.879	–	3.092.008
	Aktien	39.261.420	809.393	–	40.070.813
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	4.239.503	–	4.239.503
	Terminkontrakte (Forwards)	–	208.957	–	208.957
	Terminkontrakte (Futures)	29.700	–	–	29.700
	Optionen	540.005	–	–	540.005
	Optionsscheine	–	3.685.913	–	3.685.913
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>45.717.850</b>	<b>13.197.457</b>	<b>–</b>	<b>58.915.307</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(180.785)	–	(180.785)
	Terminkontrakte (Futures)	(46.560)	–	–	(46.560)
	Optionen	(376.900)	–	–	(376.900)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(423.460)</b>	<b>(180.785)</b>	<b>–</b>	<b>(604.245)</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	28.068.125	15.794.468	–	43.862.593
	Organismen für gemeinsame Anlagen	13.835.809	3.523.686	–	17.359.495
	Aktien	266.230.258	5.208.870	–	271.439.128
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	26.792.544	–	26.792.544
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.191.163	–	3.191.163
	Terminkontrakte (Futures)	189.596	–	–	189.596
	Optionen	3.645.801	–	–	3.645.801
	Optionsscheine	–	21.982.814	–	21.982.814
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>311.969.589</b>	<b>76.493.545</b>	<b>–</b>	<b>388.463.134</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(362.098)	–	(362.098)



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
-------	-----------------	---------	---------	---------	-----------------------------

#### BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.

	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	(316.381)	–	–	(316.381)
Optionen	(2.544.192)	–	–	(2.544.192)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(2.860.573)</b>	<b>(362.098)</b>	<b>–</b>	<b>(3.222.671)</b>

#### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	666.003.090	–	666.003.090
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	73.536.026	–	73.536.026
Credit Default Swaps	–	116.058	–	116.058
Terminkontrakte (Forwards)	–	11.959.722	–	11.959.722
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	25.637.859	8.929.100	34.566.959
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>777.252.755</b>	<b>8.929.100</b>	<b>786.181.855</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.769.339)	–	(1.769.339)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1.769.339)</b>	<b>–</b>	<b>(1.769.339)</b>

#### BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	2.833.378	2.601.357	–	5.434.735
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	203.942	–	203.942
Aktien	21.044.566	121.785	–	21.166.351
Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.408.020	–	1.408.020
Börsengehandelte Rohstoffe	1.499.596	–	–	1.499.596
Terminkontrakte (Forwards)	–	45.467	–	45.467
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>25.377.540</b>	<b>4.380.571</b>	<b>–</b>	<b>29.758.111</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(136.007)	–	(136.007)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(136.007)</b>	<b>–</b>	<b>(136.007)</b>

#### BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY
Aktien	20.509.402.150	–	–	20.509.402.150
Terminkontrakte (Forwards)	–	149.024.725	–	149.024.725
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>20.509.402.150</b>	<b>149.024.725</b>	<b>–</b>	<b>20.658.426.875</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.069.632)	–	(10.069.632)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(10.069.632)</b>	<b>–</b>	<b>(10.069.632)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	1.573.332.184	–	–	1.573.332.184
	Terminkontrakte (Forwards)	–	40.171	–	40.171
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>1.573.332.184</b>	<b>40.171</b>	<b>–</b>	<b>1.573.372.355</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(76.616)	–	(76.616)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(76.616)</b>	<b>–</b>	<b>(76.616)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	970.198.399	–	–	970.198.399
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.775.355	–	2.775.355
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>970.198.399</b>	<b>2.775.355</b>	<b>–</b>	<b>972.973.754</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(284.872)	–	(284.872)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(284.872)</b>	<b>–</b>	<b>(284.872)</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	78.056.236	1.819.497	–	79.875.733
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>78.056.236</b>	<b>1.819.497</b>	<b>–</b>	<b>79.875.733</b>
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	4.826.796	129.994	–	4.956.790
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.800	–	6.800
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>4.826.796</b>	<b>136.794</b>	<b>–</b>	<b>4.963.590</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(656)	–	(656)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(656)</b>	<b>–</b>	<b>(656)</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	29.545.900	273.481.165	–	303.027.065
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.546.746	–	1.546.746
	Terminkontrakte (Futures)	311.972	–	–	311.972
	Optionen	167.604	–	–	167.604
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>30.025.476</b>	<b>275.027.911</b>	<b>–</b>	<b>305.053.387</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.219.461)	–	(4.219.461)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(4.219.461)</b>	<b>–</b>	<b>(4.219.461)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	2.327.728	–	2.327.728
	Organismen für gemeinsame Anlagen	771.336	2.309.475	–	3.080.811
	Aktien	49.486.377	862.181	–	50.348.558
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	5.418.755	–	5.418.755
	Terminkontrakte (Forwards)	–	53.265	–	53.265
	Terminkontrakte (Futures)	25.814	–	–	25.814
	Optionen	618.875	–	–	618.875
	Optionsscheine	–	3.768.345	–	3.768.345
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>50.902.402</b>	<b>14.739.749</b>	<b>–</b>	<b>65.642.151</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(993.467)	–	(993.467)
	Terminkontrakte (Futures)	(53.523)	–	–	(53.523)
	Optionen	(431.344)	–	–	(431.344)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(484.867)</b>	<b>(993.467)</b>	<b>–</b>	<b>(1.478.334)</b>
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	27.899.871	62.667.966	349.685	90.917.522
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.951.732	–	1.951.732
	Terminkontrakte (Futures)	470.392	–	–	470.392
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>28.370.263</b>	<b>64.619.698</b>	<b>349.685</b>	<b>93.339.646</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(162.053)	–	(162.053)
	Terminkontrakte (Futures)	(122.825)	–	–	(122.825)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(122.825)</b>	<b>(162.053)</b>	<b>–</b>	<b>(284.878)</b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	280.774.258	–	–	280.774.258
	Terminkontrakte (Forwards)	–	53.880	–	53.880
	Vorzugsanleihen	–	3.992.998	–	3.992.998
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>280.774.258</b>	<b>4.046.878</b>	<b>–</b>	<b>284.821.136</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.338)	–	(1.338)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(1.338)</b>	<b>–</b>	<b>(1.338)</b>
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	986.507.151	3.160.000	989.667.151
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.695.769	–	3.695.769
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>990.202.920</b>	<b>3.160.000</b>	<b>993.362.920</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(29.655)	–	(29.655)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(29.655)</b>	<b>–</b>	<b>(29.655)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2021
<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	949.471.549	–	949.471.549
	Terminkontrakte (Forwards)	–	34.951	–	34.951
	Terminkontrakte (Futures)	1.162.238	–	–	1.162.238
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>1.162.238</b>	<b>949.506.500</b>	<b>–</b>	<b>950.668.738</b>
	Credit Default Swaps	–	(1.295.007)	–	(1.295.007)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(605.016)	–	(605.016)
	Terminkontrakte (Futures)	(206.623)	–	–	(206.623)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(206.623)</b>	<b>(1.900.023)</b>	<b>–</b>	<b>(2.106.646)</b>

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2020 bewertet wurden:

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	156.451.130	186.823.950	596.439	343.871.519
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	7.123.756	–	7.123.756
	Credit Default Swaps	–	10.676.955	–	10.676.955
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.499.543	–	7.499.543
	Terminkontrakte (Futures)	157.757	–	–	157.757
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	7.672.590	7.122.782	14.795.372
	Optionen	–	2.606.523	–	2.606.523
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>156.608.887</b>	<b>222.403.317</b>	<b>7.719.221</b>	<b>386.731.425</b>
	Credit Default Swaps	–	(14.557.919)	–	(14.557.919)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.543.654)	–	(2.543.654)
	Terminkontrakte (Futures)	(767.997)	–	–	(767.997)
	Optionen	–	(616.120)	–	(616.120)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(767.997)</b>	<b>(17.717.693)</b>	<b>–</b>	<b>(18.485.690)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>					
		<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>
	Anleihen	7.004.160	–	–	7.004.160
	Einlagenzertifikate	77.503.966	–	–	77.503.966
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	27.768.062	–	27.768.062
	Commercial Paper	–	44.996.961	–	44.996.961
	Aktien	19.549.995	–	–	19.549.995
	Aktienindex-Swaps	–	246.297	–	246.297
	Aktien-Swaps	–	20.740.176	–	20.740.176
	Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)	–	21.052.890	–	21.052.890
	Terminkontrakte (Forwards)	–	61.505	–	61.505
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>104.058.121</b>	<b>114.865.891</b>	<b>–</b>	<b>218.924.012</b>
	Aktienindex-Swaps	–	(4.327.072)	–	(4.327.072)
	Aktien-Swaps	–	(8.523.887)	–	(8.523.887)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(749.434)	–	(749.434)
	Terminkontrakte (Futures)	(464.858)	–	–	(464.858)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(464.858)</b>	<b>(13.600.393)</b>	<b>–</b>	<b>(14.065.251)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>					
		<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
	Anleihen	18.117.824	11.550.606	–	29.668.430
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.887.304	–	2.887.304
	Aktien-Swaps	–	283.172	–	283.172
	Terminkontrakte (Forwards)	–	51.159	–	51.159
	Total Return Swaps	–	6.380.166	–	6.380.166
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>18.117.824</b>	<b>21.152.407</b>	<b>–</b>	<b>39.270.231</b>
	Aktien-Swaps	–	(5.763.799)	–	(5.763.799)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(26.326)	–	(26.326)
	Terminkontrakte (Futures)	(24.136)	–	–	(24.136)
	Total Return Swaps	–	(256.944)	–	(256.944)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(24.136)</b>	<b>(6.047.069)</b>	<b>–</b>	<b>(6.071.205)</b>
<b>BNY Mellon Asian Equity Fund</b>					
		<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
	Aktien	64.927.494	–	–	64.927.494
	Terminkontrakte (Forwards)	–	840	–	840
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>64.927.494</b>	<b>840</b>	<b>–</b>	<b>64.928.334</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.073.141	660	1.073.801
	Aktien	28.851.743	4.815.027	–	33.666.770
	Terminkontrakte (Forwards)	–	13	–	13
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>28.851.743</b>	<b>5.888.181</b>	<b>660</b>	<b>34.740.584</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(84)	–	(84)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(84)</b>	<b>–</b>	<b>(84)</b>
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.555.808	–	1.555.808
	Aktien	14.148.639	–	–	14.148.639
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.116	–	7.116
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>14.148.639</b>	<b>1.562.924</b>	<b>–</b>	<b>15.711.563</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(322)	–	(322)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(322)</b>	<b>–</b>	<b>(322)</b>
<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	61.212.522	7.866.941	–	69.079.463
	Terminkontrakte (Forwards)	–	103.507	–	103.507
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>61.212.522</b>	<b>7.970.448</b>	<b>–</b>	<b>69.182.970</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.186)	–	(4.186)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(4.186)</b>	<b>–</b>	<b>(4.186)</b>
<b>BNY Mellon Dynamic Total Return Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	11.642.085	–	–	11.642.085
	Organismen für gemeinsame Anlagen	1.580.485	–	–	1.580.485
	Terminkontrakte (Forwards)	–	123.748	–	123.748
	Terminkontrakte (Futures)	128.581	–	–	128.581
	Optionen	1.670.550	–	–	1.670.550
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>15.021.701</b>	<b>123.748</b>	<b>–</b>	<b>15.145.449</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(144.295)	–	(144.295)
	Terminkontrakte (Futures)	(123.086)	–	–	(123.086)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(123.086)</b>	<b>(144.295)</b>	<b>–</b>	<b>(267.381)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	41.029.117	–	–	41.029.117
	Aktien	462.838.067	–	–	462.838.067
	Terminkontrakte (Forwards)	–	225.847	–	225.847
	Terminkontrakte (Futures)	1.879.730	–	–	1.879.730
	Optionen	855.113	–	–	855.113
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>506.602.027</b>	<b>225.847</b>	<b>–</b>	<b>506.827.874</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(8.127)	–	(8.127)
	Terminkontrakte (Futures)	(998.353)	–	–	(998.353)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(998.353)</b>	<b>(8.127)</b>	<b>–</b>	<b>(1.006.480)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	25.266.762	–	25.266.762
	Credit Default Swaps	–	120.241	–	120.241
	Terminkontrakte (Forwards)	–	24.869	–	24.869
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>25.411.872</b>	<b>–</b>	<b>25.411.872</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(43.183)	–	(43.183)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(43.183)</b>	<b>–</b>	<b>(43.183)</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	42.122.602	–	42.122.602
	Credit Default Swaps	–	98.005	–	98.005
	Terminkontrakte (Forwards)	–	992.308	–	992.308
	Terminkontrakte (Futures)	1.608	–	–	1.608
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>1.608</b>	<b>43.212.915</b>	<b>–</b>	<b>43.214.523</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(345.060)	–	(345.060)
	Terminkontrakte (Futures)	(44.678)	–	–	(44.678)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(44.678)</b>	<b>(345.060)</b>	<b>–</b>	<b>(389.738)</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	1.534.873	1.169.873.274	–	1.171.408.147
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.338.922	–	5.338.922
	Terminkontrakte (Futures)	499.680	–	–	499.680
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.034.553</b>	<b>1.175.212.196</b>	<b>–</b>	<b>1.177.246.749</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(49.500)	–	(49.500)
	Terminkontrakte (Futures)	(396.547)	–	–	(396.547)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(396.547)</b>	<b>(49.500)</b>	<b>–</b>	<b>(446.047)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	-	733.560.564	-	733.560.564
	Credit Default Swaps	-	1.986.419	-	1.986.419
	Terminkontrakte (Forwards)	-	9.442.896	-	9.442.896
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>-</b>	<b>744.989.879</b>	<b>-</b>	<b>744.989.879</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(333.500)	-	(333.500)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(333.500)</b>	<b>-</b>	<b>(333.500)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	-	369.328.292	-	369.328.292
	Organismen für gemeinsame Anlagen	-	7.896.733	-	7.896.733
	Credit Default Swaps	-	389.305	-	389.305
	Terminkontrakte (Forwards)	-	2.413.093	-	2.413.093
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>-</b>	<b>380.027.423</b>	<b>-</b>	<b>380.027.423</b>
	Credit Default Swaps	-	(228.094)	-	(228.094)
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(1.598.114)	-	(1.598.114)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(1.826.208)</b>	<b>-</b>	<b>(1.826.208)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	189.998	37.598.632	-	37.788.630
	Terminkontrakte (Forwards)	-	17.292	-	17.292
	Terminkontrakte (Futures)	4.093	-	-	4.093
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>194.091</b>	<b>37.615.924</b>	<b>-</b>	<b>37.810.015</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(1.722)	-	(1.722)
	Terminkontrakte (Futures)	(31.711)	-	-	(31.711)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(31.711)</b>	<b>(1.722)</b>	<b>-</b>	<b>(33.433)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	-	163.813.838	-	163.813.838
	Terminkontrakte (Forwards)	-	1.165.896	-	1.165.896
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>-</b>	<b>164.979.734</b>	<b>-</b>	<b>164.979.734</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(939.928)	-	(939.928)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>-</b>	<b>(939.928)</b>	<b>-</b>	<b>(939.928)</b>



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	20.000	27.720.940	–	27.740.940
	Terminkontrakte (Forwards)	–	69.009	–	69.009
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>20.000</b>	<b>27.789.949</b>	<b>–</b>	<b>27.809.949</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(89.046)	–	(89.046)
	Terminkontrakte (Futures)	(550)	–	–	(550)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(550)</b>	<b>(89.046)</b>	<b>–</b>	<b>(89.596)</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	153.926.945	–	153.926.945
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	5.770.066	–	5.770.066
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.960.505	–	3.960.505
	Terminkontrakte (Futures)	39.729	–	–	39.729
	Optionen	–	39.075	–	39.075
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>39.729</b>	<b>163.696.591</b>	<b>–</b>	<b>163.736.320</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.854.632)	–	(2.854.632)
	Optionen	–	(3.138)	–	(3.138)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(2.857.770)</b>	<b>–</b>	<b>(2.857.770)</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	162.462.925	250.345.625	–	412.808.550
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	15.230.642	–	15.230.642
	Terminkontrakte (Forwards)	–	596.945	–	596.945
	Terminkontrakte (Futures)	495.838	–	–	495.838
	Zinsswaps	–	2.479.379	–	2.479.379
	Optionen	–	168.163	–	168.163
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>162.958.763</b>	<b>268.820.754</b>	<b>–</b>	<b>431.779.517</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(633.155)	–	(633.155)
	Terminkontrakte (Futures)	(153.163)	–	–	(153.163)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(153.163)</b>	<b>(633.155)</b>	<b>–</b>	<b>(786.318)</b>
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	38.240.902	–	38.240.902
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.007.896	–	2.007.896
	Terminkontrakte (Forwards)	–	87.379	–	87.379
	Terminkontrakte (Futures)	4.113	–	–	4.113
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>4.113</b>	<b>40.336.177</b>	<b>–</b>	<b>40.340.290</b>
	Credit Default Swaps	–	(112.022)	–	(112.022)

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon European Credit Fund Forts.</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(8.081)	–	(8.081)
	Terminkontrakte (Futures)	(4.300)	–	–	(4.300)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(4.300)</b>	<b>(120.103)</b>	<b>–</b>	<b>(124.403)</b>

### BNY Mellon Global Bond Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	280.750.990	305.225.744	–	585.976.734
Organismen für gemeinsame Anlagen	16.427.021	–	–	16.427.021
Terminkontrakte (Forwards)	–	2.166.598	–	2.166.598
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>297.178.011</b>	<b>307.392.342</b>	<b>–</b>	<b>604.570.353</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.033.181)	–	(3.033.181)
Terminkontrakte (Futures)	(13.115)	–	–	(13.115)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.115)</b>	<b>(3.033.181)</b>	<b>–</b>	<b>(3.046.296)</b>

### BNY Mellon Global Credit Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	250.799.690	508.806.026	1.343.135	760.948.851
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	14.546.122	–	14.546.122
Credit Default Swaps	–	10.996.179	–	10.996.179
Terminkontrakte (Forwards)	–	2.463.873	–	2.463.873
Terminkontrakte (Futures)	235.371	–	–	235.371
Optionen	–	1.921.321	–	1.921.321
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>251.035.061</b>	<b>538.733.521</b>	<b>1.343.135</b>	<b>791.111.717</b>
Credit Default Swaps	–	(6.839.835)	–	(6.839.835)
Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.936.892)	–	(2.936.892)
Terminkontrakte (Futures)	(552.754)	–	–	(552.754)
Optionen	–	(613.452)	–	(613.452)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(552.754)</b>	<b>(10.390.179)</b>	<b>–</b>	<b>(10.942.933)</b>

### BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	104.949.828	349.868.273	–	454.818.101
Organismen für gemeinsame Anlagen	20.977.824	6.139.869	–	27.117.693
Terminkontrakte (Forwards)	–	3.068.650	–	3.068.650
Optionen	54.375	–	–	54.375
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>125.982.027</b>	<b>359.076.792</b>	<b>–</b>	<b>485.058.819</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.173.432)	–	(5.173.432)
Terminkontrakte (Futures)	(10.800)	–	–	(10.800)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(10.800)</b>	<b>(5.173.432)</b>	<b>–</b>	<b>(5.184.232)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Emerging Markets Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	53.256.127	–	–	53.256.127
	Terminkontrakte (Forwards)	–	28.662	–	28.662
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>53.256.127</b>	<b>28.662</b>	<b>–</b>	<b>53.284.789</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.162)	–	(2.162)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(2.162)</b>	<b>–</b>	<b>(2.162)</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	428.519.453	5.010.149	–	433.529.602
	Terminkontrakte (Forwards)	–	398.999	–	398.999
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>428.519.453</b>	<b>5.409.148</b>	<b>–</b>	<b>433.928.601</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(386.114)	–	(386.114)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(386.114)</b>	<b>–</b>	<b>(386.114)</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	8.364.982	5.902	8.370.884
	Aktien	712.068.552	36.913.952	–	748.982.504
	Terminkontrakte (Forwards)	–	375.646	–	375.646
	Optionsscheine	–	139.320	–	139.320
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>712.068.552</b>	<b>45.793.900</b>	<b>5.902</b>	<b>757.868.354</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(9.834)	–	(9.834)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(9.834)</b>	<b>–</b>	<b>(9.834)</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	141.980.015	–	141.980.015
	Terminkontrakte (Forwards)	–	550.506	–	550.506
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	6.462.843	–	6.462.843
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>148.993.364</b>	<b>–</b>	<b>148.993.364</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(122.171)	–	(122.171)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(122.171)</b>	<b>–</b>	<b>(122.171)</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	140.333.863	–	–	140.333.863
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.816.466	–	1.816.466
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>140.333.863</b>	<b>1.816.466</b>	<b>–</b>	<b>142.150.329</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Forts.</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(72.634)	–	(72.634)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(72.634)</b>	<b>–</b>	<b>(72.634)</b>
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	38.548.211	–	–	38.548.211
	Terminkontrakte (Forwards)	–	18.265	–	18.265
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>38.548.211</b>	<b>18.265</b>	<b>–</b>	<b>38.566.476</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(933)	–	(933)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(933)</b>	<b>–</b>	<b>(933)</b>
<b>BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	641.013	2.980.070	–	3.621.083
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.805.285	–	1.805.285
	Aktien	10.870.447	896.735	–	11.767.182
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	3.031.214	–	3.031.214
	Terminkontrakte (Forwards)	–	154.579	–	154.579
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>11.511.460</b>	<b>8.867.883</b>	<b>–</b>	<b>20.379.343</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(126.199)	–	(126.199)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(126.199)</b>	<b>–</b>	<b>(126.199)</b>
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	35.095.853	532.138	–	35.627.991
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.872	–	7.872
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>35.095.853</b>	<b>540.010</b>	<b>–</b>	<b>35.635.863</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(149)	–	(149)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(149)</b>	<b>–</b>	<b>(149)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	442.651.648	–	442.651.648
	Organismen für gemeinsame Anlagen	119.941.755	3.407.634	–	123.349.389
	Aktien	1.581.036.392	33.151.866	–	1.614.188.258
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	184.163.676	–	184.163.676
	Börsengehandelte Rohstoffe	335.623.276	–	–	335.623.276
	Terminkontrakte (Forwards)	–	65.016.516	–	65.016.516
	Terminkontrakte (Futures)	3.967.462	–	–	3.967.462
	Optionen	23.915.389	–	–	23.915.389
	Optionsscheine	–	88.559.036	–	88.559.036
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>2.064.484.274</b>	<b>816.950.376</b>	<b>–</b>	<b>2.881.434.650</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(16.084.605)	–	(16.084.605)
	Optionen	(8.313.488)	–	–	(8.313.488)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(8.313.488)</b>	<b>(16.084.605)</b>	<b>–</b>	<b>(24.398.093)</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	–	9.662.125	–	9.662.125
	Organismen für gemeinsame Anlagen	2.120.819	197.469	–	2.318.288
	Aktien	32.699.642	666.138	–	33.365.780
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	4.178.909	–	4.178.909
	Börsengehandelte Rohstoffe	6.952.484	–	–	6.952.484
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.814.858	–	1.814.858
	Terminkontrakte (Futures)	91.828	–	–	91.828
	Optionen	532.999	–	–	532.999
	Optionsscheine	–	2.057.163	–	2.057.163
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>42.397.772</b>	<b>18.576.662</b>	<b>–</b>	<b>60.974.434</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(257.658)	–	(257.658)
	Optionen	(185.509)	–	–	(185.509)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(185.509)</b>	<b>(257.658)</b>	<b>–</b>	<b>(443.167)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	47.062.739	–	47.062.739
	Organismen für gemeinsame Anlagen	11.199.041	–	–	11.199.041
	Aktien	160.119.125	3.100.652	–	163.219.777
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	22.807.540	–	22.807.540
	Börsengehandelte Rohstoffe	34.232.554	–	–	34.232.554
	Terminkontrakte (Forwards)	–	660.975	–	660.975
	Terminkontrakte (Futures)	413.365	–	–	413.365
	Optionen	2.524.275	–	–	2.524.275
	Optionsscheine	–	9.224.705	–	9.224.705
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>208.488.360</b>	<b>82.856.611</b>	<b>–</b>	<b>291.344.971</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.790.803)	–	(4.790.803)
	Optionen	(891.632)	–	–	(891.632)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(891.632)</b>	<b>(4.790.803)</b>	<b>–</b>	<b>(5.682.435)</b>
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	613.547.504	–	613.547.504
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	37.621.950	–	37.621.950
	Credit Default Swaps	–	55.114	–	55.114
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.863.263	–	5.863.263
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	26.411.072	7.824.673	34.235.745
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>683.498.903</b>	<b>7.824.673</b>	<b>691.323.576</b>
	Credit Default Swaps	–	(46.988)	–	(46.988)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(11.621.219)	–	(11.621.219)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(11.668.207)</b>	<b>–</b>	<b>(11.668.207)</b>
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	2.739.921	3.073.872	–	5.813.793
	Organismen für gemeinsame Anlagen	106.277	230.907	–	337.184
	Aktien	18.872.663	629.788	–	19.502.451
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.202.567	–	1.202.567
	Börsengehandelte Rohstoffe	1.563.620	–	–	1.563.620
	Terminkontrakte (Forwards)	–	129.353	–	129.353
	Optionen	60.184	–	–	60.184
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>23.342.665</b>	<b>5.266.487</b>	<b>–</b>	<b>28.609.152</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(128.731)	–	(128.731)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(128.731)</b>	<b>–</b>	<b>(128.731)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>					
		JPY	JPY	JPY	JPY
	Aktien	15.004.460.100	–	–	15.004.460.100
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.683.437	–	7.683.437
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>15.004.460.100</b>	<b>7.683.437</b>	<b>–</b>	<b>15.012.143.537</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(41.410.420)	–	(41.410.420)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(41.410.420)</b>	<b>–</b>	<b>(41.410.420)</b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	1.535.299.266	–	–	1.535.299.266
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.227	–	2.227
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>1.535.299.266</b>	<b>2.227</b>	<b>–</b>	<b>1.535.301.493</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(42.170)	–	(42.170)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(42.170)</b>	<b>–</b>	<b>(42.170)</b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	467.649.573	–	–	467.649.573
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.244.388	–	1.244.388
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>467.649.573</b>	<b>1.244.388</b>	<b>–</b>	<b>468.893.961</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(55.097)	–	(55.097)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(55.097)</b>	<b>–</b>	<b>(55.097)</b>
<b>BNY Mellon S&amp;P 500® Index Tracker</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	35.997	–	–	35.997
	Aktien	36.533.926	–	–	36.533.926
	Terminkontrakte (Forwards)	–	274	–	274
	Terminkontrakte (Futures)	9.446	–	–	9.446
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>36.579.369</b>	<b>274</b>	<b>–</b>	<b>36.579.643</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3)	–	(3)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(3)</b>	<b>–</b>	<b>(3)</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	58.239.794	1.932.986	–	60.172.780
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>58.239.794</b>	<b>1.932.986</b>	<b>–</b>	<b>60.172.780</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe 31. Dezember 2020
<b>BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	4.830.629	84.765	–	4.915.394
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.080	–	6.080
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>4.830.629</b>	<b>90.845</b>	<b>–</b>	<b>4.921.474</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(74)	–	(74)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(74)</b>	<b>–</b>	<b>(74)</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	58.895.572	201.519.595	–	260.415.167
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.971.038	–	4.971.038
	Optionen	28.720	–	–	28.720
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>58.924.292</b>	<b>206.490.633</b>	<b>–</b>	<b>265.414.925</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.744.706)	–	(2.744.706)
	Terminkontrakte (Futures)	(5.487)	–	–	(5.487)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(5.487)</b>	<b>(2.744.706)</b>	<b>–</b>	<b>(2.750.193)</b>
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	5.207.301	–	5.207.301
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	474.230	–	474.230
	Aktien	19.060.283	–	–	19.060.283
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	2.639.505	–	2.639.505
	Börsengehandelte Rohstoffe	3.946.902	–	–	3.946.902
	Terminkontrakte (Forwards)	–	678.689	–	678.689
	Terminkontrakte (Futures)	3.603	–	–	3.603
	Optionen	196.328	–	–	196.328
	Optionsscheine	–	1.031.439	–	1.031.439
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>23.207.116</b>	<b>10.031.164</b>	<b>–</b>	<b>33.238.280</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(204.318)	–	(204.318)
	Optionen	(91.148)	–	–	(91.148)
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(91.148)</b>	<b>(204.318)</b>	<b>–</b>	<b>(295.466)</b>
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	37.062.371	51.620.038	1.550.000	90.232.409
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.763.033	–	1.763.033
	Terminkontrakte (Futures)	151.689	–	–	151.689
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>37.214.060</b>	<b>53.383.071</b>	<b>1.550.000</b>	<b>92.147.131</b>
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(332.738)	–	(332.738)



## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2020
-------	-----------------	---------	---------	---------	-----------------------------

#### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Forts.

	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Futures)	(48.837)	–	–	(48.837)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(48.837)</b>	<b>(332.738)</b>	<b>–</b>	<b>(381.575)</b>

#### BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund

	USD	USD	USD	USD
Organismen für gemeinsame Anlagen	37.326	–	–	37.326
Aktien	3.667.968	–	–	3.667.968
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>3.705.294</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.705.294</b>

#### BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD
Aktien	219.243.684	–	–	219.243.684
Terminkontrakte (Forwards)	–	36.670	–	36.670
Vorzugsanleihen	–	4.225.889	–	4.225.889
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>219.243.684</b>	<b>4.262.559</b>	<b>–</b>	<b>223.506.243</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.554)	–	(10.554)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(10.554)</b>	<b>–</b>	<b>(10.554)</b>

#### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	588.446.936	–	588.446.936
Terminkontrakte (Forwards)	–	2.183.004	–	2.183.004
<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>590.629.940</b>	<b>–</b>	<b>590.629.940</b>
Terminkontrakte (Forwards)	–	(77.833)	–	(77.833)
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>	<b>(77.833)</b>	<b>–</b>	<b>(77.833)</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021:

#### BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

	Anleihen EUR	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR	Summe EUR
<b>Einzelheiten</b>			
Anfangssaldo	596.439	7.122.782	7.719.221
Käufe	375.992	–	375.992
Verkäufe	–	(3.228.587)	(3.228.587)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(596.439)	(2.075.488)	(2.671.927)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte Verluste	–	(98.037)	(98.037)
Nicht realisierte (Verluste)/Gewinne	(3.195)	462.240	459.045
<b>Schlussaldo</b>	<b>372.797</b>	<b>2.182.910</b>	<b>2.555.707</b>

#### BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

	Organismen für gemeinsame Anlagen GBP	Summe GBP
<b>Einzelheiten</b>		
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(23.686)	(23.686)
Übertragungen in Stufe 3	1.057.288	1.057.288
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	23.686	23.686
Nicht realisierte Verluste	(1.033.605)	(1.033.605)
<b>Schlussaldo</b>	<b>23.683</b>	<b>23.683</b>

#### BNY Mellon Asian Income Fund

	Organismen für gemeinsame Anlagen USD	Summe USD
<b>Einzelheiten</b>		
Anfangssaldo	660	660
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(660)	(660)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
<b>Schlussaldo</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Anleihen USD	Summe USD
<b>Einzelheiten</b>		
Anfangssaldo	–	–
Käufe	17.371	17.371
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Anleihen USD	Gesamt USD
<b>Einzelheiten</b>		
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Verluste	(6.090)	(6.090)
<b>Schlussaldo</b>	<b>11.281</b>	<b>11.281</b>

#### BNY Mellon Global Credit Fund

	Anleihen USD	Summe USD
<b>Einzelheiten</b>		
Anfangssaldo	1.343.135	1.343.135
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(1.343.135)	(1.343.135)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
<b>Schlussaldo</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

#### BNY Mellon Global Equity Income Fund

	Organismen für gemeinsame Anlagen USD	Summe USD
<b>Einzelheiten</b>		
Anfangssaldo	5.902	5.902
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(5.902)	(5.902)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
<b>Schlussaldo</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

#### BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	791.689	791.689
Verkäufe	(7.011)	(7.011)
Übertragungen in Stufe 3	476.533	476.533
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	10	10
Nicht realisierte Gewinne	27.258	27.258
<b>Schlussaldo</b>	<b>1.288.479</b>	<b>1.288.479</b>

#### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD	Summe USD
Anfangssaldo	7.824.673	7.824.673
Käufe	3.382.940	3.382.940
Verkäufe	(1.612.643)	(1.612.643)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	25.438	25.438
Nicht realisierte Verluste	(691.308)	(691.308)
<b>Schlussaldo</b>	<b>8.929.100</b>	<b>8.929.100</b>

#### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Summe USD
Anfangssaldo	1.550.000	1.550.000
Käufe	350.000	350.000
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(1.550.000)	(1.550.000)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Verluste	(315)	(315)
<b>Schlussaldo</b>	<b>349.685</b>	<b>349.685</b>

#### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(3.000.000)	(3.000.000)
Übertragungen in Stufe 3	6.160.000	6.160.000
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

#### BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
<b>Schlussaldo</b>	<b>3.160.000</b>	<b>3.160.000</b>

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020:

#### BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen EUR	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR	Summe EUR
Anfangssaldo	2.408.332	11.398.966	13.807.298
Käufe	568.941	–	568.941
Verkäufe	(2.420.812)	(3.178.607)	(5.599.419)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte Gewinne/(Verluste)	188.806	(275.377)	(86.571)
Nicht realisierte Verluste	(148.828)	(822.200)	(971.028)
<b>Schlussaldo</b>	<b>596.439</b>	<b>7.122.782</b>	<b>7.719.221</b>

#### BNY Mellon Asian Income Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	660	660
<b>Schlussaldo</b>	<b>660</b>	<b>660</b>

#### BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Summe USD
Anfangssaldo	11.034	11.034
Käufe	–	–
Verkäufe	(2.078)	(2.078)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Verluste	(8.959)	(8.959)
Nicht realisierte Gewinne	3	3
<b>Schlussaldo</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

#### BNY Mellon Global Credit Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Summe USD
Anfangssaldo	927.221	927.221
Käufe	1.224.691	1.224.691
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(927.221)	(927.221)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	118.444	118.444
<b>Schlussaldo</b>	<b>1.343.135</b>	<b>1.343.135</b>

#### BNY Mellon Global Equity Income Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	5.902	5.902
<b>Schlussaldo</b>	<b>5.902</b>	<b>5.902</b>

#### BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	7.851.904	7.851.904
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Verluste	(27.231)	(27.231)
<b>Schlussaldo</b>	<b>7.824.673</b>	<b>7.824.673</b>

#### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Summe USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	1.550.000	1.550.000
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		

## 16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

### SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

#### BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Realisierte Gewinne	-	-
Nicht realisierte Gewinne	-	-
<b>Schlussaldo</b>	<b>1.550.000</b>	<b>1.550.000</b>

Übertragungen gelten als zu Beginn des Geschäftsjahres vollzogen.

Die Übertragung von Stufe 2 in Stufe 3 bezieht sich auf Anleihepositionen, deren Emittenten eine Verringerung der Handelsaktivität verzeichneten, wobei diese zum Geschäftsjahresende inaktiv (d. h. abgelaufen) war. Die Kurse dieser Wertpapiere wurden zu den Kosten oder dem beizulegenden Zeitwert unter Verwendung der Kursnotierung eines Maklers berechnet und führten zur Neuordnung in Stufe 3.

Die Übertragungen aus Stufe 3 beziehen sich auf Wertpapiere, die zu Anschaffungskosten bewertet wurden und in der Folge einem aktiven Handel und einer normalen Preisgestaltung unterlagen.

## 17. VERPFLICHTUNGEN UND EVENTUALVERBINDLICHKEITEN

Es bestanden keine Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten zum 31. Dezember 2021 oder 31. Dezember 2020.

## 18. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft macht von den Bestimmungen zur Haftungstrennung in Abschnitt 1405 (1) des Companies Act 2014 Gebrauch. Nach irischem Recht ist die Gesellschaft als Ganzes demnach generell nicht haftbar gegenüber Dritten, und generell besteht kein Potenzial für eine wechselseitige Haftung zwischen den Fonds.

## 19. WICHTIGE EREIGNISSE

Am 6. Januar 2021 wurden die Anteilhaber darüber informiert, dass die Global Exposure- and Leverage-Methode in Bezug auf den BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund, BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), BNY Mellon Global Real Return Fund (USD), BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund und BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) vom Commitment-Ansatz auf die „absolute VaR“-Methode umgestellt wird. Die Veränderung trat am 22. Januar 2021 in Kraft.

Der BNY Mellon Future Earth Fund, der BNY Mellon Future Food Fund und der BNY Mellon Future Life Fund wurden am 12. Januar 2021 aufgelegt.

Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wurde am 15. Januar 2021 geschlossen.

Der BNY Mellon Dynamic Total Return Fund wurde am 26. Februar 2021 geschlossen.

Am 26. Februar 2021 wurde dem BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) und dem BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund der Wortlaut der französischen Marktaufsichtsbehörde Autorité des Marchés Financiers hinzugefügt, um die Fonds in Frankreich als ESG-Fonds zu registrieren.

Der BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund wurde am 5. März 2021 geschlossen.

Am 5. März 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den Anforderungen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) zu entsprechen.

Der BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund wurde am 18. März 2021 geschlossen.

Der Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund wurde am 27. März 2021 aufgelegt.

## 19. WICHTIGE EREIGNISSE Forts.

Alle Fonds der Gesellschaft wurden mit Wirkung vom 9. April 2021 von der irischen Börse, die als Euronext Dublin handelt (die „irische Börse“), dekotiert.

Am 27. Mai wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, über das Shanghai-Hong Kong Stock Connect-Programm in chinesische A-Aktien zu investieren, die an der Shanghai Stock Exchange notiert sind: BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Global Emerging Markets Fund, BNY Mellon Global Equity Fund, BNY Mellon Global Equity Income Fund, BNY Mellon Global Opportunities Fund, BNY Mellon Global Real Return Fund (USD), BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), BNY Mellon Global Unconstrained Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR).

Am 17. Mai 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, in chinesische B-Aktien zu investieren: BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund.

Am 17. Mai 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, direkt in Indien zu investieren: BNY Mellon Asian Income Fund, BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Smart Cures Innovation.

Am 29. Juli 2021 wurde Anlegern der von der Mellon Investments Corporation („Mellon“) verwalteten Teilfonds der Wechsel des Anlageverwalters mit Wirkung vom 1. September 2021 mitgeteilt. Der Anlageverwalter der von Mellon verwalteten Teilfonds wird:

Name des Teilfonds	Neuer Anlageverwalter
BNY Mellon Efficient EM Debt Local Currency Beta Fund^ BNY Mellon Efficient Euro High Yield Beta Fund^ BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund BNY Mellon Targeted Return Bond Fund BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Insight North America LLC
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund BNY Mellon Euroland Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund BNY Mellon Mobility Innovation Fund BNY Mellon Small Cap Euroland Fund BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	Newton Investment Management North America LLC

Der BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund wurde am 18. November 2021 aufgelegt.

Die Zulassung des BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund, BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund, BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund, BNY Mellon US Opportunities Fund und BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund wurde am 8. Dezember 2021 von der Zentralbank widerrufen.

### Coronavirus („COVID-19“)

Der weltweite Ausbruch von COVID-19 im ersten Quartal 2020 hatte erhebliche negative Auswirkungen auf die globalen Finanzmärkte. Die Marktvolatilität hat deutlich zugenommen und dürfte sich auf absehbare Zeit auf hohem Niveau halten.

Die Entwicklungen werden sorgfältig überwacht. Angesichts der Art des Ausbruchs und der laufenden Entwicklungen besteht hohe Ungewissheit, und zum gegenwärtigen Zeitpunkt können keine Prognosen zu Ausmaß und Art der gesamten zukünftigen Auswirkungen auf die Gesellschaft gestellt werden.

Außer den vorgenannten Ereignissen sind zum Ende des Geschäftsjahres keine weiteren wichtigen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft eingetreten.



## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Die Gesellschaft gab am 4. Januar 2022 und am 2. April 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	Klasse T (Hedged)	CHF	0,0709	0,1052
	Klasse T (Hedged)	USD	0,1960	0,0553
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	0,0821	0,1291
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0104	0,0498
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0118	0,0524
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0092	0,0528
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0142	0,0510
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,2456	0,2975
	<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	0,0032
<b>BNY Mellon Asian Income Fund</b>	Klasse A (Acc)	EUR	0,0065	0,0094
	Klasse A (Inc)	USD	0,0042	0,0059
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0051	0,0074
	Klasse B (Acc)	USD	0,0055	0,0079
	Klasse C (Acc)	USD	0,0060	0,0086
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0047	0,0068
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0057	0,0083
	Klasse W (Inc)	USD	0,0047	0,0067
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0059	0,0086
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	Klasse E (Acc)	USD	0,0052	-
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0052	-
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0002	-
	Klasse G (Acc)	USD	0,0009	-
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0006	-
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0007	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0016	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0009	-
	<b>BNY Mellon Brazil Equity Fund</b>	Sterling B (Acc)	GBP	0,0519
Sterling C (Inc)	GBP	0,0669	-	
Klasse G (Acc)	EUR	0,0598	-	
Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0512	-	
Sterling W (Acc)	GBP	0,0745	-	
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0018	-
	Klasse C (Acc)	USD	0,0018	-
	Klasse E (Acc)	USD	0,0018	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0018	-
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0018	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0018	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0018	-
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0018	-
	Klasse X (Acc)	USD	0,0018	-
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,0018	-
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0018	-

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	Klasse C (Acc)	USD	0,0033	-
	Klasse G (Acc)	USD	0,0024	-
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0024	-
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0020	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0069	-
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0061	-
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0050	-
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0008	-
	Klasse X (Acc)	USD	0,0149	-
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0121	0,0120
	Klasse A (Inc)	USD	0,0116	0,0113
	Klasse C (Acc)	USD	0,0121	0,0120
	Klasse C (Inc)	USD	0,0116	0,0113
	Klasse E (Acc)	USD	0,0121	0,0121
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0121	0,0120
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0120	0,0122
	Klasse E (Inc)	USD	0,0116	0,0114
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	0,0116	0,0114
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0115	0,0115
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0121	0,0120
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0116	0,0113
	Klasse W (Acc)	USD	0,0117	0,0115
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	0,1213	0,1200
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0121	0,0120
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,1223	0,1179
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,1233	0,1190
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0120	0,0122
	Klasse W (Inc)	USD	0,0116	0,0114
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0116	0,0113
Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0115	0,0115	
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>	Klasse X (Acc)	USD	0,0122	0,0121
	Klasse A (Acc)	USD	0,0042	0,0043
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0053	0,0054
	Klasse W (Acc)	USD	0,0048	0,0048
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fonds</b>	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0047	0,0048
	Klasse A (Acc)	USD	0,0113	0,0111
	Klasse C (Acc)	USD	0,0113	0,0111
	Klasse C (Inc)	USD	0,0101	0,0098
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0105	0,0103
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0105	0,0103
	Klasse N (Acc)	USD	0,0100	0,0098
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	0,0101	0,0099
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0033	0,0032
Klasse W (Acc)	USD	0,0113	0,0111	

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Forts.</b>	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0105	0,0103
	Klasse W (Inc)	USD	0,0102	0,0099
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0109	0,0106
	Klasse X (Acc)	USD	0,0114	0,0112
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0113	0,0114
	Klasse X (Inc)	USD	0,0109	0,0106
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0015	0,0100
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	Klasse A (Inc)	USD	0,0126	0,0125
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0132	0,0134
	Klasse C (Acc)	USD	0,0162	0,0163
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0151	0,0152
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0154	0,0159
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0148	0,0149
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0145	0,0146
	Klasse K (Acc)	USD	0,0158	0,0159
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	0,0150	0,0151
	Klasse L (Acc)	USD	0,0159	0,0160
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	0,0151	0,0152
	Klasse L (Inc) (Hedged)^	EUR	-	0,0064
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0144	0,0148
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,0124	0,0127
	Klasse W (Acc)	USD	0,0162	0,0164
	Klasse W (Inc)	USD	0,0140	0,0139
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0117	0,0117
	Sterling W (Inc) (hedged)	GBP	0,0139	0,0142
	Klasse X (Acc)	USD	0,0133	0,0134
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0018	0,0136
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,2012	1,8605
	Klasse G (Inc)	USD	0,8137	0,7926
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9695	0,9507
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9559	0,9301
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,8552	0,8317
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8107	0,7855
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,3499	1,3517
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>	Klasse X	USD	1,9941	1,9333
	Klasse C (Inc)	USD	0,0080	0,0077
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0104	0,0102
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	Klasse X (Inc)	USD	0,0126	0,0120
	Klasse A (Inc)	USD	0,0058	0,0036
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0084	0,0052
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0119	0,0076
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0130	0,0086
	Klasse C (Inc)	USD	0,0069	0,0044
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0087	0,0057

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.</b>	Sterling C (Acc)	GBP	0,0199	0,0136
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0101	0,0067
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,0055	0,0035
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,0110	0,0074
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0081	0,0055
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0095	0,0062
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0084	0,0057
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0069	0,0047
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>	Klasse W (Acc)	USD	0,0146	0,0112
	Klasse X (Inc)	USD	0,0127	0,0097
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0164	0,0123
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0144	0,0110
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0159	0,0120
	Klasse W (Acc)	USD	0,0167	0,0125
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0154	0,0116
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0153	0,0118
	Klasse X (Acc)	USD	0,0170	0,0129
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	Klasse A (Inc)	EUR	-	0,0008
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0008	0,0016
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0016	0,0025
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0013	0,0020
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0016	0,0022
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>	Klasse W (Acc)	EUR	0,1334	0,1273
	Klasse X	EUR	0,3187	0,3039
<b>BNY Mellon Future Earth Fund</b>	Klasse C (Acc)	USD	0,0038	-
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0100	-
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0040	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0059	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0062	-
<b>BNY Mellon Future Food Fund</b>	Klasse E (Acc)	EUR	0,0085	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0045	-
<b>BNY Mellon Future Life Fund</b>	Klasse E (Acc)	EUR	0,0104	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0063	-
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	Klasse C	USD	0,0076	-
	Klasse C (Inc)	USD	0,0017	0,0016
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0041	-
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,0027	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0037	-
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0016	-
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0039	-
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0039	-
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0086	-
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0102	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0195	-
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0186	-

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Global Credit Fund Forts.</b>	Klasse X (Acc)	USD	0,0263	-
	Klasse X (Acc)	JPY	0,7812	-
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0259	-
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	0,7309	-
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>	Klasse A (Inc)	USD	0,0027	0,0029
	Klasse C	USD	0,0054	0,0055
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0044	0,0047
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0024	0,0026
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,0042	0,0043
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	0,0019	0,0040
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0036	0,0037
	Klasse W	USD	0,0055	0,0055
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0044	0,0045
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0050	0,0053
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	0,6136	0,6397
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	0,5917	0,6133
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,0048	0,0050
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0046	0,0048
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0049	0,0051
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0048	0,0050
	<b>BNY Mellon Global Equity Fund</b>	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,0031
Klasse W (Acc)		USD	0,0084	-
Klasse W (Acc)		EUR	0,0085	-
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>	Klasse A	EUR	0,0157	0,0157
	Klasse A (Inc)	USD	0,0085	0,0083
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0077	0,0077
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0106	0,0106
	Klasse B	USD	0,0146	0,0144
	Klasse B	EUR	0,0156	0,0157
	Klasse B (Inc)	USD	0,0104	0,0102
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0120	0,0119
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0121	0,0121
	Klasse C (Inc)	USD	0,0109	0,0107
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0120	0,0120
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0127	0,0127
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0078	0,0078
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0071	0,0069
	Klasse W	USD	0,0123	0,0121
	Klasse W	EUR	0,0142	0,0143
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0072	0,0070
	Klasse W (Inc)	USD	0,0093	0,0091
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0109	0,0108
Sterling W (Acc)	GBP	0,0147	0,0148	

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts.</b>	Sterling W (Inc)	GBP	0,0111	0,0112
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0103	0,0102
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0114	0,0114
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0073	0,0072
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0074	0,0074
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0070	0,0070
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>	Klasse C (Inc)	USD	0,0120	0,0118
	Klasse W (Acc)	USD	0,0153	0,0153
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0139	0,0142
	Klasse X (Inc)	USD	0,0126	0,0125
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fonds</b>	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,0115	0,0113
	Klasse A (Acc)	USD	0,0110	0,0106
	Klasse A (Inc)	USD	0,0096	0,0091
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0097	0,0094
	Klasse B (Acc)	SGD	0,0135	0,0130
	Klasse B (Acc)	USD	0,0112	0,0107
	Klasse B (Inc)	USD	0,0098	0,0093
	Klasse B (Inc)	SGD	0,0126	0,0120
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0060	0,0049
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0063	0,0051
	Klasse E (Inc)	USD	0,0101	0,0096
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0102	0,0099
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0094	0,0091
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0103	0,0098
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0090	0,0085
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,0141	0,0135
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	0,0131	0,0125
	Klasse W (Acc)	USD	0,0115	0,0110
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0107	0,0102
	Klasse W (Inc)	USD	0,0100	0,0095
Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0093	0,0089	
<b>BNY Mellon Global Leaders Fund</b>	Klasse E (Acc)	USD	0,0025	-
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0018	-
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0027	-
<b>BNY Mellon Global Opportunities Fund</b>	Klasse W (Acc)	USD	0,0079	-
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	Klasse A	EUR	0,0036	-
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0027	-
	Klasse C	EUR	0,0115	-
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0093	-
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0089	-
	Klasse G (Inc)	EUR	0,0086	-
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	0,0024	-
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	0,0024	-
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	0,0024	-

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.</b>	Klasse W	EUR	0,0144	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0109	-
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0110	-
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0132	-
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>	Sterling B (Acc)	GBP	0,0012	-
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0011	-
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0075	-
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0118	-
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0105	-
	Sterling X (Acc)	GBP	0,0239	-
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)</b>	Klasse A	USD	0,0009	-
	Klasse C	USD	0,0100	-
	Klasse C (Inc)	USD	0,0077	-
	Klasse G (Acc)	USD	0,0073	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0119	-
	Klasse W (Inc)	USD	0,0105	-
	<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0113
Klasse A (Inc)	USD	0,0092	0,0088	
Klasse C (Acc)	USD	0,0131	0,0127	
Klasse G (Acc)	USD	0,0118	0,0114	
Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0104	0,0100	
Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0085	0,0081	
Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0120	0,0116	
Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0096	0,0092	
Klasse W (Acc)	USD	0,0141	0,0136	
Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0122	0,0119	
Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0126	0,0122	
Klasse W (Inc)	USD	0,0110	0,0106	
Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0102	0,0097	
Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0132	0,0131	
Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0105	0,0103	
Klasse X (Acc)	USD	0,0162	0,0158	
Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0141	0,0140	
Klasse Y (Acc)	USD	0,0163	0,0158	
Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	0,0153	0,0152	
Klasse Z (Acc)	USD	0,0119	0,0116	
Klasse Z (Inc)	USD	0,0117	0,0112	
Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0125	0,0124	
Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0110	0,0108	
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	Klasse W (Acc)	USD	0,0083	-
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0199	-
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>	Klasse C	USD	0,0013	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0058	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0063	-

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity</b>	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0006	-
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0034	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0034	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0382	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0350	-
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0083	-
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0032	-
	<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>	Klasse S (Acc) 1	USD	0,0055
Klasse W		EUR	0,0042	-
Klasse W		USD	0,0037	-
Klasse W (Hedged)		USD	0,0040	-
Klasse W (Acc) (Hedged)		SGD	0,0020	-
Klasse W (Inc)		USD	0,0035	-
Sterling W (Acc)		GBP	0,0044	-
Sterling W (Inc)		GBP	0,0043	-
Sterling X		GBP	0,0245	-
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>		Klasse E (Acc)	USD	0,0007
	Klasse E (Acc)	CHF	0,0007	-
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0006	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0006	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0009	-
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0006	-
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	Klasse W (Acc)	EUR	0,0175	-
<b>BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund</b>	Klasse A (Acc)	EUR	0,0023	0,0024
	Klasse A (Acc)	USD	0,0022	0,0023
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0022	0,0023
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0036	0,0037
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0050	0,0050
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0047	0,0048
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0036	0,0037
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0021	0,0023
	Klasse V (Acc)^	EUR	-	0,0038
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0043	0,0043
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0040	0,0041
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0041	0,0042
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0041	0,0043
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0039	0,0040
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0040	0,0042
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0058	0,0058
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0044	0,0045
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0043	0,0044
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,0043	0,0044



## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)</b>	Klasse A (Acc)	EUR	0,0009	-
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0006	-
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0118	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0114	-
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0065	-
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0089	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0010	-
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0087	-
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0089	-
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0086	-
<b>BNY Mellon Targeted Return Bond Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0001	-
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0023	0,0019
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	Klasse A (Acc)	EUR	0,0074	0,0077
	Klasse B (Inc)	USD	0,0068	0,0068
	Klasse C (Acc)	USD	0,0043	0,0054
	Klasse C (Inc)	USD	0,0074	0,0075
	Klasse E (Inc)	USD	0,0076	0,0077
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0074	0,0076
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0078	0,0082
	Sterling E (Inc)	GBP	0,0070	0,0073
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0070	0,0072
	Klasse W (Acc)	USD	0,0084	0,0085
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0075	0,0078
	Klasse W (Inc)	USD	0,0076	0,0076
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0069	0,0072
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	Klasse A (Acc)	USD	0,0143	-
	Klasse A (Inc)	USD	0,0047	-
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0023	0,0023
	Klasse C (Acc)	USD	0,0175	-
	Klasse E (Acc)	USD	0,0168	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0151	-
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0165	-
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	0,0142	-
	Klasse G (Acc)	USD	0,0015	-
	Sterling G (Inc) (Hedged)	GBP	0,0142	-
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0160	-
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0137	-
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0138	-
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	0,0140	-
	Klasse P (Acc)	USD	0,0138	-
	Klasse P (Acc) (Hedged)	AUD	0,0137	-
	Klasse P (Acc) (Hedged)	EUR	0,0139	-
	Klasse P (Inc)	USD	0,0137	-
Klasse P (Inc) (Hedged)	AUD	0,0137	-	

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	4. Januar 2022	1. April 2022
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Forts.</b>	Klasse P (Inc) (Hedged)	EUR	0,0139	-
	Klasse W (Acc)	USD	0,0176	-
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0147	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0153	-
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0164	-
	Klasse W (Inc)	USD	0,0148	-
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,0141	-
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0142	-
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0139	-
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0139	-
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	0,0137	-
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,0142	-
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0139	-
	<b>Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund</b>	Klasse G (Acc)	EUR	0,0005
Klasse W (Acc)		EUR	0,0008	0,0008
Klasse W (Inc)		EUR	0,0005	0,0008
Klasse X (Acc)		EUR	0,0017	0,0018
Klasse Z (Acc)		EUR	0,0010	0,0011
<b>Responsible Horizons Euro Impact Bond Fonds</b>	Klasse A (Acc)^	EUR	-	0,0005
	Klasse C (Acc)^	EUR	-	0,0009
	Klasse E (Acc)^	EUR	-	0,0011
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	-	0,0012
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	-	0,0012
	Klasse G (Acc)^	EUR	-	0,0009
	Klasse W (Acc)^	EUR	-	0,0010
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	-	0,0010
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	-	0,0011
	Klasse X (Acc)^	EUR	-	0,0014
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	USD	-	0,0014
Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	-	0,0014	

^ Diese Anteilsklasse wurde im ersten Quartal 2022 aufgelegt.

Die Gesellschaft gab am 1. Februar 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Februar 2022
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	Klasse N (Inc)	USD	0,0032
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,2903
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0036
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0038
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0022

## 20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Die Gesellschaft gab am 1. März 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. März 2022
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	Klasse N (Inc)	USD	0,0032
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,5194
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0022
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0023
<b>BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund</b>	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0023

Der Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund wurde am 10. Januar 2022 aufgelegt.

Nach dem Bilanzstichtag sind die Finanzmärkte hauptsächlich aufgrund der durch den Konflikt zwischen Russland und der Ukraine ausgelösten geopolitischen Spannungen sowie der Auswirkungen der verhängten Sanktionen gefallen. Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts hatte die Realisierung des Dominoeffekts auf die Wirtschaft und Märkte erst langsam eingesetzt. Die Verwaltungsgesellschaft und der/die Anlageverwalter werden wie immer weiterhin die Anlageperformance im Einklang mit den Anlagezielen der jeweiligen Teilfonds überwachen.

Mit Ausnahme der zuvor genannten hat es nach Ablauf des Geschäftsjahres keine Ereignisse gegeben, die nach Auffassung der Verwaltungsgesellschaft eine Auswirkung auf den Jahresabschluss für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr hätten haben können.

## 21. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Jahresabschluss wurde am 14. April 2022 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

## BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (ungeprüft)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.250% 15-Mar-2028	49.510.000	49.097.287	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.250% 15-Mar-2028	49.510.000	48.892.228
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	39.031.384	41.198.955	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021	26.611.000	26.611.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021	26.611.000	26.659.498	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2021	26.545.000	26.545.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2021	26.545.000	26.580.355	Insight Liquidity Funds PLC - ILF EUR Cash Fund	25.291.581	24.718.431
Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051	3.100.000.000	24.234.732	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Sep-2021	23.295.000	23.295.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Sep-2021	23.295.000	23.335.949	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2021	22.500.000	22.502.981
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Aug-2021	19.200.000	19.247.883	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2021	21.197.000	21.197.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021	19.145.000	19.180.151	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-May-2021	21.161.000	21.163.380
Japan Government Forty Year Bond 0.500% 20-Mar-2060	2.726.000.000	19.170.446	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Apr-2021	21.150.000	21.150.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2022	21.500.000	18.348.136	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jan-2021	21.145.000	21.145.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	21.000.000	18.161.577	Japan Government Forty Year Bond 0.500% 20-Mar-2060	2.726.000.000	19.282.398
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Dec-2021	21.000.000	17.831.349	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Aug-2021	19.200.000	19.200.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	21.000.000	17.830.864	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021	19.145.000	19.150.666
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021	21.000.000	17.608.641	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Nov-2021	21.000.000	18.617.844
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Nov-2021	21.000.000	17.593.112	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Dec-2021	21.000.000	18.589.820
Insight Liquidity Funds PLC - ILF EUR Cash Fund	18.014.274	17.587.305	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021	21.000.000	18.165.294
United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021	21.000.000	17.565.639	United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021	21.000.000	17.923.427
United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	21.000.000	17.450.188	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021	21.000.000	17.833.631
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021	21.000.000	17.435.586	United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	21.000.000	17.766.494
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-May-2021	21.000.000	17.393.116	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021	21.000.000	17.596.772
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Mar-2021	21.000.000	17.335.731	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Mar-2021	21.000.000	17.587.196
United States Cash Management Bill 0.000% 15-Apr-2021	21.000.000	17.334.435	United States Cash Management Bill 0.000% 15-Apr-2021	21.000.000	17.554.110
Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040	2.190.000.000	17.279.389	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-May-2021	21.000.000	17.439.671
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021	21.000.000	17.261.857	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Feb-2021	20.500.000	16.980.027
Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022	17.000.000	17.029.750	Japan Government Twenty Year Bond 0.000% 20-Sep-2040	2.190.000.000	16.563.480
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-May-2021	17.000.000	17.020.813	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021	20.000.000	16.455.480
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	14.600.000	14.631.982	Australia Government Bond 0.000% 21-Jun-2051	27.900.000	14.829.653
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.450% 01-Mar-2036	13.370.000	13.972.608	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	14.600.000	14.600.000
China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	96.000.000	13.442.382	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.000% 01-Mar-2036	13.370.000	14.012.969
Republic of Austria Government Bond '144A' 2.100% 20-Sep-2117	6.480.000	11.673.453	Japan Government Thirty Year Bond 0.000% 20-Jun-2050	1.533.000.000	11.716.896
French Republic Government Bond OAT '144A' 0.750% 25-May-2052	11.170.000	11.560.950	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.000% 25-May-2052	11.170.000	11.410.155
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067	9.600.000	11.337.600	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067	8.400.000	10.461.180
China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030	81.600.000	10.402.435	China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030	75.000.000	9.637.528

## BNY Mellon Absolute Return Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 29-Jan-2021	15.000.000	14.999.914	United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 29-Jan-2021	15.000.000	15.000.000
United Kingdom Gilt 8.000% 07-Jun-2021	9.000.000	9.066.960	Insight Liquidity Funds Plc - GBP Liquidity Fund	14.100.000	14.100.000
Calyon London 0.020% 04-Feb-2021	8.000.000	8.000.000	Bank of Nova Scotia/The 0.459% 11-Jun-2021	9.000.000	9.002.800
Coöperatieve Rabobank UA 0.010% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000	OP Corporate Bank plc 0.406% 30-May-2021	9.000.000	9.002.000
Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 01-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000	Credit Suisse 0.130% 12-Nov-2021 CD	9.000.000	9.000.365
Mizuho Bank Ltd (Zero Coupon) 0.050% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale (Zero Coupon) 0.000% 09-Mar-2021 CP	9.000.000	9.000.000
Rabobank International London 0.050% 12-Mar-2021	8.000.000	8.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0.030% 17-Feb-2021 CD	9.000.000	9.000.000
Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	7.999.947	United Kingdom Gilt 8.000% 07-Jun-2021	9.000.000	9.000.000
Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021 CD	8.000.000	7.999.939	Swedbank AB 0.000% 10-May-2021 CP	9.000.000	8.999.749
Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 05-Mar-2021 CD	8.000.000	7.999.860	Banco Santander SA (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 04-May-2021	8.000.000	7.999.844	Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000
Euroclear Bank SA/NV 0.000% 12-Jul-2021 CD	8.000.000	7.998.378	Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 05-Mar-2021 CD	8.000.000	8.000.000
Nordea Bank Abp 0.000% 29-Jan-2021 CD	6.500.000	6.499.988	Barclays Bank Plc (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021 CD	8.000.000	8.000.000
Bred Banque Populaire SA (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021 CP	6.000.000	5.999.980	Calyon London 0.020% 04-Feb-2021	8.000.000	8.000.000
Bred Banque Populaire SA (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2021 CP	6.000.000	5.999.934	Coöperatieve Rabobank UA 0.010% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000
FMS Wertmanagement 0.875% 14-May-2021	5.200.000	5.211.544	Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 01-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000
HSBC UK Bank Plc 'EMTN' FRN 0.932% 17-Sep-2022	5.000.000	5.032.450	Euroclear Bank SA/NV (Zero Coupon) 0.000% 08-Jan-2021 CD	8.000.000	8.000.000
United Kingdom Gilt 3.750% 07-Sep-2021	5.000.000	5.028.700	Handelsbanken 0.090% 18-Jan-2021 CD	8.000.000	8.000.000
Credit Agricole 0.020% 15-Feb-2021 CD	5.000.000	5.000.000	Mizuho Bank Ltd (Zero Coupon) 0.050% 04-Feb-2021 CD	8.000.000	8.000.000
Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 02-Mar-2021 CD	5.000.000	5.000.000	Rabobank International London 0.050% 12-Mar-2021	8.000.000	8.000.000
IT Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 12-Mar-2021 CD	5.000.000	5.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 04-May-2021	8.000.000	8.000.000
Toronto-Dominion Bank/The 0.620% 01-Dec-2022 CD 01-Dec-2022	5.000.000	5.000.000	Bank of America Merrill Lynch (Zero Coupon) 0.000% 30-Apr-2021 CD	8.000.000	7.999.934
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale (Zero Coupon) 0.000% 26-Mar-2021 CP	5.000.000	4.999.904	Societe Nationale SNCF SA 0.000% 14-May-2021 CP	8.000.000	7.999.901
Mizuho Bank Ltd (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2021 CD	5.000.000	4.999.819	Zuercher Kantonbank 0.000% 22-Jun-2021 CD	8.000.000	7.999.773
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 29-Nov-2021	5.000.000	4.999.773	Euroclear Bank SA/NV 0.000% 12-Jul-2021 CD	8.000.000	7.999.525
ABN AMRO Bank NV 0.000% 06-Apr-2021 CD	5.000.000	4.999.753	Nordea Bank Abp 0.000% 29-Jan-2021 CD	6.500.000	6.500.000
PACCAR Financial Plc 0.000% 18-May-2021 CP	5.000.000	4.999.390	Bred Banque Populaire SA (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2021 CP	6.000.000	6.000.000
BNP Paribas SA CD 0.000% 03-Dec-2021 CD	5.000.000	4.999.166	Bred Banque Populaire SA (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021 CP	6.000.000	6.000.000
PACCAR Financial Plc 0.000% 18-Aug-2021 CP	5.000.000	4.999.118	BNP Paribas (Zero Coupon) 0.020% 08-Feb-2021 CD	5.500.000	5.500.000
PACCAR Financial Plc 0.000% 18-Nov-2021 CP	5.000.000	4.999.118	FMS Wertmanagement 0.875% 14-May-2021	5.200.000	5.200.000
ABN AMRO Bank NV 0.000% 01-Sep-2021 CD	5.000.000	4.999.058	ABN AMRO Bank NV 0.000% 01-Sep-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Banque Federative du Credit Mutuel 0.000% 13-Sep-2021 CP	5.000.000	4.998.970	ABN AMRO Bank NV 0.000% 05-Jan-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 29-Nov-2021 CD	5.000.000	4.998.970	ABN AMRO Bank NV 0.000% 06-Apr-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0.000% 04-Aug-2021 CP	5.000.000	4.998.887	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale (Zero Coupon) 0.000% 26-Mar-2021 CP	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-May-2022 30-May-2022	5.000.000	4.998.878	Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale 0.000% 04-Aug-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Societe Nationale SNCF SA 0.000% 14-Sep-2021 CP	5.000.000	4.998.821	Banco Santander SA 0.000% 06-Jul-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 27-Aug-2021 CD	5.000.000	4.998.816	Banco Santander SA 0.000% 06-Oct-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Mizuho Bank Ltd 0.000% 01-Sep-2021 CD	5.000.000	4.998.792	Bank of America Corp 0.000% 29-Oct-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 28-Feb-2022 CD	5.000.000	4.998.629	Banque Federative du Credit Mutuel 0.000% 13-Sep-2021 CP	5.000.000	5.000.000
BNP Paribas SA 0.000% 07-Sep-2021 CD	5.000.000	4.998.491	BNP Paribas SA 0.000% 07-Sep-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Banco Santander SA 0.000% 06-Oct-2021 CP	5.000.000	4.998.488	BNP Paribas SA CD 0.000% 03-Dec-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Banco Santander SA 0.000% 06-Jul-2021 CP	5.000.000	4.998.380	Credit Agricole 0.020% 15-Feb-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Banco Santander SA 0.000% 01-Feb-2022 CP	5.000.000	4.998.061	Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.000% 14-Apr-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Nordea Bank Abp 0.000% 25-Feb-2022 CP	5.000.000	4.997.940	Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 02-Mar-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Bank of America Corp 0.000% 29-Oct-2021 CD	5.000.000	4.997.508	IT Agricole Corporate & Investment Bank 0.020% 12-Mar-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Banque Federative du Credit Mutuel 0.000% 14-Mar-2022 CP	5.000.000	4.997.508	Mizuho Bank Ltd (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2021 CD	5.000.000	5.000.000
SWEDBANK AB 0.000% 10-Nov-2021 CP	5.000.000	4.997.481	Mizuho Bank Ltd 0.000% 01-Sep-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Dexia Credit Local SA 0.000% 01-Apr-2022 CP	5.000.000	4.997.388	MUFG Bank Ltd (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.000% 22-Mar-2022 CP	5.000.000	4.996.263	PACCAR Financial Plc 0.000% 18-May-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Swedbank AB 0.000% 10-May-2022 CP	5.000.000	4.994.056	PACCAR Financial Plc 0.000% 18-Aug-2021 CP	5.000.000	5.000.000
Bank of America Corp 0.000% 29-Apr-2022 CD	5.000.000	4.990.047	PACCAR Financial Plc 0.000% 18-Nov-2021 CP	5.000.000	5.000.000
National Australia Bank Ltd 'GMTN' 0.000% 05-Sep-2022 CD	5.000.000	4.983.795	Societe Nationale SNCF SA 0.000% 14-Sep-2021 CP	5.000.000	5.000.000
SNCF Reseau 'EMTN' 5.500% 01-Dec-2021	4.000.000	4.103.080	Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 27-Aug-2021 CD	5.000.000	5.000.000
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.875% 15-Mar-2022	4.000.000	4.009.320	Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 29-Nov-2021 CD	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 10-May-2021	4.000.000	4.000.000	SWEDBANK AB 0.000% 10-Nov-2021 CP	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 22-Nov-2021	4.000.000	3.999.954	Toronto-Dominion Bank 0.100% 01-Dec-2021 CD	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 29-Mar-2021	4.000.000	3.999.944	United Kingdom Gilt 1.500% 22-Jan-2021	5.000.000	5.000.000
Euroclear Bank SA/NV 0.000% 18-Feb-2022 CD	4.000.000	3.998.926	United Kingdom Gilt 3.750% 07-Sep-2021	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 01-Nov-2021	4.000.000	3.998.898	United Kingdom Treasury Bill (Zero coupon) 0.000% 29-Nov-2021	5.000.000	5.000.000
OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.000% 03-Aug-2022 CP	4.000.000	3.992.435			

## BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-Oct-2021	19.350.000	19.551.980	French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-Oct-2021	19.350.000	19.372.041
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021	16.500.000	16.534.295	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021	16.500.000	16.501.147
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3.250% 04-Jul-2021	16.000.000	16.136.220	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3.250% 04-Jul-2021	16.000.000	16.000.000
Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021	13.000.000	13.011.830	Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021	13.000.000	13.000.180
Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 08-Oct-2021	13.000.000	13.007.440	Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021	13.000.000	13.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Jul-2021	13.000.000	13.006.431	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Jul-2021	13.000.000	13.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Jul-2021	13.000.000	13.003.317	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Jul-2021	13.000.000	13.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022	12.500.000	12.521.777	French Republic Government Bond OAT 3.750% 25-Apr-2021	11.450.000	11.450.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2022	10.400.000	10.428.317	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2021	8.700.000	8.700.000
Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	10.271.790	10.030.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	8.000.000	8.001.357
French Republic Government Bond OAT 3.750% 25-Apr-2021	9.000.000	9.058.190	Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021	7.000.000	7.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2021	8.700.000	8.704.576	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 23-Jun-2021	7.000.000	7.000.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	8.000.000	8.004.034	French Republic Government Bond OAT (Zero Coupon) 0.000% 25-May-2021	6.700.000	6.700.000
Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022	7.500.000	7.513.275	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021	6.600.000	6.600.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 23-Jun-2021	7.000.000	7.010.027	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2021	6.600.000	6.600.000
Kingdom of Belgium Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Mar-2022	6.700.000	6.710.334	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2021	6.000.000	6.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021	6.600.000	6.609.903	Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	6.156.501	6.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2021	6.600.000	6.600.783	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021	5.800.000	5.802.194
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Mar-2022	6.000.000	6.017.098	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2021	5.500.000	5.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2021	6.000.000	6.009.753	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Nov-2021	5.000.000	5.000.304
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021	5.800.000	5.812.291	Airbus SE (Zero Coupon) 0.000% 14-Jun-2021	5.000.000	5.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Feb-2022	5.500.000	5.514.411	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	4.700.000	4.700.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2021	5.500.000	5.500.724	Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021	4.500.000	4.501.521
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Nov-2021	5.000.000	5.013.731	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Aug-2021	4.500.000	4.500.000
French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-May-2021	5.000.000	5.010.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 13-Oct-2021	4.500.000	4.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2022	5.000.000	5.009.273	Netherlands Government Bond '144A' 3.250% 15-Jul-2021	4.400.000	4.400.000
Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021	5.000.000	5.003.800	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2021	4.000.000	4.000.000
Airbus SE (Zero Coupon) 0.000% 14-Jun-2021	5.000.000	5.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 01-Sep-2021	4.000.000	4.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021	4.700.000	4.707.616	Kering SA (Zero Coupon) 0.000% 30-Sep-2022	3.200.000	3.794.475
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 13-Oct-2021	4.500.000	4.507.212			
Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021	4.500.000	4.507.155			
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Aug-2021	4.500.000	4.503.357			
Netherlands Government Bond '144A' 3.250% 15-Jul-2021	4.400.000	4.442.420			

BNY Mellon Asian Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Tata Consultancy Services Ltd	62.291	2.643.316	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	267.656	2.860.391
By-health Co Ltd	390.543	2.033.523	Ilijin Materials Co Ltd	33.801	2.842.177
Tencent Holdings Ltd	24.769	1.989.068	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	754.000	2.735.297
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	89.000	1.939.059	Orocobre Ltd	386.020	2.081.064
Yum China Holdings Inc	30.371	1.850.652	Titan Co Ltd	93.747	2.063.843
LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	111.100	1.849.722	Housing Development Finance Corp Ltd	57.551	2.048.730
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	173.000	1.743.243	Samsung SDI Co Ltd	3.410	1.980.756
Hindustan Unilever Ltd	50.882	1.658.322	Meituan '144A'	50.656	1.972.613
Tencent Music Entertainment Group ADR	90.215	1.611.667	Info Edge India Ltd	24.611	1.935.210
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	94.700	1.572.134	AIA Group Ltd	148.000	1.805.273
Samsung Electronics Co Ltd	18.054	1.430.134	Bilibili Inc ADR	14.389	1.695.367
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	112.500	1.405.017	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	77.000	1.670.006
Godrej Consumer Products Ltd	120.839	1.277.513	Asian Paints Ltd	40.476	1.578.855
LG Chem Ltd	1.691	1.262.379	Tencent Holdings Ltd	21.097	1.559.756
NARI Technology Co Ltd 'A'	252.300	1.131.374	Maruti Suzuki India Ltd	15.916	1.547.732
Vitasoy International Holdings Ltd	317.627	1.106.070	Jubilant Foodworks Ltd	36.183	1.424.658
Sungrow Power Supply Co Ltd	50.100	1.020.686	Xinyi Solar Holdings Ltd	640.000	1.358.399
Maruti Suzuki India Ltd	9.619	1.006.340	Tencent Music Entertainment Group ADR	69.741	1.340.762
Samsung SDI Co Ltd	1.528	999.738	Alibaba Group Holding Ltd	49.700	1.186.230
New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	9.197	978.774	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	94.500	980.121
AIA Group Ltd	74.600	976.673	Elite Material Co Ltd	118.000	973.138
Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	49.700	976.034	Vale Indonesia Tbk PT	2.743.962	929.558
Housing Development Finance Corp Ltd	26.627	960.885	PVR Ltd	52.245	814.498
Meituan '144A'	19.510	867.687	IDP Education Ltd	41.358	773.098
Delta Electronics Inc	80.000	792.162	Tata Consultancy Services Ltd	14.915	652.681
PB Fintech Ltd	48.312	784.844	NARI Technology Co Ltd 'A'	95.300	608.994
Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.014	748.635	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	344.500	599.313
StarPower Semiconductor Ltd 'A'	11.100	731.320	CSL Ltd	2.669	580.986
Info Edge India Ltd	10.558	727.383	Autohome Inc ADR	8.248	565.250
Flat Glass Group Co Ltd 'H'	189.000	720.930	HDFC Bank Ltd	25.391	523.822
Bilibili Inc ADR	6.805	678.698	ASML Holding NV	748	503.563
Autohome Inc ADR	5.695	591.074			
Asian Paints Ltd	16.239	574.499			
HDFC Asset Management Co Ltd '144A'	12.338	547.787			

BNY Mellon Asian Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Infosys Ltd ADR	73.616	1.328.323	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	151.000	3.260.427
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	48.000	1.026.554	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	45.965	3.078.470
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	14.886	990.430	United Overseas Bank Ltd	98.700	1.954.069
AIA Group Ltd	67.000	828.713	DBS Group Holdings Ltd	82.100	1.796.618
BHP Group Plc	22.316	641.312	Link REIT (Units) (REIT)	148.900	1.417.096
DBS Group Holdings Ltd	28.500	613.362	Singapore Technologies Engineering Ltd	436.600	1.289.908
United Overseas Bank Ltd	30.200	581.765	BHP Group Plc	40.125	1.226.193
Link REIT (Units) (REIT)	56.300	520.944	Insurance Australia Group Ltd	328.955	1.216.914
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	47.000	489.625	CLP Holdings Ltd	118.000	1.164.295
Insurance Australia Group Ltd	118.947	436.864	Delta Electronics Inc	103.000	1.076.313
MediaTek Inc	13.000	433.975	Dexus (REIT)	136.749	1.065.865
Singapore Technologies Engineering Ltd	145.200	429.065	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	94.000	1.040.310
CLP Holdings Ltd	40.500	394.420	Venture Corp Ltd	67.000	1.021.959
Venture Corp Ltd	26.000	391.563	Macquarie Korea Infrastructure Fund	92.709	930.637
Delta Electronics Inc	36.000	370.422	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	271.300	868.229
Dexus (REIT)	47.265	362.572	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	218.600	852.509
ITC Ltd GDR	113.941	320.604	Sands China Ltd	212.800	835.217
Bank Central Asia Tbk PT	162.900	318.328	Infosys Ltd ADR	45.756	828.439
Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	75.600	295.690	ITC Ltd GDR	292.568	782.826
Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	87.300	271.711	Elite Material Co Ltd	108.000	744.182
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	4.546	270.753	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	11.786	733.854
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	910.295	257.670	Star Entertainment Grp Ltd/The	211.149	624.434
Sands China Ltd	52.000	239.413	Scentre Group (REIT)	277.075	601.952
Elite Material Co Ltd	36.000	224.635	Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT)	715.000	558.008
Star Entertainment Grp Ltd/The	74.902	215.381	Mercury NZ Ltd	119.478	540.425
By-health Co Ltd	49.417	212.766	Singapore Telecommunications Ltd	296.200	525.767
Spark New Zealand Ltd	57.882	184.136	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.802.400	521.069
Meridian Energy Ltd	42.959	182.689	Spark New Zealand Ltd	154.150	490.543
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	41.000	176.744	SK Telecom Co Ltd	1.728	478.799
SK Telecom Co Ltd	690	166.389	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	105.600	459.873
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	663.420	156.090	Meridian Energy Ltd	114.403	454.868
Transurban Group	14.710	153.005	SKYCITY Entertainment Group Ltd	166.210	409.438
SKYCITY Entertainment Group Ltd	62.411	151.090	Transurban Group	37.416	409.407
Scentre Group (REIT)	67.504	147.953	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.703.556	381.232



## BNY Mellon Blockchain Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Coinbase Global Inc	16.997	4.755.576	Grayscale Bitcoin Trust BTC	135.476	6.606.794
MicroStrategy Inc - Class A	6.166	4.690.295	Grayscale Ethereum Trust	109.652	4.148.096
Kakao Corp	25.115	3.709.001	Lemonade Inc	20.270	1.641.270
Signature Bank/New York NY	14.087	3.572.844	PayPal Holdings Inc	6.032	1.298.857
Voyager Digital Ltd	222.121	3.473.820	Fintech Acquisition Corp V	109.585	1.096.374
Overstock.com Inc	46.073	3.463.757	Nuvei Corp '144A'	16.951	1.041.676
Hut 8 Mining Corp (Units)	259.129	3.369.544	Silvergate Capital Corp - Class A	7126	1.039.104
Unity Software Inc	19.673	3.349.532	JPMorgan Chase & Co	5.541	864.208
Okta Inc	13.278	3.328.676	Kakao Corp	7.289	818.225
EPAM Systems Inc	5.652	3.314.078	JD.com Inc ADR	10.351	769.829
Grayscale Ethereum Trust	109.652	3.263.719	Tencent Holdings Ltd	7000	680.533
Silvergate Capital Corp - Class A	27.426	3.159.254	NVIDIA Corp	2.486	624.686
Grayscale Bitcoin Trust BTC	86.857	3.152.590	Coinbase Global Inc	2.399	605.606
ROBLOX Corp	27.284	3.041.034	Alphabet Inc - Class A	321	604.191
ASX Ltd	50.799	3.039.513	DocuSign Inc - Class A	3.686	602.325
Enphase Energy Inc	15.473	2.795.817	Signature Bank/New York NY	2.005	599.369
Block Inc	10.996	2.744.190	Visa Inc - Class A	2.908	573.926
DraftKings Inc - Class A	52.809	2.704.566	ASX Ltd	8.615	537.928
Hive Blockchain Technologies Ltd (Units)	676.034	2.563.084	Block Inc	2.350	491.702
NVIDIA Corp	9.927	2.446.579	Change Healthcare Inc	20.591	490.148
Shopify Inc - Class A	1.508	2.287.615	Okta Inc	2.060	485.685
HYBE Co Ltd	6.803	2.266.687	EPAM Systems Inc	758	476.763
Marathon Digital Holdings Inc	33.205	2.156.652	salesforce.com Inc	1.762	458.448
SVB Financial Group	3.133	2.115.417	AP Moller - Maersk A/S - Class B	137	427.778
salesforce.com Inc	8.242	2.080.216	Starbucks Corp	3.825	426.133
Daimler AG	22.122	2.007.308	Enphase Energy Inc	2.468	414.276
AP Moller - Maersk A/S - Class B	701	1.974.682	Walmart Inc	2.756	398.103
BayCurrent Consulting Inc	4.500	1.850.022	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.518	388.994
Galaxy Digital Holdings Ltd	69.964	1.785.801	Microsoft Corp	1.599	386.674
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.277	1.762.893			
WisdomTree Investments Inc	277.417	1.760.793			
Nuvei Corp '144A'	16.951	1.632.336			
Kering SA	1.986	1.632.188			
Quest Diagnostics Inc	11.036	1.618.369			
Meta Platforms Inc - Class A	4.532	1.584.793			
SBI Holdings Inc/Japan	56.700	1.529.123			
Siemens AG ADR	17.066	1.415.366			
Lemonade Inc	14.814	1.404.760			
Funko Inc - Class A	70.762	1.402.342			
XPO Logistics Inc	12.016	1.307.089			
Figure Acquisition Corp I	118.841	1.302.505			
VPC Impact Acquisition Holdings	104.880	1.293.292			
Nasdaq Inc	6.875	1.289.882			
PayPal Holdings Inc	4.596	1.250.848			
Metropolitan Bank Holding Corp	17.911	1.230.922			

BNY Mellon Brazil Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Petroleo Brasileiro SA ADR	147.700	1.479.044	Gerdau SA ADR	529.700	2.863.859
Vale SA ADR - Class B	69.100	1.214.275	Vale SA	134.701	2.565.883
Cia Brasileira de Distribuicao	182.417	957.951	Marfrig Global Foods SA	577.902	2.254.349
Cia Brasileira de Distribuicao ADR	179.500	952.859	EDP - Energias do Brasil SA	550.051	2.010.089
Bradespar SA - Preference	136.200	923.709	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	554.156	1.622.373
Sul America SA (Units)	123.186	872.416	Petroleo Brasileiro SA ADR	140.850	1.365.984
C&A Modas Ltda	460.623	851.826	Itau Unibanco Holding SA ADR	266.500	1.360.826
Itau Unibanco Holding SA ADR	144.400	820.354	Cia Paranaense de Energia ADR	243.300	1.304.367
AES Brasil Energia SA	367.644	817.622	Banco Bradesco SA ADR	276.700	1.204.122
Sendas Distribuidora SA ADR	56.100	773.325	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	227.200	1.168.123
Suzano SA	81.436	747.151	Vale SA ADR - Class B	70.500	1.164.407
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	221.958	694.119	Lojas Americanas SA	632.524	1.036.556
Banco Bradesco SA ADR	126.500	620.956	Banco do Brasil SA	180.600	1.035.753
Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	45.946	586.659	Cia Brasileira de Distribuicao	139.600	992.825
YDUQS Participacoes SA	120.099	567.552	Americanas SA	69.000	964.683
Banco do Brasil SA	81.700	538.287	Petroleo Brasileiro SA - Preference	189.079	945.160
Lojas Americanas SA - Preference	463.800	531.680	Sendas Distribuidora SA ADR	59.300	923.200
Atacadao SA	139.536	512.898	Santos Brasil Participacoes SA	660.900	888.031
Marfrig Global Foods SA	143.900	500.027	Cia Paranaense de Energia ADR	537.300	876.271
Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	174.647	485.846	Grupo Mateus SA	637.214	863.243
Vale SA	34.069	476.054	Petroleo Brasileiro SA ADR	87.750	859.414
TIM SA/Brazil	187.192	474.068	Vibra Energia SA	161.700	720.390
Santos Brasil Participacoes SA	298.300	444.639	Embraer SA ADR	58.325	698.404
Vibra Energia SA	83.420	425.165	BR Malls Participacoes SA	363.000	644.127
Gerdau SA ADR	71.600	417.503	Bradespar SA - Preference	52.703	634.631
Lojas Americanas SA	136.493	374.613	Atacadao SA	158.000	577.168
Americanas SA	26.300	359.952	Telefonica Brasil SA ADR	67.200	556.172
Petroleo Brasileiro SA ADR	29.150	336.878	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	82.900	513.025
BR Malls Participacoes SA	163.800	323.892	Sul America SA (Units)	82.800	500.929
Embraer SA ADR	19.425	312.603	Americanas SA	63.508	482.255
Light SA	88.129	310.594	Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	98.800	475.707
Telefonica Brasil SA ADR	30.300	267.364	TIM SA/Brazil	201.900	473.855
EDP - Energias do Brasil SA	69.800	258.342	JBS SA	74.600	466.548
Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	44.700	215.401	Sendas Distribuidora SA	129.055	464.226

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-May-2022	5.059.000	5.057.472	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 30-Dec-2021	2.600.000	2.599.950
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Jun-2022	3.400.000	3.397.941	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-May-2022	2.600.000	2.598.944
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 30-Dec-2021	2.600.000	2.599.688	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Dec-2021	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Dec-2021	1.700.000	1.699.930	Microchip Technology Inc	2	83
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 06-Jan-2022	1.700.000	1.699.891	Electrolux AB	1	25
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 20-Jan-2022	1.700.000	1.699.881	Electrolux AB	1	2
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 27-Jan-2022	1.700.000	1.699.861			
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 17-Feb-2022	1.700.000	1.699.819			
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 24-Feb-2022	1.700.000	1.699.784	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 24-Mar-2022	1.700.000	1.699.720			
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 31-Mar-2022	1.700.000	1.699.674			
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 21-Apr-2022	1.700.000	1.699.624			
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 28-Apr-2022	1.700.000	1.699.592			

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	1.527.000	1.526.345	United States Cash Management Bill 0.000% 25-Feb-2021	1.721.000	1.720.923
United States Cash Management Bill 0.000% 12-Aug-2021	955.000	954.785	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021	1.653.000	1.652.885
United States Cash Management Bill 0.000% 25-Feb-2021	425.000	424.967	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021	1.568.000	1.567.667
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021	300.000	299.994	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	1.527.000	1.526.626
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021	212.000	211.943	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021	1.478.000	1.477.781
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021	212.000	211.929	United States Cash Management Bill 0.000% 04-Mar-2021	1.418.000	1.417.937
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Jun-2021	95.000	94.991	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021	1.413.000	1.412.819
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021	1.273.000	1.273.000
			SPDR Bloomberg Barclays Short Term High Yield Bond ETF - ETF	46.244	1.254.409
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Apr-2021	1.142.000	1.141.888
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2021	1.127.000	1.126.979
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021	955.000	954.821
			iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - ETF	68.438	356.593

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	9.000.000	8.997.862	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Mar-2021	9.000.000	9.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021	9.000.000	8.997.616	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021	9.000.000	9.000.000
Apple Inc	41.118	6.409.207	Apple Inc	61.392	8.313.383
Microsoft Corp	20.111	6.278.132	Microsoft Corp	27.857	7.360.396
United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021	6.000.000	5.999.213	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Feb-2021	6.035.000	6.035.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022	6.000.000	5.998.802	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Dec-2021	5.000.000	4.999.347	United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022	5.000.000	4.997.727	Amazon.com Inc	1.543	5.162.291
Amazon.com Inc	1.279	4.298.441	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021	5.000.000	5.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021	3.000.000	2.999.738	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Dec-2021	5.000.000	5.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021	3.000.000	2.999.727	United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022	3.000.000	2.999.431	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	3.000.000	2.999.377	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Dec-2021	3.000.000	2.999.356	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022	3.000.000	2.999.278	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021	3.000.000	2.999.173	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Jul-2021	3.000.000	2.999.096	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Jul-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022	3.000.000	2.999.059	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021	3.000.000	3.000.000
United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021	3.000.000	2.998.681	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022	3.000.000	2.998.292	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021	3.000.000	3.000.000
Tesla Inc	2.813	2.302.659	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Dec-2021	3.000.000	3.000.000
Alphabet Inc - Class A	800	2.232.055	Meta Platforms Inc - Class A	8.917	2.813.291
Meta Platforms Inc - Class A	6.255	2.136.664	Alphabet Inc	1.148	2.751.188
Alphabet Inc	744	2.091.555	Alphabet Inc - Class A	1.093	2.572.289
			Berkshire Hathaway Inc - Class B	8.276	2.208.412

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	2.580.000	2.580.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	2.450.000	2.388.150
Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	1.315.000	1.315.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	1.200.000	1.196.190
WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	1.300.000	1.288.885	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	1.140.000	1.092.452
LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	1.185.000	1.183.411	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	1.050.000	1.059.743
American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	1.115.000	1.115.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	1.058.000	1.051.512
HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	1.115.000	1.115.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	1.030.000	1.026.215
Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	985.000	984.256	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	940.000	909.411
Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 1.000% 15-Nov-2029	860.000	860.000	Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029	860.000	850.388
Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	790.000	790.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	705.000	729.071
Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	765.000	765.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	650.000	650.268
Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	765.000	765.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	627.000	633.437
DISH DBS Corp '144A' 1.000% 01-Jun-2029	735.000	735.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	600.000	599.846
Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	720.000	724.107	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	550.000	555.836
Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027	600.000	722.853	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	530.000	542.595
Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	700.000	700.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	530.000	541.786
Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	700.000	700.000	Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	510.000	507.971
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	695.000	697.332	DISH DBS Corp '144A' 5.125% 01-Jun-2029	500.000	496.100
Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	650.000	650.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	500.000	490.690
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	575.000	575.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	500.000	487.660
Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	565.000	565.000	Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027	400.000	474.282

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033	400.000	399.088	Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051	395.000	403.647
Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051	400.000	398.272	Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033	390.000	387.925
Toyota Motor Credit Corp 'GMTN' 1.650% 10-Jan-2031	300.000	299.751	Toyota Motor Credit Corp 'GMTN' 1.650% 10-Jan-2031	300.000	297.353
Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027	200.000	200.000	Enel SpA 'EMTN' 5.750% 22-Jun-2037	100.000	203.721
General Motors Financial Co Inc 2.350% 08-Jan-2031	200.000	200.000	Air Lease Corp 'GMTN' 0.700% 15-Feb-2024	200.000	198.505
Air Lease Corp 'GMTN' 0.700% 15-Feb-2024	200.000	198.672	General Motors Financial Co Inc 2.350% 08-Jan-2031	200.000	197.167
JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032	150.000	150.000	Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027	195.000	194.749
Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	100.000	130.987	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 6.750% 03-Dec-2026	100.000	176.337
Italgas SpA 'EMTN' 1.625% 19-Jan-2027	100.000	128.915	AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032	100.000	153.465
Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 2.500% 31-Jul-2026	100.000	124.136	Philip Morris International Inc 3.125% 03-Jun-2033	100.000	151.364
Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	100.000	122.998	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033	95.000	148.148
Societe Generale SA 'EMTN' 1.750% 22-Mar-2029	100.000	122.640	JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032	150.000	146.783
Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	100.000	122.497	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049	100.000	143.291
AT&T Inc 1.800% 05-Sep-2026	100.000	120.835	AbbVie Inc 2.125% 17-Nov-2028	100.000	137.084
Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 04-Nov-2026	100.000	120.214	McDonald's Corp 'GMTN' 1.750% 03-May-2028	100.000	136.033
Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029	100.000	120.104	AXA SA 'EMTN' FRN 5.125% 04-Jul-2043	100.000	135.255
BP Capital Markets PLC FRN (Perpetual) 3.250% 22-Jun-2170	100.000	119.770	Apple Inc 1.625% 10-Nov-2026	100.000	134.224
Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026	100.000	119.711	Verizon Communications Inc 1.875% 26-Oct-2029	100.000	133.573
TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025	100.000	118.405	Barclays PLC 'EMTN' FRN 3.375% 02-Apr-2025	100.000	133.123
Altea SCA 1.875% 17-Jan-2028	100.000	118.311	Mondelez International Inc 1.625% 08-Mar-2027	100.000	131.907

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023	70.840.000	80.726.322	Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023	88.740.000	100.444.281
Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	46.534.000	54.159.577	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	43.256.000	48.913.234
Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	33.235.000	35.787.712	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	27.311.000	31.807.275
Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	35.810.000	35.273.260	CF Industries Inc 5.375% 15-Mar-2044	23.000.000	29.558.950
Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030	33.767.000	34.514.259	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	27.000.000	26.745.317
Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	26.106.000	30.491.750	CF Industries Inc 4.950% 01-Jun-2043	17.300.000	20.857.720
Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	25.898.000	27.398.124	Ovintiv Inc 6.625% 15-Aug-2037	13.690.000	17.930.577
Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	22.933.000	24.858.122	ArcelorMittal SA 4.550% 11-Mar-2026	15.794.000	17.767.932
Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023	19.388.000	22.212.592	Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034	13.578.000	17.692.465
Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026	19.763.000	22.058.788	ArcelorMittal SA 3.600% 16-Jul-2024	15.320.000	16.371.580
Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025	20.886.000	21.999.488	Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026	15.191.000	16.313.873
Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	19.705.000	21.758.200	Ovintiv Inc 6.500% 01-Feb-2038	12.107.000	15.856.313
Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	20.910.000	21.334.473	ArcelorMittal SA 7.000% 15-Oct-2039	10.822.000	15.434.230
Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	18.370.000	20.539.025	Ovintiv Exploration Inc 5.625% 01-Jul-2024	13.720.000	15.056.000
FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	14.800.000	20.258.441	Kraft Heinz Foods Co 4.625% 30-Jan-2029	13.071.000	15.045.193
Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	16.487.000	20.208.860	Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025	14.225.000	14.936.250
Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	16.489.000	20.181.957	Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043	14.370.000	14.902.225
Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	16.970.000	18.352.233	EPR Properties 3.750% 15-Aug-2029	14.050.000	14.349.112
Ovintiv Inc 6.625% 15-Aug-2037	13.690.000	17.928.238	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023	13.746.518	13.758.390
Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034	13.578.000	17.498.936	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	12.171.000	13.376.210



BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	8.635.000	8.635.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	7.834.000	7.689.822
LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	6.525.000	6.525.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	6.310.000	6.406.061
American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	5.065.000	5.065.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	5.065.000	5.029.680
WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	5.100.000	5.056.395	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	4.515.000	4.443.787
AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	4.825.000	4.822.288	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	4.430.000	4.413.388
Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	4.405.000	4.405.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	4.240.000	4.323.000
HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	4.400.000	4.400.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	3.950.000	3.992.040
Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	4.180.000	4.182.670	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	3.880.000	3.893.571
SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029	4.175.000	4.170.476	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	3.780.000	3.759.385
Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	3.980.000	3.980.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	3.727.000	3.582.759
Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	3.870.000	3.865.602	SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029	3.440.000	3.391.241
Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	3.465.000	3.465.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	3.300.000	3.323.630
Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026	3.410.000	3.426.227	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	3.134.000	3.257.290
Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	3.350.000	3.392.261	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	3.020.000	3.024.086
Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	3.345.000	3.345.000	Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029	2.980.000	2.966.960
DISH DBS Corp '144A' 5.125% 01-Jun-2029	3.310.000	3.310.000	Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026	2.770.000	2.796.464
Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	3.160.000	3.207.767	Ford Motor Co 8.500% 21-Apr-2023	2.485.000	2.749.185
Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029	2.980.000	2.980.000	Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023	2.393.000	2.729.025
Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	2.897.000	2.957.624	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	2.665.000	2.716.496
Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	2.930.000	2.930.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	2.580.000	2.678.624

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	512.589.600	512.589.600	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	491.737.171	491.737.171
Becle SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031	15.000.000	14.846.400	Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060	14.430.000	12.929.291
Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047	9.710.000	10.922.546	Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 8.450% 10-Aug-2028	11.000.000	12.305.000
Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	10.916.000	10.894.195	Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047	9.710.000	10.732.079
Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028	10.230.000	9.770.000	CSN Inova Ventures 'REGS' 6.750% 28-Jan-2028	9.300.000	10.008.900
Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045	8.700.000	9.594.740	Metinvest BV 'REGS' 5.625% 17-Jun-2025	7.400.000	9.250.125
Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060	10.130.000	9.334.205	Petrobras Global Finance BV 5.600% 03-Jan-2031	7.794.000	8.734.521
Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	9.000.000	8.910.180	Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169	8.500.000	8.545.775
Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026	7.400.000	8.817.130	lochpe-Maxion Austria GmbH / Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV 'REGS' 5.000% 07-May-2028	8.000.000	8.011.400
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026	8.800.000	8.752.656	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2.750% 22-Jan-2033	6.000.000	7.493.951
Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	8.620.000	8.572.259	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	7.700.000	7.354.250
Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169	8.500.000	8.500.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	7.200.000	7.285.750
NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027	8.500.000	8.459.030	Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026	7.100.000	7.105.850
Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026	8.200.000	8.178.516	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 2.000% 14-Oct-2031	7.000.000	7.003.753
GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	8.000.000	7.958.400	Light Servicios de Eletricidade SA/Light Energia SA 'REGS' 4.375% 18-Jun-2026	6.890.000	6.881.573
Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	6.585.000	7.954.256	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7.450% 15-Nov-2029	6.800.000	6.783.100
lochpe-Maxion Austria GmbH / Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV 'REGS' 5.000% 07-May-2028	8.000.000	7.946.060	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	6.400.000	6.345.680
Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	7.900.000	7.900.000	Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026	6.200.000	6.240.600
Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	7.930.000	7.897.566	Movida Europe SA 'REGS' 5.250% 08-Feb-2031	6.000.000	5.997.500
UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	8.000.000	7.830.330	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030	5.800.000	5.917.610

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	550.000	549.951	Orazul Energy Egenor SCA 'REGS' 5.625% 28-Apr-2027	625.000	629.855
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031	475.000	472.559	Bank of Georgia JSC 'REGS' 6.000% 26-Jul-2023	525.000	553.609
Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6.125% 19-Feb-2031	400.000	416.980	Senegal Government International Bond 'REGS' 4.750% 13-Mar-2028	385.000	502.949
SA Global Sukuk Ltd 'REGS' 2.694% 17-Jun-2031	400.000	400.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 7.250% 28-Feb-2028	440.000	491.744
Turkey Government International Bond 5.950% 15-Jan-2031	375.000	363.169	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026	450.000	479.425
Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	350.000	351.901	Mongolia Government International Bond 'REGS' 5.125% 07-Apr-2026	400.000	433.500
Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048	250.000	336.390	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'RegS' 6.025% 05-Jul-2022	402.000	426.535
Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	325.000	325.000	Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029	395.000	426.106
Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031	300.000	300.000	Turkey Government International Bond 6.250% 26-Sep-2022	400.000	416.190
Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	300.000	300.000	Petrobras Global Finance BV 5.625% 20-May-2043	385.000	401.463
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 1.450% 08-Jan-2026	300.000	299.598	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'REGS' 6.800% 22-Nov-2025	325.000	384.735
CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	300.000	299.235	Mexico Government International Bond 2.659% 24-May-2031	362.000	361.167
Indonesia Government International Bond 1.850% 12-Mar-2031	275.000	273.730	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	325.000	357.289
Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	275.000	268.950	Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS' 3.500% 01-Sep-2032	350.000	355.425
Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	255.000	255.000	Dubai DOF Sukuk Ltd 'EMTN' 2.763% 09-Sep-2030	350.000	353.938
Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	250.000	250.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 4.250% 18-Jul-2029	310.000	328.910
Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.400% 30-Mar-2050	200.000	243.726	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2026	300.000	324.150
El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.650% 15-Jun-2035	225.000	230.828	Mexico Government International Bond 4.500% 22-Apr-2029	270.000	304.425
Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	225.000	225.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 1.450% 08-Jan-2026	300.000	300.612
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	225.000	225.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 4.500% 26-Oct-2046	255.000	295.206
Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032	200.000	224.970	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030	275.000	288.819
Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060	200.000	220.782	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 7.500% 15-Dec-2028	250.000	288.750
Petrobras Global Finance BV 5.600% 10-Jun-2051	225.000	217.004	Oman Government International Bond 'REGS' 6.000% 01-Aug-2029	265.000	281.695
Turkey Government International Bond 7.375% 05-Feb-2025	200.000	215.476	QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025	275.000	278.025
Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045	200.000	208.500	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	275.000	275.784
Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	200.000	201.180	Turkey Government International Bond 5.125% 17-Feb-2028	310.000	272.165
Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031	200.000	200.824	Indonesia Government International Bond 1.850% 12-Mar-2031	275.000	266.992
Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	200.000	200.225	Bahrain Government International Bond 'REGS' 5.625% 30-Sep-2031	260.000	260.832
African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026	200.000	200.000	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 2.400% 28-Sep-2027	260.000	259.675
Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	200.000	200.000	Petroleos Mexicanos 5.625% 23-Jan-2046	305.000	252.388
Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041	200.000	200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6.850% 27-Jan-2045	220.000	250.800
Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031	200.000	200.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	250.000	248.125
Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	200.000	200.000	TC Ziraat Bankasi AS 'REGS' 4.750% 29-Apr-2021	240.000	240.000
Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	200.000	200.000	Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045	200.000	233.060
Oman Government International Bond 'REGS' 6.250% 25-Jan-2031	200.000	200.000	Iraq International Bond 'REGS' 5.800% 15-Jan-2028	234.375	227.012
Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS' 4.875% 15-Jun-2030	200.000	200.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.875% 24-Jun-2024	200.000	221.500
Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	200.000	200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	200.000	220.138
Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	200.000	200.000	Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 6.350% 10-Aug-2028	200.000	216.050
Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	200.000	199.796	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032	200.000	213.500
Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	200.000	199.652	Egypt Government International Bond 'REGS' 5.250% 06-Oct-2025	200.000	212.530
AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	200.000	199.576	El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.650% 15-Jun-2035	225.000	211.875
Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	200.000	199.182	Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027	200.000	207.120
Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 2.950% 06-May-2031	200.000	199.142	Sasol Financing USA LLC 5.875% 27-Mar-2024	200.000	207.000
Georgia Government International Bond 'REGS' 2.750% 22-Apr-2026	200.000	198.844	Turkey Government International Bond 7.375% 05-Feb-2025	200.000	206.824
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	200.000	198.348	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032	200.000	206.000
Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	200.000	198.330	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030	200.000	204.100
Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	200.000	197.826	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	200.000	204.040
Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS' 2.000% 28-Oct-2026	200.000	197.648	AngloGold Ashanti Holdings PLC 3.750% 01-Oct-2030	200.000	203.640
DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	200.000	197.422	Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	200.000	203.250
Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	200.000	196.752	Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031	200.000	203.200
Hungary Government International Bond 'REGS' 3.125% 21-Sep-2051	200.000	191.746	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 1.625% 24-Nov-2025	200.000	202.100
Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	200.000	184.480	Bahrain Government International Bond 'REGS' 6.000% 19-Sep-2044	210.000	197.896
Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	125.000	142.401	Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	200.000	195.250
			Hungary Government International Bond 'REGS' 3.125% 21-Sep-2051	200.000	193.260
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021	190.000	190.000
			Ghana Government International Bond 'REGS' 8.950% 26-Mar-2051	200.000	178.050

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	56.300.000	3.567.287	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7.190% 12-Sep-2024	210.965.000	9.698.318
Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	10.550.000	3.042.457	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	55.830.000	4.425.757
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	1.225.000.000	1.713.505	China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026	27.800.000	4.386.509
Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029	271.000.000	1.331.528	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	76.700.000	4.162.791
Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	34.900.000	1.313.430	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	205.000.000	2.905.099
Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	4.150.000	1.282.714	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036	30.100.000.000	2.303.291
Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027	88.500.000	1.276.657	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	159.800.000	2.209.363
Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027	21.000.000	1.107.012	Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027	139.900.000	2.027.078
Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	328.000.000	838.877	Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	6.450.000	1.686.473
Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	3.325.000	804.895	Peru Government Bond 5.350% 12-Aug-2040	6.575.000	1.653.065
Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	19.600.000	754.409	Republic of Poland Government Bond 2.500% 25-Jul-2027	5.350.000	1.569.015
Malaysia Government Bond 3.502% 31-May-2027	2.700.000	677.835	Republic of Poland Government Bond 2.750% 25-Oct-2029	5.400.000	1.545.152
Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033	265.000.000	658.386	Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027	26.700.000	1.459.022
Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030	8.800.000	383.698	Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033	100.000.000	1.416.322
Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	9.800.000	131.145	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	27.500.000	1.401.653
Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	5.500.000	125.071	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	37.400.000	1.245.798
			Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Aug-2032	17.000.000.000	1.238.080
			Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	4.325.000.000	1.230.745
			Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-Sep-2030	16.150.000.000	1.190.953
			Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	30.400.000	1.133.539
			Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Mar-2034	12.800.000.000	984.703
			Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	12.216.000.000	904.110
			Romania Government Bond 4.750% 24-Feb-2025	2.900.000	773.479
			Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	10.113.000.000	723.500
			Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	2.365.000	641.515
			Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	400.000.000	638.363

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	10.850.000	672.422	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7.190% 12-Sep-2024	21.200.000	968.777
Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	2.175.000	627.269	VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027	525.000	527.925
Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	600.000	599.400	Bank of Georgia JSC 'REGS' 6.000% 26-Jul-2023	460.000	484.790
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	9.000.000	463.814	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'REGS' 5.942% 21-Nov-2023	400.000	442.060
China Government Bond 3.290% 23-May-2029	2.860.000	454.852	Orazul Energy Egenor SCA 'REGS' 5.625% 28-Apr-2027	400.000	402.810
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	335.000.000	453.311	Aegae Finance Sari 'REGS' 5.750% 10-Oct-2024	360.000	376.020
DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029	400.000	430.350	Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Jun-2035	4.900.000.000	360.309
China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	2.450.000	407.250	Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	1.325.000	347.460
Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	8.675.000	320.676	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	22.700.000	316.893
VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027	300.000	305.175	China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026	2.000.000	316.409
Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	300.000	302.820	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044	250.000	300.750
Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031	300.000	300.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 7.500% 15-Dec-2028	250.000	288.750
Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	300.000	300.000	Turkey Government International Bond 5.750% 22-Mar-2024	260.000	266.552
Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	300.000	292.935	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Sep-2026	3.272.000.000	258.128
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	260.000.000	280.312	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036	3.101.000.000	244.350
Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 16-Mar-2039	19.700.000	252.138	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	225.000	239.128
Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.700% 16-Feb-2032	250.000	249.940	Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026	200.000	225.820
KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	200.000	238.358	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	225.000	225.641
Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	6.350.000	237.506	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 7.250% 28-Feb-2028	200.000	223.520
Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032	200.000	224.996	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS' 6.250% 14-Nov-2024	200.000	218.040
Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	225.000	224.980	OCP SA 'REGS' 4.500% 22-Oct-2025	200.000	218.000
Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.875% 16-Feb-2032	200.000	215.030	DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029	200.000	217.500
OCP SA 'REGS' 4.500% 22-Oct-2025	200.000	213.710	Mongolia Government International Bond 'REGS' 5.125% 07-Apr-2026	200.000	216.700
Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033	200.000	211.310	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032	200.000	216.300
Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	870.000	210.743	Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029	200.000	216.100
Russian Federal Bond - OFZ 6.000% 06-Oct-2027	16.100.000	210.458	Egypt Government International Bond 'REGS' 5.250% 06-Oct-2025	200.000	212.530
Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030	200.000	204.460	PTT Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.700% 16-Jul-2070	200.000	210.214
Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	200.000	201.180	VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028	200.000	208.844
Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	200.000	200.225	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	14.700.000	208.338
Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	200.000	200.000	Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027	200.000	207.120
Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	200.000	200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	200.000	204.040
Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026	200.000	200.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	200.000	203.250
Hidroviass International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	200.000	200.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025	200.000	202.500
Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	200.000	200.000	MMC Norilsk Nickel QJSC Via MMC Finance DAC 'REGS' 2.550% 11-Sep-2025	200.000	201.400
MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	200.000	200.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	200.000	200.902
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	200.000	200.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	200.000	200.704
Polysus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	200.000	200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	200.000	198.318
Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	200.000	200.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	200.000	197.750
Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	200.000	200.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	3.650.000	192.929
Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	200.000	199.652	MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	200.000	192.100
AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	200.000	199.576	Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049	200.000	189.544
Rumo Luxembourg Sari 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	200.000	199.182	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	750.000	177.019
Anadolu Efes Biraclik Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028	200.000	198.460	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	2.150.000	170.890
Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	200.000	198.330	Central American Bottling Corp 'REGS' 5.750% 31-Jan-2027	160.000	165.742
Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	200.000	197.826	Turkey Government International Bond 4.875% 16-Apr-2043	200.000	148.366
DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	200.000	197.422			
Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	200.000	196.752			
OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	200.000	196.482			
Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032	200.000	193.000			
Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033	13.250.000	191.797			
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	1.000.000	186.797			
Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	13.160.000	180.083			
Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041	175.000	175.000			
Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	175.000	168.781			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	127.246.563	127.246.563	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	129.002.629	129.002.629
Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	154.407.300	7.676.401	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	110.000.000	5.477.515
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	27.000.000	5.210.016	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2029	66.000.000.000	5.226.293
Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	77.500.000	4.207.662	Russian Federal Bond - OFZ 7.150% 12-Nov-2025	329.200.000	4.573.881
Chile Government International Bond 3.100% 07-May-2041	3.700.000	3.621.708	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	22.000.000	4.359.907
Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031	12.400.000	3.619.488	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	77.500.000	4.068.164
Turkey Government International Bond 4.750% 26-Jan-2026	3.100.000	3.079.602	Chile Government International Bond 3.100% 07-May-2041	3.700.000	3.722.050
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 5.125% 22-Jun-2026	3.000.000	3.000.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	11.900.000.000	3.574.488
Turkey Government International Bond 6.500% 20-Sep-2033	2.900.000	2.900.000	Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2021	53.000.000	3.393.086
Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026	213.000.000	2.853.674	Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060	3.800.000	3.312.549
Indonesia Government International Bond 3.050% 12-Mar-2051	2.800.000	2.791.343	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031	11.200.000	3.194.421
Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028	2.740.000	2.675.000	Turkey Government International Bond 4.750% 26-Jan-2026	3.100.000	3.085.620
Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047	2.340.000	2.632.125	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 5.125% 22-Jun-2026	3.000.000	3.009.200
Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026	193.000.000	2.573.333	Indonesia Treasury Bond 8.125% 15-May-2024	39.451.000.000	2.996.720
Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	2.550.000	2.524.140	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	49.530.000	2.833.877
Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060	2.800.000	2.507.885	Turkey Government International Bond 6.500% 20-Sep-2033	2.900.000	2.772.550
Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169	2.500.000	2.500.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026	181.147.000	2.652.194
Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	2.500.000	2.475.050	Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047	2.340.000	2.567.487
Turkey Government International Bond 5.875% 26-Jun-2031	2.400.000	2.386.320	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	14.000.000	2.555.140
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026	2.300.000	2.287.626	Qatar Government International Bond 'REGS' 4.000% 14-Mar-2029	2.150.000	2.517.858

BNY Mellon Euroland Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030	25.750.000	27.077.951	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.750% 04-Jul-2028	40.450.000	56.378.530
Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025	20.525.000	21.211.144	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030	25.750.000	26.868.989
Norway Government Bond '144A' 1.500% 19-Feb-2026	175.000.000	17.981.202	Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025	20.525.000	21.129.746
Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.000% 22-Jun-2026	16.550.000	17.845.529	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.500% 15-Aug-2046	12.350.000	19.149.922
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Aug-2026	17.500.000	17.466.225	French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Nov-2028	12.975.000	13.963.176
French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Nov-2028	12.975.000	13.888.570	Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024	13.200.000	13.530.924
French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2030	12.800.000	13.066.377	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2030	12.800.000	12.840.769
Bundesobligation 0.000% 09-Oct-2026	12.200.000	12.566.890	French Republic Government Bond OAT '144A' 2.000% 25-May-2048	8.975.000	11.642.031
Bundesschatzanweisungen 0.000% 15-Dec-2023	12.000.000	12.183.000	Spain Government Bond '144A' 0.100% 30-Apr-2031	11.700.000	11.356.447
Spain Government Bond '144A' 0.100% 30-Apr-2031	11.700.000	11.434.791	French Republic Government Bond OAT 2.500% 25-May-2030	8.250.000	10.194.158
French Republic Government Bond OAT 2.500% 25-May-2030	8.250.000	10.374.701	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021	9.100.000	9.238.601
Netherlands Government Bond '144A' 0.000% 15-Jul-2031	9.130.000	9.149.223	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	16.225.000	8.869.210
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2036	8.150.000	8.228.168	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Aug-2026	8.650.000	8.571.199
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	7.750.000	7.715.834	Bundesschatzanweisungen 0.000% 15-Dec-2023	8.300.000	8.418.382
Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Feb-2031	7.150.000	7.222.501	BNY Mellon Global Funds PLC-Bny Mellon US Municipal Infrastructure Debt Fund	7.976.912	8.033.435
French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2031	6.950.000	6.851.797	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.700% 25-Jul-2030	6.536.164	7.794.031
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030	6.275.000	6.703.799	Spain Government Bond '144A' 2.900% 31-Oct-2046	5.155.000	7.193.551
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	6.275.000	5.431.032	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.250% 01-Sep-2046	5.145.000	6.979.279
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	6.275.000	5.419.951	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	5.875.000	6.936.651
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.500% 30-Apr-2045	5.400.000	5.355.072	Bundesobligation 0.000% 09-Oct-2026	6.000.000	6.131.131
China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	41.100.000	5.274.412	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022	5.455.000	5.543.423
Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	643.100.000	4.609.685	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	6.275.000	5.431.898
Ireland Government Bond 0.200% 18-Oct-2030	4.545.000	4.609.648	Latvia Government International Bond 0.375% 07-Oct-2026	5.200.000	5.396.040
Thailand Government Bond 1.600% 17-Dec-2029	164.150.000	4.428.039	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	6.275.000	5.372.801
Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	57.075.000	3.972.017	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.500% 30-Apr-2045	5.400.000	5.220.679
Spain Government Bond '144A' 0.500% 31-Oct-2031	3.800.000	3.840.204			
European Union 0.450% 02-May-2046	3.850.000	3.826.361			
United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021	4.500.000	3.772.873			
United States Cash Management Bill 0.000% 11-May-2021	4.500.000	3.764.250			

BNY Mellon European Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	565.000	627.065	BPCE SA 'EMTN' FRN 2.750% 30-Nov-2027	1.100.000	1.152.954
BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.250% 13-Apr-2027	500.000	499.655	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058	641.565	630.046
TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2170	450.000	461.475	BNP Paribas SA 'EMTN' 0.125% 04-Sep-2026	500.000	500.095
Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	423.000	417.445	Dowson 2019-1 PLC FRN 2.450% 20-Sep-2026	417.000	493.238
Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026	370.000	408.874	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2170	450.000	462.420
Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	400.000	401.264	Huntsman International LLC 5.125% 15-Apr-2021	460.000	460.000
Vantage Towers AG 'EMTN' 0.000% 31-Mar-2025	400.000	398.900	SES SA FRN (Perpetual) 4.625% 02-Jan-2170	445.000	457.629
RCI Banque SA 'EMTN' 1.375% 08-Mar-2024	380.000	390.298	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.375% 18-Jan-2024	440.000	456.215
Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	345.000	369.357	AT&T Inc 1.950% 15-Sep-2023	436.000	449.664
TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030	362.000	365.220	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 1.250% 10-Jun-2024	400.000	412.184
InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027	340.000	364.616	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 1.000% 16-Jan-2030	400.000	400.920
HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029	340.000	340.537	Societe Generale SA FRN 2.500% 16-Sep-2026	400.000	400.000
Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	335.000	337.638	RCI Banque SA 'EMTN' 1.375% 08-Mar-2024	380.000	389.850
Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	337.000	335.942	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	349.917	383.706
BP Capital Markets Plc 'EMTN' 2.213% 25-Sep-2026	300.000	334.584	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	343.000	379.783
British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	334.000	332.036	VF Corp 0.625% 20-Sep-2023	365.000	371.479
Merck KGaA FRN 2.875% 25-Jun-2079	300.000	324.600	Barclays PLC 'EMTN' FRN 2.000% 07-Feb-2028	350.000	359.832
AT&T Inc 2.400% 15-Mar-2024	300.000	321.384	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	2.231	355.590
Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	316.000	316.023	Capgemini SE 2.375% 15-Apr-2032	300.000	353.215
Commonwealth Bank of Australia 'REGS' 3.305% 11-Mar-2041	380.000	315.811	Stellantis NV 3.375% 07-Jul-2023	330.000	349.704



BNY Mellon Future Earth Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Microsoft Corp	411	88.587,00	Microsoft Corp	241	78.642
Eversource Energy	960	86.183,00	Hella GmbH & Co KGaA	1.059	69.102
Legrand SA	852	81.268,00	Raven Industries Inc	894	51.852
Unilever Plc	1.358	80.188,00	Xylem Inc/NY	198	24.612
Samsung SDI Co Ltd	119	78.741,00	Valeo	754	20.491
Deere & Co	248	74.594,00	Acuity Brands Inc	83	17.405
Hella GmbH & Co KGaA	1.059	70.591,00	Unilever Plc	319	16.588
Mowi ASA	3.136	70.256,00	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	346	10.189
Ecolab Inc	314	69.694,00	TOMRA Systems ASA	95	6.488
Nidec Corp	500	69.027,00			
Daikin Industries Ltd	300	68.849,00			
Weyerhaeuser Co (REIT)	2.080	68.680,00	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
National Grid Plc	5.765	67.688,00			
Toyota Industries Corp	800	66.630,00			
Kubota Corp	3.000	65.220,00			
TE Connectivity Ltd	474	62.090,00			
Genuit Group Plc	6.991	59.733,00			
Orsted AS '144A'	273	56.736,00			
Infineon Technologies AG	1.283	55.148,00			
Smurfit Kappa Group Plc	1.075	54.068,00			
Novozymes A/S	881	50.537,00			
Shimano Inc	200	48.103,00			
Trimble Inc	611	44.921,00			
Albemarle Corp	251	44.681,00			
Greencoat UK Wind Plc/Funds	23.971	44.643,00			
Johnson Matthey Plc	1.175	43.929,00			
Xylem Inc/NY	410	43.923,00			
Texas Instruments Inc	250	43.311,00			
Ebara Corp	1.200	41.671,00			
Trane Technologies Plc	221	41.118,00			
Koninklijke DSM NV	235	40.701,00			
Acuity Brands Inc	338	39.692,00			
Raven Industries Inc	894	33.440,00			
Hubbell Inc - Class B	156	32.602,00			
TOMRA Systems ASA	615	30.309,00			
Kurita Water Industries Ltd	700	29.968,00			
Vitasoy International Holdings Ltd	7.037	29.375,00			
Valeo	754	28.700,00			
Vestas Wind Systems A/S	121	28.300,00			
FANUC Corp	100	25.975,00			
Ashtead Group Plc	260	22.386,00			

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

## BNY Mellon Future Food Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Deere & Co	366	113.918	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	456	38.908
AGCO Corp	845	100.562	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	690	35.548
Nestle SA	841	95.293	Deere & Co	95	33.925
Kerry Group Plc	658	92.847	Tyson Foods Inc - Class A	431	33.529
Kubota Corp	4.000	87.653	Raven Industries Inc	575	33.350
Bucher Industries AG	157	77.997	Kubota Corp	1.000	23.009
Corteva Inc	1.729	76.897	Meituan '144A'	295	13.969
Trimble Inc	1.030	76.481	Bucher Industries AG	23	11.844
Unilever Plc	1.287	75.228	AGCO Corp	79	10.264
Ecolab Inc	339	75.142	Mosaic Co/The	324	10.260
Costco Wholesale Corp	163	73.456	Givaudan SA	2	9.862
Koninklijke Ahold Delhaize NV	2.573	73.427	Symrise AG - Class A	49	7.044
Nomad Foods Ltd	2.842	72.899	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR - Rights 19/05/2021	115	371
Novozymes A/S	1.119	69.180			
Mowi ASA	2.983	68.402			
Danone SA	1.043	68.008	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
PepsiCo Inc	483	67.934			
Meituan '144A'	1.712	66.922			
Nutrien Ltd	1.241	64.695			
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	20.000	61.567			
Koninklijke DSM NV	347	60.359			
Mosaic Co/The	2.100	59.133			
CNH Industrial NV	4.097	58.752			
Sprouts Farmers Market Inc	2.790	58.196			
Givaudan SA	14	57.413			
International Flavors & Fragrances Inc	442	56.785			
Bayer AG	896	55.575			
Ingredion Inc	654	53.145			
Suntory Beverage & Food Ltd	1.500	52.469			
Tyson Foods Inc - Class A	782	52.258			
Genus Plc	818	51.935			
Chr Hansen Holding A/S	528	51.191			
Symrise AG - Class A	403	50.869			
Brixmor Property Group Inc (REIT)	2.949	50.214			
Delivery Hero SE '144A'	302	48.205			
Topcon Corp	3.200	44.124			
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	690	39.545			
TOMRA Systems ASA	721	37.088			
a2 Milk Co Ltd/The	4.683	36.481			
Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	456	34.731			
SunOpta Inc	4.437	32.771			
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	7.346	31.137			
Vitasoy International Holdings Ltd	7.314	29.643			

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Life Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Abbott Laboratories	1.148	126.217	Lowe's Cos Inc	106	20.706
Roche Holding AG	323	116.298	Chr Hansen Holding A/S	260	19.821
Medtronic Plc	948	111.570	Roche Holding AG	59	19.648
AIA Group Ltd	7.200	93.879	Smith & Nephew Plc	894	17.973
Johnson & Johnson	521	82.438	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	239	17.912
Novo Nordisk A/S	1.148	80.262	Sherwin-Williams Co/The	60	17.754
UnitedHealth Group Inc	221	79.102	HCA Healthcare Inc	61	12.887
Prudential Plc	3.833	75.211	Topcon Corp	800	12.645
AstraZeneca Plc	621	63.218	Danaher Corp	36	11.579
Danaher Corp	259	62.781	Novo Nordisk A/S	136	10.736
GlaxoSmithKline Plc	3.220	60.391	Novartis AG	117	9.998
Principal Financial Group Inc	1.102	58.232	Home Depot Inc/The	28	9.315
HCA Healthcare Inc	336	57.720	Organon & Co	62	1.885
Sherwin-Williams Co/The	78	57.355			
Home Depot Inc/The	205	56.300			
Cooper Cos Inc/The	154	55.914	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
Novartis AG	579	54.064			
Merck & Co Inc	626	52.341			
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	4.000	52.117			
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	596	49.912			
Smith & Nephew Plc	2.281	48.185			
Lowe's Cos Inc	281	47.271			
Zurich Insurance Group AG	93	39.829			
Sugi Holdings Co Ltd	600	39.644			
Topcon Corp	2.800	39.056			
Intuitive Surgical Inc	48	38.664			
Alcon Inc	513	34.489			
Siemens Healthineers AG '144A'	608	32.318			
EssilorLuxottica SA	200	31.341			
Lonza Group AG	45	30.812			
M3 Inc	400	29.809			
Amplifon SpA	718	29.414			
Cochlear Ltd	211	29.401			
Thermo Fisher Scientific Inc	63	29.086			
Healthpeak Properties Inc (REIT)	1.008	28.612			
Straumann Holding AG	25	28.213			
Chr Hansen Holding A/S	260	26.019			
L'Oreal SA	67	24.452			
Booking Holdings Inc	11	24.424			
Discovery Ltd	2.458	23.704			
Acushnet Holdings Corp	523	22.172			

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	12.909.709	16.118.310	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	24.125.073	28.049.482
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	2.979.537	14.921.987	United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	15.870.000	15.958.922
Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	8.329.545	9.629.770	Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	15.250.000	13.016.777
Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	9.800.000	8.389.325	United Kingdom Gilt 3.250% 22-Jan-2044	5.630.000	10.711.324
Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026	7.000.000	6.957.679	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	9.450.000	10.175.891
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	6.632.612	6.882.344	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	5.623.000	9.781.789
Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	23.100.400.000	6.880.809	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022	1.064.200.000	9.705.388
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	4.943.249	6.305.502	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	1.746.980	9.700.397
Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	123.780.000	5.709.668	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050 15-Feb-2050	9.740.000	9.613.036
Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024	5.450.000	5.435.503	Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029	9.540.000	8.555.520
European Investment Bank 0.375% 24-Jul-2024	5.450.000	5.430.544	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.100% 15-Sep-2029	10.160.000	8.385.938
United Kingdom Gilt 1.500% 31-Jul-2053	3.800.000	5.361.059	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	7.340.000	7.608.573
European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	5.300.000	5.300.000	German Postal Pensions Securitisation Plc 3.750% 18-Jan-2021	6.300.000	7.600.636
International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	5.003.000	4.988.191	Norway Government Bond '144A' 1.375% 19-Aug-2030	60.300.000	7.032.628
Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	4.230.000	4.822.731	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	3.969.732	6.416.552
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	4.700.000	4.794.734	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	5.315.600	6.251.319
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	81.300.000	4.720.692	Denmark Government Bond '144A' 0.500% 15-Nov-2029	35.880.000	6.219.214
International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027	4.630.000	4.657.456	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	4.943.249	6.166.100
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.106.126	4.553.857	International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 2.800% 12-Jan-2022	8.330.000	6.138.215
United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	4.400.000	4.430.250	Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021	290.000.000	6.033.810
International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.340% 22-Nov-2028	4.430.000	4.430.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	7.235.000	6.009.557
Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	4.244.000	4.244.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 2.875% 07-Sep-2021	5.750.000	5.750.000
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	3.590.000	4.116.974	Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	626.000.000	5.624.901
Queensland Treasury Corp '144A' 1.750% 20-Jul-2034	5.570.000	4.050.741	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	4.678.900	5.273.627
Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.250% 10-Feb-2026	3.948.000	3.948.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	5.170.000	5.131.511
Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	3.929.000	3.916.152	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.500% 01-May-2023	3.880.000	4.777.568
Treasury Corp of Victoria 2.000% 17-Sep-2035	4.760.000	3.447.394	Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027	82.060.000	4.659.690
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	611.803	3.381.134	United Kingdom Gilt 3.750% 22-Jul-2052	2.080.000	4.621.994
Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	3.257.000	3.252.180	Mexico Government International Bond 3.900% 27-Apr-2025	4.030.000	4.517.744
United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	3.010.000	3.237.391	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2.500% 16-Apr-2025	4.031.000	4.298.668
Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	3.800.000	3.023.311	Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032	2.200.000	4.203.847
Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026	2.722.000	2.820.055	Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025	3.793.000	4.085.645
International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	191.800.000	2.717.605	Queensland Treasury Corp '144A' 1.750% 20-Jul-2034	5.570.000	4.011.758
Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	33.890.000.000	2.482.437	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.850% 01-Jul-2025	3.020.000	3.939.791
Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	1.887.000	2.413.906	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	16.180.000	3.882.552
Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	264.550.000	2.384.201	United States Treasury Note/Bond 1.125% 28-Feb-2022	3.820.000	3.858.946
New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	3.330.000	2.320.676			

BNY Mellon Global Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	541.425.769	541.425.769	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	555.121.891	555.121.891
United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026	27.810.000	27.259.232	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Nov-2022	53.449.400	53.446.579
United States Treasury Note/Bond 1.250% 31-Mar-2028	19.873.100	19.638.660	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Jun-2022	42.795.800	42.812.827
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Feb-2031	17.000.000	16.471.406	Bundesobligation 0.000% 11-Apr-2025	25.377.777	31.518.747
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029	10.000.000	11.797.400	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030	21.474.946	26.650.694
salesforce.com Inc 1.950% 15-Jul-2031	10.318.000	10.288.181	United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Apr-2025	24.203.600	24.002.297
Coca-Cola Co/The 0.950% 06-May-2036	8.464.000	10.228.507	United States Treasury Note/Bond 1.250% 31-Mar-2028	19.873.100	20.035.383
Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027	7.860.000	9.904.495	Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032	18.594.000	18.019.419
Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	7.247.000	8.757.446	United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025	17.410.400	17.151.984
Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032	9.242.000	8.506.429	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Feb-2031	17.000.000	16.799.834
Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028	7.652.000	8.429.368	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	17.988.500	15.336.057
UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 29-Jan-2026	6.846.000	8.352.654	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029	10.000.000	11.867.300
Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.000% 19-Jul-2024	6.886.000	8.351.746	Electricite de France SA 'EMTN' 6.250% 30-May-2028	6.250.000	11.622.412
Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.250% 06-Nov-2023	6.812.000	8.346.353	salesforce.com Inc 1.950% 15-Jul-2031	10.318.000	10.445.737
Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024	6.536.000	8.329.172	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	10.436.000	10.408.095
Asahi Group Holdings Ltd 0.010% 19-Apr-2024	6.861.000	8.284.338	Coca-Cola Co/The 0.950% 06-May-2036	8.464.000	10.209.260
Fidelity National Information Services Inc 1.100% 15-Jul-2024	6.588.000	8.257.196	PPL Capital Funding Inc 4.125% 15-Apr-2030	8.641.000	10.165.618
Teck Resources Ltd 3.900% 15-Jul-2030	7.870.000	8.228.479	BAT International Finance PLC 'EMTN' 2.250% 26-Jun-2028	6.621.000	9.441.654
Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.667% 02-Jun-2029	5.740.000	8.118.663	Republic of Ireland Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2021	7.720.000	9.381.348
Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.900% 17-May-2028	7.189.000	8.118.322	Teck Resources Ltd 3.900% 15-Jul-2030	7.870.000	8.405.790

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	16.130.000	16.225.741	Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	39.440.000	32.668.770
French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	12.270.923	15.335.817	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	18.670.707	21.724.043
Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	15.960.000	13.755.748	United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	21.420.000	21.503.656
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	2.635.811	13.218.270	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	21.260.000	21.234.206
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023	13.030.000	13.030.000	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022	1.636.400.000	15.139.451
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	9.550.357	9.932.212	iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF	128.863	14.239.982
Mellon Investments Funds ICVC - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	4.180.241	8.584.138	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	7.790.000	14.108.880
Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	6.786.740	7.806.664	Norway Government Bond '144A' 1.750% 17-Feb-2027	97.225.000	11.529.644
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.870.000	7.390.409	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	7.600.000	7.923.297
SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	100.799	7.080.350	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022	840.750.000	7.850.263
Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	19.551.800.000	5.763.588	Mellon Investments Funds ICVC - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	3.954.090	7.672.367
Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022	528.050.000	5.008.742	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	6.054.314	7.499.706
Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026	4.770.000	4.967.287	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	1.274.149	7.090.295
European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	4.850.000	4.850.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	4.125.000	6.811.368
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	3.782.998	4.839.357	SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	100.799	6.748.695
Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	105.900.000	4.769.312	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	5.342.386	5.607.954
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.126.760	4.576.740	Treasury Corp of Victoria 2.250% 20-Nov-2034	6.810.000	5.458.578
Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	5.715.000	4.546.901	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	3.238.647	5.249.285
International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	4.540.000	4.526.582	Societe Generale SA FRN (Perpetual) 6.750% 07-Oct-2169	4.048.000	4.814.085
Japan Government Two Year Bond 0.005% 01-Nov-2023	498.950.000	4.395.187	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	3.782.998	4.720.167
Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	3.840.000	3.840.000	Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021	220.000.000	4.577.373
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	66.090.000	3.837.950	German Postal Pensions Securitisation Plc 3.750% 18-Jan-2021	3.500.000	4.222.576
Royal Bank of Canada 'GMTN' FRN 0.620% 27-Apr-2026	3.700.000	3.700.000			
Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	3.230.000	3.692.377			
Pacific Life Global Funding II 'REGS' 1.375% 14-Apr-2026	3.650.000	3.648.066			
HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	3.600.000	3.600.895			
TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1.625% 25-Jan-2170	2.900.000	3.548.797			
Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	3.496.000	3.490.826			

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd	44.945	3.445.377	Ilijin Materials Co Ltd	40.535	3.295.364
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	118.000	2.556.866	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	868.000	2.934.974
Tencent Music Entertainment Group ADR	136.470	2.547.939	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	260.008	2.885.501
LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	143.200	2.429.492	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	132.000	2.854.333
By-health Co Ltd	459.600	2.339.598	Samsung SDI Co Ltd	4.600	2.696.037
Samsung SDI Co Ltd	3.506	2.251.680	Prosus NV	29.315	2.586.454
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	188.500	2.246.662	Livent Corp	112.180	2.569.182
Tata Consultancy Services Ltd	48.816	2.081.138	Meituan '144A'	63.817	2.548.588
Yum China Holdings Inc	33.734	2.040.752	Housing Development Finance Corp Ltd	67.923	2.462.919
New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	24.229	2.025.775	Info Edge India Ltd	30.919	2.371.783
Housing Development Finance Corp Ltd	51.292	1.833.385	Orocobre Ltd	426.478	2.316.856
AIA Group Ltd	143.600	1.828.192	Titan Co Ltd	99.133	2.160.640
Alibaba Group Holding Ltd ADR	7.252	1.803.227	Tencent Holdings Ltd	28.915	2.085.546
Prosus NV	15.783	1.795.451	AIA Group Ltd	157.600	1.930.900
Maruti Suzuki India Ltd	16.353	1.662.008	Maruti Suzuki India Ltd	20.094	1.929.498
Hindustan Unilever Ltd	48.848	1.598.758	Asian Paints Ltd	42.419	1.712.934
Meituan '144A'	34.887	1.556.921	Alibaba Group Holding Ltd	72.900	1.620.893
Info Edge India Ltd	23.217	1.537.133	Globant SA	6.056	1.614.979
Godrej Consumer Products Ltd	142.997	1.504.623	Jubilant Foodworks Ltd	35.508	1.548.218
Flat Glass Group Co Ltd 'H'	392.000	1.500.895	EPAM Systems Inc	3.021	1.537.617
LG Chem Ltd	1.951	1.457.822	Xinyi Solar Holdings Ltd	726.000	1.491.419
Livent Corp	71.443	1.452.748	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	27.889	1.338.206
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	143.900	1.452.312	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	95.900	1.295.418
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	320.399	1.345.863	Bilibili Inc ADR	11.805	1.293.777
HDFC Bank Ltd	65.448	1.301.588	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	130.500	1.198.929
Advantest Corp	14.700	1.297.644	ASML Holding NV	1.490	1.124.730
MercadoLibre Inc	798	1.282.513	Tencent Music Entertainment Group ADR	77.020	1.093.974
NARI Technology Co Ltd 'A'	262.100	1.179.258	Elite Material Co Ltd	122.000	944.949
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	377.380	1.175.182	MercadoLibre Inc	561	942.919
Autohome Inc ADR	10.871	1.116.195	Vale Indonesia Tbk PT	2.506.796	930.203
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	65.400	1.109.396	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	537.500	920.512
EPAM Systems Inc	2.893	1.066.026	Godrej Consumer Products Ltd	72.062	895.903
Asian Paints Ltd	29.594	1.042.781	NARI Technology Co Ltd 'A'	146.500	861.816
ASML Holding NV	1.594	970.883	Tata Consultancy Services Ltd	16.730	807.408
Ilijin Materials Co Ltd	15.393	970.495	PVR Ltd	50.504	779.102
Globant SA	4.472	961.081			
Titan Co Ltd	43.606	910.247			
Jubilant Foodworks Ltd	22.318	869.941			
Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	42.600	840.547			
OTP Bank Nyrt	14.326	817.606			
Sungrow Power Supply Co Ltd	36.900	756.695			

BNY Mellon Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
CME Group Inc	42.494	8.929.280	Goldman Sachs Group Inc/The	27.788	9.908.638
Volkswagen AG - Preference	29.268	7.954.661	Brenntag SE	96.176	8.443.495
Relx Plc	404.564	7.532.414	Relx Plc	422.622	8.110.462
JPMorgan Chase & Co	44.355	7.395.629	Alphabet Inc - Class A	2.941	7.324.917
TE Connectivity Ltd	54.608	7.379.047	Applied Materials Inc	64.557	7.159.048
Cooper Cos Inc/The	16.022	6.574.024	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	1.465.900	6.105.434
Novozymes A/S	89.428	5.878.272	Intact Financial Corp	51.475	5.872.951
HDFC Bank Ltd	253.081	5.489.451	Deutsche Post AG	84.516	5.118.168
Ecolab Inc	22.114	4.791.577	Ferguson Plc	36.979	5.108.187
Diageo Plc	95.785	4.050.527	Citigroup Inc	70.776	4.977.504
Ebara Corp	92.700	3.391.408	Meituan - Class B '144A'	127.079	4.821.094
Roche Holding AG	8.815	3.387.186	Microsoft Corp	17.282	4.708.375
Microsoft Corp	12.703	3.132.718	Merck & Co Inc	60.169	4.526.108
Ferguson Plc	23.806	3.073.838	Apple Inc	31.563	4.392.253
Apple Inc	23.198	3.058.461	Samsung SDI Co Ltd	6.842	4.014.528
Norfolk Southern Corp	10.683	3.001.552	Amazon.com Inc	1.101	3.611.438
Texas Instruments Inc	16.406	2.915.147	Sony Group Corp	30.400	3.280.599
Alphabet Inc - Class A	1.317	2.824.781	Verizon Communications Inc	56.738	3.228.569
Amazon.com Inc	810	2.584.468	Albemarle Corp	14.386	3.180.658
Continental AG	18.593	2.494.983	Continental AG	22.892	3.065.633
Bayer AG	37.854	2.472.250	SAP SE	20.933	2.670.196
General Electric Co	63.016	2.466.716	Abbott Laboratories	20.712	2.542.703
Associated British Foods Plc	69.135	2.287.250	Informa Plc	351.049	2.513.264
Albemarle Corp	13.224	2.176.092	Accenture Plc - Class A	7.788	2.353.704
Samsung SDI Co Ltd	2.894	1.841.481	Wolters Kluwer NV	27.347	2.346.726
Abbott Laboratories	15.223	1.800.115	AIA Group Ltd	178.600	2.143.772
Goldman Sachs Group Inc/The	5.308	1.773.861	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	16.047	1.903.661
Citigroup Inc	25.732	1.754.515	Mastercard Inc	5.338	1.862.266
Barclays Plc	695.941	1.736.473	L'Oreal SA	4.092	1.789.221
Suzuki Motor Corp	38.300	1.715.907	Medtronic Plc	13.921	1.647.443
AIA Group Ltd	131.400	1.699.659			
Costco Wholesale Corp	4.714	1.670.764			
Sony Group Corp	15.200	1.606.897			
Accenture Plc - Class A	5.724	1.602.979			
Swedbank AB	85.698	1.599.350			
Applied Materials Inc	12.727	1.514.427			



BNY Mellon Global Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
JPMorgan Chase & Co	131.553	21.164.975	Cisco Systems Inc/Delaware	535.126	28.455.741
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	68.208	20.064.192	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	394.550	24.810.306
Dominion Energy Inc	191.181	14.749.259	Infosys Ltd ADR	1.167.878	24.226.536
Volkswagen AG - Preference	52.863	13.420.029	QUALCOMM Inc	147.898	22.191.637
Bunzl Plc	369.546	12.584.296	Cie Financiere Richemont SA	178.182	21.991.650
Insurance Australia Group Ltd	2.422.481	9.357.799	Zurich Insurance Group AG	43.421	18.197.600
Anglo American Plc	232.310	8.948.918	Roche Holding AG	45.019	17.192.146
Sysco Corp	118.787	8.854.572	H & M Hennes & Mauritz AB	726.687	16.643.479
Sage Group Plc/The	1.028.788	8.723.346	PepsiCo Inc	98.354	15.358.243
Home Depot Inc/The	31.389	8.576.155	RELX Plc	498.007	14.877.640
RELX Plc	302.292	7.658.991	Goldman Sachs Group Inc/The	41.440	14.312.520
Medtronic Plc	61.954	6.847.303	Industria de Diseno Textil SA	392.750	13.604.489
Credicorp Ltd	50.246	6.305.051	Paychex Inc	117.924	13.599.775
Taylor Wimpey Plc	2.863.381	6.222.681	Sanofi	135.209	13.448.909
CMS Energy Corp	101.332	5.898.259	Merck & Co Inc	165.341	13.003.079
Roche Holding AG	16.373	5.747.035	Unilever Plc	238.893	12.892.866
Organon & Co	159.961	5.719.162	Texas Instruments Inc	67.003	12.786.429
Hubbell Inc - Class B	24.531	4.656.695	Procter & Gamble Co/The	83.939	11.816.209
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	378.500	3.618.533	Informa Plc	1.639.309	11.677.039
CME Group Inc	17.540	3.617.960	CME Group Inc	54.427	11.601.249
Eversource Energy	32.655	2.660.080	Home Depot Inc/The	31.389	11.384.943
TotalEnergies SE	50.141	2.589.459	Emerson Electric Co	124.949	11.350.071
Royal Dutch Shell Plc	105.439	2.548.313	Novartis AG	134.931	11.349.438
Emerson Electric Co	22.550	2.213.817	Tapestry Inc	249.276	11.329.515
			KDDI Corp	339.200	10.874.529
			Principal Financial Group Inc	164.133	10.607.376
			Ferguson PLC	72.427	10.606.991
			CMS Energy Corp	166.323	10.089.208
			BAE Systems Plc	1.335.869	10.000.220
			JPMorgan Chase & Co	61.409	9.948.571
			Eversource Energy	114.346	9.830.994
			Macquarie Korea Infrastructure Fund	851.230	9.138.075
			Svenska Handelsbanken AB	815.408	9.048.628
			British American Tobacco Plc	250.388	8.943.664
			Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	31.483	8.841.867
			Bayer AG	158.699	8.822.658
			Nestle SA	69.744	8.714.903
			Citigroup Inc	126.232	8.433.010
			Bunzl Plc	214.176	7.912.016
			Continental AG	65.135	7.708.460
			Western Union Co/The	297.965	7.334.735
			Verizon Communications Inc	132.521	7.332.234
			Philip Morris International Inc	74.776	6.814.915
			Dominion Energy Inc	86.538	6.374.025

## BNY Mellon Global High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	1.833.000	1.833.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	1.100.000	1.315.622
Lorca Telecom Bondco SA 4.000% 18-Sep-2027	1.130.000	1.310.123	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	1.170.000	1.149.084
Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	1.270.000	1.280.588	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jun-2030	800.000	1.030.281
Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	1.060.000	1.259.970	Synlab Bondco PLC 'REGS' FRN 4.750% 01-Jul-2025	760.000	928.280
Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027	910.000	1.054.463	West Street Merger Sub Inc '144A' 6.375% 01-Sep-2025	865.000	891.702
Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	1.050.000	1.031.234	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 4.750% 15-Jul-2027	630.000	887.691
Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	1.115.000	1.011.363	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-May-2032	820.000	852.589
Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029	851.000	1.010.119	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	705.000	840.606
Mausier Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	986.000	975.308	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	820.000	826.193
DirecTV Financing LLC Term Loan 5.750% 22-Jul-2027 0.000% 22-Jul-2027	970.000	966.513	Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027	620.000	822.898
AA Bond Co Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jan-2026	665.000	938.938	Vodafone Group PLC FRN 4.875% 03-Oct-2078	525.000	786.421
LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	931.000	931.000	US Concrete Inc '144A' 5.125% 01-Mar-2029	692.000	759.055
TransDigm Inc '144A' 4.875% 01-May-2029	910.000	910.568	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 0.000 % 25-Sep-2026	750.000	753.906
WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	910.000	910.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 6.375% 01-Feb-2024	730.000	753.272
Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp 'REGS' 3.000% 15-Jun-2029	770.000	902.010	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	753.000	745.706
UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	890.000	894.950	William Hill Ltd 4.750% 01-May-2026	490.000	737.700
Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	885.000	887.938	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	705.000	736.725
Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	880.000	880.613	Telecom Italia Finance SA 'EMTN' 7.750% 24-Jan-2033	430.000	716.778
Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	855.000	862.213	Dryden 69 Euro CLO 2018 DAC '144A' FRN 6.290% 18-Apr-2032	620.000	695.548
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	820.000	852.589	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.250% 30-Sep-2025	490.000	686.635

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Antero Midstream Corp	1.459.663	13.656.348	PPL Corp	500.726	14.379.514
Engie SA	809.705	11.332.593	Deutsche Post AG	156.763	10.358.160
Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	352.916	10.998.486	American Tower Corp (REIT)	37.284	9.946.957
Williams Cos Inc/The	397.523	10.485.722	Clearway Energy Inc	266.672	8.450.272
Naturgy Energy Group SA	382.059	10.036.405	ONEOK Inc	130.333	7.415.553
Medical Properties Trust Inc (REIT)	425.639	8.981.878	Enagas SA	223.199	5.098.972
Enagas SA	386.165	8.542.520	Williams Cos Inc/The	160.098	4.736.206
PPL Corp	252.499	7.454.268	SFL Corp Ltd	500.645	3.982.588
Orange SA	596.357	7.099.538	Dominion Energy Inc	46.378	3.407.870
Vistra Corp	325.584	6.703.843	Enbridge Inc	76.854	2.972.972
Clearway Energy Inc	219.076	6.015.679	Aena SME SA '144A'	17.640	2.933.680
Proximus SADP	246.582	5.181.227	Vinci SA	23.380	2.661.978
Enbridge Inc	136.892	5.058.283	Medical Properties Trust Inc (REIT)	116.184	2.516.205
Verizon Communications Inc	84.078	4.740.637	Atlantia SpA	107.796	2.077.148
Exelon Corp	106.160	4.476.201	Proximus SADP	70.869	1.497.331
Italgas SpA	546.085	3.578.410	Orange SA	123.572	1.495.398
American Tower Corp (REIT)	14.864	3.248.372	SSE Plc	71.190	1.417.446
Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	3.146.000	3.215.044	Naturgy Energy Group SA	41.998	1.271.491
Atlantia SpA	177.768	3.171.625	Verizon Communications Inc	14.418	802.004
Deutsche Post AG	50.012	2.901.868	Red Electrica Corp SA	40.011	726.818
Drax Group Plc	383.343	2.891.878			
ONEOK Inc	51.807	2.439.739			
Red Electrica Corp SA	135.005	2.303.154			
SSE Plc	88.522	1.748.468			

BNY Mellon Global Leaders Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd	32.400	2.206.198	Cognizant Technology Solutions Corp	11.100	813.485
CSL Ltd	6.100	1.290.827	Alphabet Inc	325	758.894
Illumina Inc	3.300	1.253.877	Industria de Diseno Textil SA	22.100	692.033
Roche Holding AG	3.400	1.173.678	Ecolab Inc	3.250	637.485
Mastercard Inc	3.200	1.101.761	FANUC Corp	2.200	461.917
Novo Nordisk A/S	13.400	1.044.593	Air Liquide SA	2.650	444.023
Texas Instruments Inc	5.300	1.013.328	Texas Instruments Inc	2.300	424.035
TJX Cos Inc/The	14.600	1.000.027	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	550	409.018
Edwards Lifesciences Corp	10.900	990.715	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.400	387.217
Adobe Inc	1.900	976.846	ASML Holding NV	550	356.959
AIA Group Ltd	85.200	965.523	Colgate-Palmolive Co	4.300	324.169
Automatic Data Processing Inc	4.900	928.460	Reckitt Benckiser Group PLC	3.600	309.624
Air Liquide SA	5.150	869.131	Automatic Data Processing Inc	1.400	273.250
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	7.300	868.725	Intuitive Surgical Inc	260	213.975
Amphenol Corp - Class A	11.700	853.888	Amphenol Corp - Class A	2.100	138.218
L'Oreal SA	2.100	814.952			
Microsoft Corp	2.900	744.684			
Alphabet Inc	300	728.872	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
Intuitive Surgical Inc	1.300	684.227			
Ecolab Inc	3.400	681.916			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	850	642.208			
NIKE Inc	3.900	572.822			
Industria de Diseno Textil SA	16.300	532.694			
Keyence Corp	1.000	504.974			
FANUC Corp	1.800	457.798			
ASML Holding NV	450	363.915			

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund\* für das Geschäftsjahr zum  
31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Bundesschatzanweisungen 0.000% 10-Sep-2021	1.000.000	1.003.110	Bundesschatzanweisungen 0.000% 10-Sep-2021	1.000.000	1.003.020
Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund '144A'	139.168	158.427	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	541.648	731.924
VH Global Sustainable Energy Opportunities PLC	138.880	156.587	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	409.173	614.818
ConocoPhillips	4.369	154.764	AIA Group Ltd	45.600	484.517
Home Depot Inc/The	671	141.565	Greencoat UK Wind PLC/Funds	324.061	480.722
TotalEnergies SE	3.545	127.622	GCP Infrastructure Investments Ltd	342.644	391.240
Royal Dutch Shell PLC	6.833	101.538	VPC Specialty Lending Investments Plc/Fund	389.176	385.668
Suncor Energy Inc	3.593	59.572	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	8.104.600	376.560
Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	40.604	55.470	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	391.541	376.242
RELX PLC	2.682	53.662	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	36.000	375.761
Taylor Wimpey PLC	27.031	50.538	Greencoat Renewables PLC	317.343	375.419
Diageo PLC	475	16.033	International Public Partnerships Ltd	186.528	358.991
			B&M European Value Retail SA	53.855	341.199
			Albemarle Corp	2.537	334.985
			Volkswagen AG - Preference	1.672	334.753
			Samsung SDI Co Ltd	657	330.293
			Informa PLC	50.444	327.411
			Sdcl Energy Efficiency Income Trust PLC	243.062	311.606
			BAE Systems PLC	53.387	308.359
			Samsung Electronics Co Ltd - Preference	5.549	303.994
			Gresham House Energy Storage Fund PLC/The Fund	230.185	297.016
			Tuifon Oceanic Assets Ltd/The Fund	359.180	291.559
			JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	220.770	287.377
			United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15-Jan-2025	286.604	282.359
			Ferguson PLC	2.704	280.191
			SKYCITY Entertainment Group Ltd	145.698	280.141
			British American Tobacco PLC	9.101	280.008
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	15.000	276.340
			Civitas Social Housing Plc (REIT)	208.487	260.517
			Star Entertainment Grp Ltd/The	104.371	260.330
			Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029	350.000	259.223
			Goldman Sachs Group Inc/The	871	243.763
			Royal Dutch Shell PLC	14.620	243.068

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Amazon.com Inc	487	1.625.437	Brenntag SE	13.456	1.257.970
CME Group Inc	5.024	1.031.452	Apple Inc	7.402	982.341
TE Connectivity Ltd	7.476	1.025.540	Relx Plc	42.477	963.042
Relx Plc	37.834	819.964	Continental AG	7.248	930.909
Roche Holding AG	2.292	809.465	Microsoft Corp	3.133	910.841
Ecolab Inc	3.560	777.698	Alphabet Inc - Class A	330	856.730
Cooper Cos Inc/The	1.755	729.410	Citigroup Inc	11.085	783.843
HDFC Bank Ltd	33.261	727.742	Applied Materials Inc	6.430	767.768
Novozymes A/S	8.259	538.706	Royal Dutch Shell PLC	31.860	698.205
SAP SE	3.321	460.042	Novartis AG	7.725	688.490
Abbott Laboratories	3.512	424.541	Intact Financial Corp	5.810	664.701
Microsoft Corp	1.431	369.649	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	155.200	640.320
Medtronic Plc	2.837	341.319	Alibaba Group Holding Ltd	34.772	634.311
Suzuki Motor Corp	7.900	332.278	Ferguson Plc	4.296	608.099
Alphabet Inc - Class A	134	302.196	Accenture Plc - Class A	1.625	542.507
Apple Inc	1.963	260.345	Associated British Foods PLC	17.410	499.391
Eversource Energy	3.082	259.669	Altria Group Inc	11.344	491.264
Costco Wholesale Corp	635	226.491	Goldman Sachs Group Inc/The	1.320	477.943
Barclays Plc	93.725	224.846	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.334	387.148
Goldman Sachs Group Inc/The	570	192.155	Costco Wholesale Corp	832	370.859
Accenture Plc - Class A	650	187.171	Sony Group Corp	3.300	353.741
AIA Group Ltd	14.600	186.493	Roche Holding AG	906	339.737
Mastercard Inc	524	178.093	Medtronic Plc	2.692	332.208
Sony Group Corp	1.600	177.402	Mastercard Inc	927	325.788
Ferguson Plc	1.344	177.208	Diageo Plc	6.860	324.910
Diageo Plc	3.868	172.446	Samsung SDI Co Ltd	504	313.118
Citigroup Inc	2.501	164.299	Amazon.com Inc	88	306.063
Applied Materials Inc	1.248	153.000	AIA Group Ltd	25.600	301.452
			Vivendi SE	9.278	286.135
			SAP SE	1.969	273.889
			Abbott Laboratories	2.249	272.454
			Suzuki Motor Corp	5.800	256.153
			Unilever Plc	4.483	252.831
			Ebara Corp	5.100	245.163
			Texas Instruments Inc	1.287	242.722
			Wolters Kluwer NV	2.308	239.809
			Informa Plc	32.554	232.912
			Swedbank AB	11.453	219.287
			Barclays Plc	91.041	217.822

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
BNP Paribas Issuance BV (WTS) (Zero Coupon) 18-Nov-2021	979.430	82.863.070	iShares Physical Gold ETC - ETF	6.477.247	184.887.944
WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	14.626.056	81.855.354	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	2.438.069	112.796.302
Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	768.117	65.346.594	BNP Paribas Issuance BV (WTS) (Zero Coupon) 18-Nov-2021	979.430	88.379.821
Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	768.117	65.064.311	Invesco Physical Gold ETC - ETF	467.947	67.408.967
JPMorgan Chase & Co	329.358	44.254.098	Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021	681.793	65.789.142
AstraZeneca Plc	512.646	43.493.378	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021	685.759	63.678.237
Sony Group Corp	384.100	32.967.017	ConocoPhillips	1.051.019	56.549.899
Bank of America Corp	739.685	30.667.878	WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF	333.482	47.896.228
iShares Physical Gold ETC - ETF	1.017.911	29.880.776	Citigroup Inc	742.989	44.294.530
ConocoPhillips	567.564	28.423.153	Texas Instruments Inc	261.302	43.544.896
Thermo Fisher Scientific Inc	68.532	26.984.111	Anglo American PLC	1.210.859	43.336.018
Chubb Ltd	146.856	24.759.871	Amundi Physical Gold ETC - ETF	717.037	43.140.972
Home Depot Inc/The	109.573	24.327.449	Zurich Insurance Group AG	93.414	35.592.238
Avantest Corp	302.200	22.699.578	Home Depot Inc/The	109.573	34.420.121
WisdomTree Copper - ETF	696.569	21.565.764	Kansas City Southern/Old	137.026	29.123.045
Taylor Wimpey Plc	10.199.061	20.233.534	Vivendi SE	1.024.411	29.035.310
Trane Technologies Plc	123.395	19.514.721	iShares Physical Silver ETC - ETF	1.402.212	25.873.397
Fidelity National Information Services Inc	169.277	19.016.063	Alphabet Inc - Class A	16.158	25.708.702
IDEXX Laboratories Inc	33.690	18.798.423	Novartis AG	321.495	23.202.750
Relx Plc	1.126.650	17.859.528	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	483.175.100	20.791.556
Alphabet Inc - Class A	8.075	17.358.791	Relx Plc	1.209.100	20.091.815
Novozymes A/S	318.234	16.833.789			
Hubbell Inc - Class B	92.028	16.701.167			
Star Entertainment Grp Ltd/The	7.051.000	16.628.086			
Morgan Stanley	190.085	16.410.430			
Zoetis Inc	93.961	16.352.682			
Universal Music Group NV	646.018	16.300.762			
TE Connectivity Ltd	143.930	15.800.784			
Nestle SA	127.890	15.548.112			
Yum China Holdings Inc	287.833	15.382.665			
DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	169.730	15.368.375			
Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021	162.948	14.568.721			
Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021	168.706	14.476.623			
Alibaba Group Holding Ltd	656.133	14.325.303			
CME Group Inc	81.903	13.856.410			

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Apr-2022	3.600.000	3.599.747	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Oct-2021	3.100.000	3.100.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Oct-2021	3.100.000	3.099.541	iShares Physical Gold ETC - ETF	125.244	3.058.515
BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) (WTS) 18-Nov-2021	23.500	1.759.306	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	53.230	2.110.440
WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	337.922	1.611.200	BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) (WTS) 18-Nov-2021	23.500	1.779.969
Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	18.267	1.315.971	Invesco Physical Gold ETC - ETF	14.032	1.763.870
Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	18.267	1.313.227	Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021	16.788	1.371.779
AstraZeneca Plc	12.309	902.621	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021	16.862	1.328.879
JPMorgan Chase & Co	7.280	834.760	WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF	9.100	1.114.006
Sony Group Corp	9.000	663.768	Amundi Physical Gold ETC - ETF	17.865	943.222
Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	7.650	646.756	Texas Instruments Inc	6.250	878.778
Bank of America Corp	16.548	580.021	Citigroup Inc	16.271	824.876
Thermo Fisher Scientific Inc	1.618	548.684	ConocoPhillips	17.822	783.383
Chubb Ltd	3.531	505.041	Zurich Insurance Group AG	2.230	717.512
Home Depot Inc/The	2.627	496.057	Home Depot Inc/The	2.627	704.956
ConocoPhillips	10.459	490.640	Anglo American PLC	21.193	667.848
Advantest Corp	7.300	467.015	Kansas City Southern/Old	3.433	626.150
Relx Plc	31.106	464.623	Vivendi SE	25.318	618.366
WisdomTree Copper - ETF	16.423	436.099	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	15.784.300	584.026
Trane Technologies Plc	2.967	399.325	Relx Plc	31.074	461.001
Taylor Wimpey Plc	220.849	379.038	Novartis AG	7.471	455.210
Fidelity National Information Services Inc	3.809	374.823	iShares Physical Silver ETC - ETF	27.236	426.946
IDEXX Laboratories Inc	782	373.124			
TE Connectivity Ltd	3.669	350.581			
Hubbell Inc - Class B	2.228	343.584			
Novozymes A/S	7.512	339.813			
Zoetis Inc	2.259	337.935			



BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2022	28.000.000	28.262.305	iShares Physical Gold ETC - ETF	523.658	17.773.439
United States Treasury Note/Bond 2.125% 15-Aug-2021	14.300.000	14.380.906	United States Treasury Note/Bond 2.125% 15-Aug-2021	14.300.000	14.300.000
WisdomTree WTI Crude Oil - ETF	1.529.575	10.088.782	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	206.153	11.181.696
BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon)	85.400	8.597.518	BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021	85.400	8.701.406
Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	79.137	7.913.700	Amundi Physical Gold ETC - ETF	114.098	8.078.985
Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	79.137	7.913.700	Invesco Physical Gold ETC - ETF	41.940	7.254.829
JPMorgan Chase & Co	44.302	7.071.856	Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021	59.801	6.782.887
AstraZeneca Plc	54.550	5.656.055	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021	60.044	6.582.239
ConocoPhillips	74.276	4.801.408	Home Depot Inc/The	14.193	5.161.509
Sony Group Corp	44.100	4.523.170	Texas Instruments Inc	25.184	4.834.729
Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	36.101	4.199.993	Citigroup Inc	64.673	4.461.860
Thermo Fisher Scientific Inc	8.052	3.899.570	ConocoPhillips	69.600	4.285.239
Home Depot Inc/The	14.193	3.822.129	Zurich Insurance Group AG	8.953	3.896.979
Norfolk Southern Corp	14.037	3.805.643	Anglo American PLC	85.974	3.789.223
Bank of America Corp	73.944	3.485.325	Vivendi SE	104.874	3.536.622
Chubb Ltd	17.417	3.349.837	WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF	20.241	3.411.306
Relx Plc	159.938	3.294.341	Kansas City Southern/Old	12.686	3.233.737
RWE AG	81.382	3.129.198	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	63.439.600	3.168.287
Advantest Corp	35.400	3.126.439	Novartis AG	35.239	2.917.144
Linde Plc	10.902	3.038.539	Relx Plc	132.518	2.541.244
TE Connectivity Ltd	21.113	2.841.804	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	20.686	2.391.160
Trane Technologies Plc	14.635	2.682.951	Fidelity National Information Services Inc	16.720	2.015.475
iShares Physical Gold ETC - ETF	75.516	2.680.848			

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	558.158.076	558.158.076	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	522.244.000	522.244.000
Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026	20.000.000	20.000.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	16.449.000	17.422.496
Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	10.605.000	12.945.394	Ithaca Energy North Sea PLC 'REGS' 9.375% 15-Jul-2024	16.500.000	17.273.850
Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023	10.346.000	12.158.810	Nouryon Holding BV 'REGS' 6.500% 01-Oct-2026	13.000.000	16.207.221
INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	9.595.000	11.845.627	MARB BondCo PLC 'REGS' 7.000% 15-Mar-2024	15.700.000	15.974.750
Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	11.000.000	11.266.250	RAC Bond Co PLC 'REGS' 5.000% 06-Nov-2022	11.347.000	15.823.355
FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	10.104.000	11.226.094	Groupe Ecore Holding SAS 'REGS' FRN 6.250% 15-Nov-2023	10.355.000	11.807.207
Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	8.019.368	10.381.345	Synlab Bondco PLC 'REGS' FRN 4.750% 01-Jul-2025	9.250.000	11.388.000
Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.561% 25-Jan-2023	8.000.000	10.268.127	INEOS Group Holdings SA 'REGS' 5.375% 01-Aug-2024	9.626.000	11.150.110
Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026	13.550.000	10.222.168	INEOS Styrolution Group GmbH 'REGS' 2.250% 16-Jan-2027	9.000.000	10.558.705
Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026	8.400.000	9.995.053	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 1.865% 13-Jun-2022	8.000.000	9.719.379
Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	9.000.000	9.804.900	DNO ASA '144A' 8.750% 31-May-2023	9.300.000	9.667.207
TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	8.000.000	9.748.188	Constantin Investissement 3 SASU 'REGS' 5.375% 15-Apr-2025	7.000.000	8.645.391
Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024	9.000.000	9.581.270	Rubis Terminal Infra SAS 'REGS' 5.625% 15-May-2025	6.850.000	8.580.959
Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026	7.860.000	9.244.415	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023	8.000.000	8.477.500
LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	8.000.000	8.782.500	EC Finance PLC 'REGS' 2.375% 15-Nov-2022	7.000.000	8.267.105
Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	7.000.000	8.554.935	XPO Logistics Inc '144A' 6.500% 15-Jun-2022	8.192.000	8.192.000
PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026	7.000.000	8.523.294	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	7.684.000	7.927.940
Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	7.949.000	8.513.121	Synthomer PLC 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025	6.000.000	7.499.438
Groupe Ecore Holding SAS 'REGS' FRN 6.250% 15-Nov-2023	7.355.000	8.487.681	Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027	6.240.000	7.469.939

BNY Mellon Global Unconstrained Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
AstraZeneca Plc	2.908	330.768	Ebara Corp	12.300	600.757
HDFC Bank Ltd ADR	4.288	325.548	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	7.696	426.428
SAP SE	1.784	257.310	Merck & Co Inc	4.993	375.936
Smurfit Kappa Group Plc	4.773	250.782	Novartis AG	4.490	366.985
GlaxoSmithKline Plc	12.386	250.254	Naspers Ltd	1.791	307.407
Legrand SA	2.469	242.313	Lennar Corp	2.603	258.229
Hays Plc	103.266	233.800	Ferguson Plc	1.551	225.324
Ecolab Inc	801	184.099	Continental AG	1.678	225.259
Greencoat UK Wind Plc/Funds	92.893	168.441	Royal Dutch Shell PLC	9.202	204.083
Barclays Plc	59.772	165.924	Thales SA	1.771	181.937
CME Group Inc	774	159.877	Brenntag SE	1.904	167.470
Novozymes A/S	2.429	151.033	Prosus NV	1.870	164.285
T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	149.000	149.000	Albemarle Corp	732	153.066
VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	107.147	146.202	Microsoft Corp	420	139.024
M3 Inc	2.100	140.507	BAE Systems PLC	16.952	127.824
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	105.000	124.979	ams AG 'REGS' 6.000% 31-Jul-2025	100.000	125.805
Alibaba Group Holding Ltd	4.000	114.524	Applied Materials Inc	1.048	121.296
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	8.000	104.305	Citigroup Inc	1.581	112.616
Zurich Insurance Group AG	244	103.723	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	1.014	106.150
Mastercard Inc	267	94.335	Alphabet Inc - Class A	35	102.622
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	1.017	85.074	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031	340.000	96.517
Universal Music Group NV	2.722	76.339	Samsung SDI Co Ltd	110	70.810
Suzuki Motor Corp	1.400	60.347	Goldman Sachs Group Inc/The	189	62.226
Alcon Inc	747	52.322	M3 Inc	600	58.592
T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	47.000	46.698	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	915	56.217
Prudential Plc	1.976	42.657	Vivendi SE	1.394	52.760

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund für das Geschäftsjahr zum  
31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten JPY	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse JPY
Optorun Co Ltd	357.600	908.306.755	BayCurrent Consulting Inc	24.800	423.717.858
Direct Marketing MIX Inc	227.200	743.514.384	Sanken Electric Co Ltd	78.400	416.627.000
Anicom Holdings Inc	534.300	514.319.333	Arata Corp	77.300	317.547.639
TechMatrix Corp	251.300	499.403.038	Insource Co Ltd	112.700	260.567.750
MCJ Co Ltd	397.100	417.766.982	Premium Group Co Ltd	72.700	226.056.121
Ain Holdings Inc	58.400	380.879.228	Direct Marketing MIX Inc	53.600	214.809.556
Nippon Gas Co Ltd	191.500	362.281.812	Dowa Holdings Co Ltd	44.300	199.028.432
Aida Engineering Ltd	327.800	327.754.272	RS Technologies Co Ltd	29.300	190.159.905
Nifco Inc/Japan	83.400	305.256.787	MCJ Co Ltd	164.100	189.464.549
Takeei Corp	228.800	296.073.630	Yonex Co Ltd	206.300	180.415.606
Anritsu Corp	120.900	271.179.506	m-up Holdings Inc	48.000	179.442.879
RS Technologies Co Ltd	45.400	269.930.327	Resorttrust Inc	86.400	172.457.275
Sakata INX Corp	234.600	256.265.971	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	57.700	169.546.783
Japan Medical Dynamic Marketing Inc	112.100	250.037.669	Vision Inc/Tokyo Japan	112.700	164.881.652
Resorttrust Inc	153.200	244.463.861	Osaki Electric Co Ltd	236.900	140.261.303
Totetsu Kogyo Co Ltd	90.800	230.017.860	Vector Inc	112.600	138.581.986
Dowa Holdings Co Ltd	52.000	223.335.886	BrainPad Inc	19.900	119.676.252
Takeuchi Manufacturing Co Ltd	73.000	201.764.229	TRE Holdings Corp	68.036	117.951.517
Zenkoku Hosho Co Ltd	36.600	177.977.277	Atrae Inc	55.200	113.012.976
Wacom Co Ltd	223.300	173.117.911	Takeei Corp	56.800	104.715.296
m-up Holdings Inc	58.200	141.901.573	Zenkoku Hosho Co Ltd	19.600	100.882.517
Arata Corp	28.700	134.787.744	Nippon Gas Co Ltd	29.300	89.697.115
Vector Inc	119.400	117.094.085	Wacom Co Ltd	65.900	60.635.006
Fibergate Inc/Japan	69.700	114.238.277	Sakata INX Corp	46.200	51.013.438
Premium Group Co Ltd	45.600	113.284.683			

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Prudential Plc	1.796.500	30.789.565	Reckitt Benckiser Group PLC	447.400	30.302.774
Fortinet Inc	106.300	18.311.858	Novartis AG	397.379	29.508.045
Microsoft Corp	65.100	13.282.801	Cerner Corp	470.052	28.311.673
Compass Group Plc	528.000	9.742.470	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	202.370	20.905.510
Adobe Inc	23.900	9.604.836	Walt Disney Co/The	114.227	18.069.324
NIKE Inc	74.800	8.234.252	Waters Corp	60.408	17.248.589
Linde Plc	29.200	7.200.111	Oracle Corp	273.296	17.034.548
Edwards Lifesciences Corp	91.000	6.888.280	Cisco Systems Inc/Delaware	347.214	15.837.771
Walt Disney Co/The	46.800	6.860.037	Johnson & Johnson	112.363	15.766.359
L'Oreal SA	18.000	6.627.560	Booking Holdings Inc	8.159	15.646.594
Roche Holding AG	22.200	6.465.815	Colgate-Palmolive Co	213.209	14.586.761
Oracle Corp	92.300	6.016.341	AIA Group Ltd	1.368.600	14.203.533
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	43.400	5.988.872	Industria de Diseno Textil SA	457.100	13.232.112
Intuitive Surgical Inc	8.500	5.824.492	Novo Nordisk A/S	187.119	12.891.809
Cisco Systems Inc/Delaware	131.000	5.808.656	Keyence Corp	28.900	12.812.616
Alphabet Inc	2.700	5.277.390	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	21.601	12.602.319
Booking Holdings Inc	2.700	5.063.912	Alphabet Inc	6.182	12.427.647
Alimentation Couche-Tard Inc	160.300	4.956.712	FANUC Corp	61.600	12.209.462
TJX Cos Inc/The	88.600	4.877.897	Edwards Lifesciences Corp	129.522	12.182.381
Cognizant Technology Solutions Corp	72.900	4.467.418	Intuitive Surgical Inc	15.908	12.028.177
Kone Oyj - Class B	59.800	3.988.628	Texas Instruments Inc	77.429	11.846.350
Novo Nordisk A/S	54.600	3.699.741	Cognizant Technology Solutions Corp	176.910	11.559.590
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	40.400	3.698.562	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	80.900	11.463.219
Waters Corp	14.000	3.589.436	Amphenol Corp - Class A	195.268	11.253.215
Nestle SA	34.800	3.460.176	Nestle SA	112.398	11.029.664
Johnson & Johnson	24.500	3.448.946	L'Oreal SA	30.876	10.973.496
Mastercard Inc	11.500	3.446.631	Microsoft Corp	46.081	10.863.169
Keyence Corp	8.600	3.373.440	Automatic Data Processing Inc	65.279	10.625.990
Dassault Systemes SE	18.200	3.368.687	Roche Holding AG	34.396	10.370.676
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	5.300	3.331.902	Adobe Inc	18.300	10.240.244
Stryker Corp	16.000	3.322.435	SGS SA	4.071	10.187.878
Texas Instruments Inc	20.700	3.184.558	Stryker Corp	43.587	9.246.644
CSL Ltd	17.500	3.027.064	Linde Plc	36.974	9.062.799
Fastenal Co	70.000	3.010.112	Hong Kong & China Gas Co Ltd	7.342.069	8.658.625
AIA Group Ltd	255.600	2.801.297	Kone Oyj - Class B	114.904	7.880.154
Amphenol Corp - Class A	46.300	2.594.414	Alimentation Couche-Tard Inc	245.289	7.547.582
Canadian National Railway Co	28.500	2.536.248	TJX Cos Inc/The	123.618	7.267.816
FANUC Corp	13.400	2.494.226	Mastercard Inc	22.527	6.795.228
			Dassault Systemes SE	134.557	6.552.847
			Fastenal Co	147.843	6.531.865
			Experian Plc	190.656	6.282.409

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Mobility Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Alstom SA	388.702	20.530.970	Tesla Inc	25.271	20.887.730
NIO Inc ADR	428.349	19.883.088	General Motors Co	327.768	18.511.098
MP Materials Corp	580.559	19.050.132	LG Chem Ltd	26.991	17.874.713
Magna International Inc (Units)	239.761	18.951.011	Yandex NV - Class A	205.359	15.235.613
Lyft Inc	330.987	18.081.638	NIO Inc ADR	428.349	13.843.655
Plug Power Inc	509.483	17.803.095	Raven Industries Inc	234.302	13.513.404
Uber Technologies Inc	326.564	17.106.696	Plug Power Inc	250.097	11.310.207
Everbridge Inc	131.848	16.870.234	Workhorse Group Inc	318.553	10.221.417
General Motors Co	330.908	16.543.652	Meituan - Class B '144A'	294.000	10.070.724
Twilio Inc - Class A	49.241	16.314.710	ON Semiconductor Corp	254.078	9.249.669
Semtech Corp	221.177	15.868.694	FLIR Systems Inc	173.578	9.187.266
Schneider Electric SE	96.733	15.443.317	JD.com Inc ADR	113.026	8.641.246
ANSYS Inc	35.204	13.148.269	NextEra Energy Inc	106.511	7.775.835
Daimler AG	161.973	13.096.863	Virgin Galactic Holdings Inc	193.068	7.613.505
XPeng Inc ADR - Class A	281.852	12.270.582	Aptiv Plc	40.263	6.152.380
Zuora Inc	717.738	12.075.946	Daimler AG	61.146	5.225.047
Alphabet Inc	4.856	11.549.936	MediaTek Inc	168.000	5.157.101
Marvell Technology Group Ltd	216.411	11.022.025	Samsung SDI Co Ltd	8.084	5.083.875
LG Chem Ltd	13.481	10.638.811	Littelfuse Inc	15.116	3.917.239
CNH Industrial NV	642.329	10.268.957	ABB Ltd	91.076	3.218.154
Samsung SDI Co Ltd	15.129	9.939.925	STMicroelectronics NV	65.420	2.424.495
Alfen Beheer BV '144A'	113.887	9.860.083			
Visteon Corp	82.987	9.824.457			
Aptiv Plc	63.557	9.705.348			
Geely Automobile Holdings Ltd	2.948.000	9.682.421			
CrowdStrike Holdings Inc	36.112	9.666.400			
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	1.065.770	9.613.114			
QUALCOMM Inc	68.892	9.556.711			
NVIDIA Corp	28.305	9.555.375			
Lumentum Holdings Inc	103.114	9.322.677			
East Japan Railway Co	134.500	9.242.535			
MediaTek Inc	264.000	9.101.070			
Splunk Inc	54.839	8.393.864			
Hanon Systems	577.886	8.322.963			
Tesla Inc	10.212	8.144.955			
STMicroelectronics NV	179.532	7.678.189			
Denso Corp	114.300	7.645.925			
Siemens AG	46.424	7.613.312			
Infineon Technologies AG	170.327	7.322.513			
ON Semiconductor Corp	170.354	7.262.829			
Taiyo Yuden Co Ltd	127.700	7.046.374			
Diodes Inc	72.194	6.279.139			
Rockwell Automation Inc	21.603	6.128.624			
Eaton Corp Plc	42.323	6.031.265			

BNY Mellon S&P 500® Index Tracker\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Enphase Energy Inc	135	27.456	Apple Inc	18.447	2.378.455
Devon Energy Corp	222	4.067	Microsoft Corp	8.727	1.859.888
Pioneer Natural Resources Co	28	3.783	Amazon.com Inc	492	1.539.044
SL Green Realty Corp (REIT)	2	128	Tesla Inc	875	738.603
			Facebook Inc	2.774	682.498
			Alphabet Inc - Class A	347	600.837
			Alphabet Inc - Class C	335	583.140
			Berkshire Hathaway Inc	2.246	527.670
			JPMorgan Chase & Co	3.517	495.912
			Johnson & Johnson	3.038	487.902
			Visa Inc	1.956	395.375
			Procter & Gamble Co/The	2.860	388.552
			UnitedHealth Group Inc	1.094	383.675
			NVIDIA Corp	715	377.652
			Walt Disney Co/The	2.089	362.510
			Home Depot Inc/The	1.242	333.290
			Mastercard Inc	1.015	332.388
			PayPal Holdings Inc	1.352	327.064
			Bank of America Corp	8.781	298.100
			Intel Corp	4.727	279.250

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	28.147	2.186.551	D'ieteren Group	20.002	2.317.557
Publicis Groupe SA	37.601	2.071.195	Teleperformance	6.005	1.951.081
Eiffage SA	19.840	1.764.238	HelloFresh SE	23.496	1.892.882
Kleipierre SA (REIT)	75.762	1.534.976	Sartorius AG - Preference	3.224	1.698.389
Aegon NV	428.164	1.507.421	Euronext NV '144A'	14.279	1.254.231
Covestro AG '144A'	25.381	1.423.840	Valmet Oyj	36.378	1.251.657
Krones AG	14.007	1.323.844	Stroeer SE & Co KGaA	18.634	1.237.609
Almirall SA	85.311	1.266.295	Euskaltel SA '144A'	108.891	1.200.898
Roxel SA	70.430	1.199.504	Dialog Semiconductor Plc	17.817	1.173.434
Italgas SpA	197.681	1.081.119	Kemira Oyj	80.517	1.094.102
HUGO BOSS AG	19.949	1.014.134	BE Semiconductor Industries NV	14.770	1.032.651
Banca IFIS SpA	63.294	981.853	ASTM SpA	34.866	976.248
Unipol Gruppo SpA	187.718	951.698	Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros	557.416	952.265
Aalberts NV	17.868	937.146	Iliad SA	5.125	915.324
DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	23.872	905.655	Hella GmbH & Co KGaA	14.479	893.306
Outokumpu Oyj	165.316	845.600	Unipol Gruppo SpA	203.790	856.609
Gestamp Automocion SA '144A'	186.632	821.315	Arcadis NV	21.594	849.978
Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros	446.460	807.611	Leroy Seafood Group ASA	104.905	814.673
Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	83.453	797.837	Cofinimmo SA (REIT)	5.762	806.157
Alten SA	5.329	786.685	Unicaja Banco SA '144A'	1.005.574	801.588
Nobina AB '144A'	105.534	773.190	Cewe Stiftung & Co KGAA	6.162	780.036
Iren SpA	312.185	753.835	Cie Plastic Omnium SA	34.830	769.187
Trigano SA	4.616	749.574	KION Group AG	8.027	743.910
Elis SA	44.905	748.355	Royal Unibrew A/S	7.546	735.539
Deutz AG	100.320	735.803	Talanx AG	20.371	695.845
Telefonica Deutschland Holding AG	289.918	709.497	Adapteo Oyj	42.712	689.522
AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	22.957	668.642	Signify NV '144A'	15.299	678.318
Deutsche EuroShop AG	36.998	651.508	AMG Advanced Metallurgical Group NV	22.091	641.470
BPER Banca	356.956	623.841	Kindred Group Plc SDR	49.298	569.188
flatexDEGIRO AG	5.141	582.381	UDG Healthcare Plc (Units)	44.004	556.672
Ubisoft Entertainment SA	8.857	579.764	Bankinter SA	123.486	556.118
Dermapharm Holding SE	7.049	577.270	Almirall SA	39.028	432.715
Schaeffler AG - Preference	72.608	560.297			
Scandic Hotels Group AB '144A'	168.197	552.787			
GFT Technologies SE	12.206	520.445			
Heidelberger Druckmaschinen AG	166.205	443.045			



BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
AstraZeneca Plc	1.917	241.025	Bristol-Myers Squibb Co	4.652	276.866
Guardant Health Inc	1.841	235.231	Laboratory Corp of America Holdings	917	251.384
Eli Lilly & Co	1.184	225.725	IQVIA Holdings Inc	1.014	248.988
Lonza Group AG	277	212.535	Novartis AG	2.588	243.613
ICON Plc	776	180.413	Charles River Laboratories International Inc	579	226.532
Beam Therapeutics Inc	1.639	178.922	Roche Holding AG	581	213.384
Pacific Biosciences of California Inc	5.176	177.731	Syneos Health Inc	2.410	205.942
CRISPR Therapeutics AG	1.400	175.425	Illumina Inc	399	185.020
Kymera Therapeutics Inc	2.750	165.374	Neurocrine Biosciences Inc	1.882	185.014
Danaher Corp	570	144.373	Vertex Pharmaceuticals Inc	811	160.640
Denali Therapeutics Inc	2.692	141.229	Thermo Fisher Scientific Inc	327	159.113
Alnylam Pharmaceuticals Inc	683	123.465	Lonza Group AG	259	157.441
Moderna Inc	656	115.411	Dyne Therapeutics Inc	9.101	147.328
Quantarix Corp	2.346	115.183	Avantor Inc	3.615	139.669
Twist Bioscience Corp	901	110.393	Biogen Inc	466	121.233
Fate Therapeutics Inc	1.855	106.219	Bio-Techne Corp	211	93.998
Roche Holding AG	292	100.109	Moderna Inc	389	92.223
Catalent Inc	778	94.975	Repligen Corp	347	91.009
Ultragenyx Pharmaceutical Inc	896	85.463	Avidity Biosciences Inc	3.872	85.544
Avantor Inc	2.679	83.713	ICON Plc	287	79.387
Bristol-Myers Squibb Co	1.221	79.928	Eli Lilly & Co	313	78.824
Generation Bio Co	3.019	78.844	CRISPR Therapeutics AG	404	75.205
Sarepta Therapeutics Inc	925	77.811	AvroBio Inc	5.383	62.399
Biogen Inc	198	68.568	Amicus Therapeutics Inc	2.661	60.139
Adaptive Biotechnologies Corp	1.676	66.847	Intellia Therapeutics Inc	295	54.588
Dyne Therapeutics Inc	2.877	61.051	Merck KGaA	293	53.463
Illumina Inc	126	52.957	Passage Bio Inc	6.044	53.185
Intellia Therapeutics Inc	488	51.688	Danaher Corp	174	52.344
Laboratory Corp of America Holdings	190	51.531	Catalent Inc	409	41.857
uniQure NV	1.557	50.372			
Passage Bio Inc	1.920	46.830			
PTC Therapeutics Inc	1.050	45.549			
MeiraGTx Holdings plc	2.434	42.208			

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
United Kingdom Gilt 1.750% 07-Sep-2022	8.190.000	9.794.390	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750% 15-Jul-2028	12.211.939	11.796.179
French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	9.131.542	9.539.866	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	13.900.000	11.593.388
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	7.353.568	6.541.908	United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	11.900.000	10.280.964
Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	8.560.000	6.173.829	United Kingdom Gilt 1.750% 07-Sep-2022	8.190.000	9.852.688
Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	5.387.112	5.114.826	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	5.490.000	8.309.853
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023	5.630.000	4.962.808	Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	11.870.000	8.246.029
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	7.100.000	4.945.859	Norway Government Bond '144A' 1.750% 17-Feb-2027	71.790.000	7.184.004
United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	5.740.000	4.891.734	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022	835.550.000	6.468.133
Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	125.640.000	4.811.072	Indonesia Government International Bond 3.850% 15-Oct-2030	4.772.000	4.522.654
Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027	4.920.000	3.456.722	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	3.190.000	4.385.343
Colombia Government International Bond 'REGS' 7,000% 30-Jun-2032	14.335.400.000	3.447.717	Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022	517.800.000	4.112.634
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	3.518.063	3.441.081	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	4.780.000	4.100.327
Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026	3.780.000	3.366.119	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	3.708.656	3.934.025
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	70.360.000	3.342.641	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	2.445.819	3.402.134
European Investment Bank 'EMTN' 1.500% 12-May-2022	32.520.000	3.240.834	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	3.657.677	3.294.936
International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	252.960.000	2.942.581	Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.000% 15-Apr-2026	3.450.000	3.229.486
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	2.729.602	2.899.986	Treasury Corp of Victoria 2.250% 20-Nov-2034	4.410.000	2.920.854
International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	3.380.000	2.823.554	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046	2.729.602	2.831.429
European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026	3.300.000	2.774.858	German Postal Pensions Securitisation PLC 3.750% 18-Jan-2021	2.450.000	2.450.000
Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	2.920.000	2.745.698	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	9.438.000.000	2.322.476
Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022	351.050.000	2.737.335	Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	2.710.000	2.310.102
Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028	3.252.000	2.735.186	CommScope Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2024	2.565.000	2.256.550
Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	2.173.000	2.513.584	Mexico Government International Bond 3.900% 27-Apr-2025	2.443.000	2.252.715
HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	2.840.000	2.424.108	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	2.595.000	2.219.457
			United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	2.725.000	2.212.644
			Pacific Life Global Funding II 'REGS' 1.375% 14-Apr-2026	2.500.000	2.205.671
			Tesla Inc '144A' 5.300% 15-Aug-2025	2.500.000	2.178.387
			UBS AG 'EMTN' FRN 4.750% 12-Feb-2026	2.145.000	2.145.000
			Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027	44.615.800	2.092.472
			Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021	120.000.000	2.059.428
			Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031	8.490.000	1.953.966

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022	15.177	1.291.164	WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF	15.119	2.163.396
Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022	15.177	1.285.587	iShares Physical Gold ETC - ETF	53.187	1.534.763
JPMorgan Chase & Co	9.401	1.262.253	Invesco Physical Gold ETC - ETF	9.058	1.306.339
Greencoast UK Wind Plc/Funds	776.315	1.196.177	BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021	14.070	1.269.620
BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021	14.070	1.192.588	Barclays Bank Plc 16-Aug-2021	12.731	1.228.469
WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF	8.240	1.177.179	Barclays Bank Plc 13-Aug-2021	12.687	1.178.090
Volkswagen AG - Preference	5.177	1.081.625	Texas Instruments Inc	6.692	1.120.655
Relx Plc	46.702	1.033.675	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	4.052.000	827.127
AstraZeneca Plc	11.853	1.031.047	Home Depot Inc/The	2.400	757.202
Wisdomtree Carbon	36.909	835.704	Zurich Insurance Group AG	1.927	734.017
CME Group Inc	4.751	810.868	Relx Plc	32.425	722.296
Sony Group Corp	8.800	770.198	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036	7.924.000.000	532.621
Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022	7.238	723.800	Kerry Group Plc	4.612	522.746
WisdomTree Copper - ETF	22.260	710.840	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	5.104	518.307
Linde Plc	2.891	697.865	Novartis AG	7.093	512.211
Prudential Plc	38.162	666.583	Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031	11.885.500	511.446
Medtronic Plc	6.181	653.664	Toyota Industries Corp	6.500	485.077
Thermo Fisher Scientific Inc	1.576	644.746	Amundi Physical Gold ETC - ETF	7.663	461.333
TE Connectivity Ltd	5.626	635.293	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	63.000	450.778
Barclays Bank PLC 16-Aug-2021	6.688	610.867	Fidelity National Information Services Inc	3.860	391.330
Morgan Stanley	6.927	604.831	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	36.999	376.533
Texas Instruments Inc	3.835	602.221	Kansas City Southern/Old	1.770	376.040
Continental AG	5.395	592.812	Vivendi SE	12.833	363.415
Barclays Bank PLC 13-Aug-2021	6.665	590.837	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	90.000	340.934
AIA Group Ltd	57.000	588.015	Bureau Veritas SA	11.908	335.461
Home Depot Inc/The	2.400	579.260			
Alphabet Inc - Class A	276	573.553			
Chubb Ltd	3.395	572.400			
HDFC Bank Ltd ADR	8.891	563.348			

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0.000% 12-Aug-2021	7.350.000	7.349.775	United States Treasury Bill 0.000% 14-Sep-2021	7.350.000	7.350.000
United States Treasury Bill 0.000% 14-Sep-2021	7.350.000	7.349.743	United States Treasury Bill 0.000% 12-Aug-2021	7.350.000	7.349.982
United States Treasury Bill 0.000% 14-Oct-2021	7.325.000	7.324.698	United States Treasury Bill 0.000% 14-Oct-2021	7.325.000	7.325.000
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022	5.750.000	7.090.212	United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2021	6.650.000	6.650.000
Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024	5.675.000	7.007.421	United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021	6.625.000	6.625.000
United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2021	6.650.000	6.649.963	United States Treasury Bill 0.000% 10-Jun-2021	6.600.000	6.600.000
United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021	6.625.000	6.624.884	United States Treasury Bill 0.000% 11-May-2021	6.500.000	6.500.000
United States Treasury Bill 0.000% 10-Jun-2021	6.600.000	6.599.995	Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024	5.050.000	6.123.267
United States Treasury Bill 0.000% 11-May-2021	6.500.000	6.499.962	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.450% 15-May-2025	4.550.000	5.753.598
United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	6.200.000	6.176.759	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021	4.750.000	5.643.570
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	4.550.000	5.258.146	United States Treasury Note/Bond 2.875% 30-Nov-2023	5.095.000	5.456.126
Bundesobligation 0.000% 10-Apr-2026	3.550.000	4.321.651	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	4.550.000	5.146.333
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	4.000.000	3.998.879	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	4.450.000	4.457.393
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	2.775.000	3.248.736	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-Nov-2048	3.330.000	4.063.796
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	48.000.000	2.485.332	United States Treasury Note/Bond 0.125% 15-May-2023	3.525.000	3.518.173
United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	1.925.000	2.445.315	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022	2.850.000	3.314.398
French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Mar-2023	1.925.000	2.371.435	United States Treasury Note/Bond 0.000% 14-Jan-2021	2.570.000	2.570.000
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.339.799	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	1.750.000	2.368.218
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.330.324	Australia Government Bond 2.250% 21-May-2028	2.925.000	2.346.394
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.329.978	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.344.926
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.329.695	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.335.703
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.327.601	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.334.312
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.321.754	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.333.801
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.319.930	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.332.488
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.314.357	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.324.236
Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.308.404	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.319.213
Fannie Mae or Freddie Mac '2.5 1/22' TBA 2.500% 31-Dec-2049	2.250.000	2.295.951	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.313.837
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021	1.875.000	2.290.959	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.301.464
			French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Mar-2023	1.925.000	2.272.031
			Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030	158.475.000	2.254.031

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	824	117.881	JPMorgan Chase & Co	1.262	189.432
Bank of America Corp	1.842	61.731	iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	1.097	156.258
Exxon Mobil Corp	978	48.750	Alphabet Inc - Class A	64	131.283
Newmont Corp	526	31.129	Goldman Sachs Group Inc/The	375	121.501
Zimmer Biomet Holdings Inc	189	30.478	Berkshire Hathaway Inc - Class B	475	115.915
Abbott Laboratories	241	29.700	Morgan Stanley	1.432	115.228
HCA Healthcare Inc	167	28.968	Medtronic PLC	956	111.014
Exelon Corp	665	28.313	Freeport-McMoRan Inc	3.194	104.469
Valero Energy Corp	276	21.660	Chubb Ltd	618	102.797
Hubbell Inc - Class B	125	21.368	Capital One Financial Corp	793	98.422
Vodafone Group PLC ADR	1.121	20.949	Marathon Petroleum Corp	1.744	97.210
Eli Lilly & Co	111	20.926	Eaton Corp PLC	723	96.132
EQT Corp	1.204	20.218	Voya Financial Inc	1.475	90.528
Philip Morris International Inc	239	20.129	Exelon Corp	2.173	86.803
United Therapeutics	120	19.953	PPL Corp	3.023	83.943
Weyerhaeuser Co (REIT)	583	19.198	CF Industries Holdings Inc	1.833	83.340
Truist Financial Corp	360	18.544	General Motors Co	1.590	83.150
Cloudera Inc.	1.258	18.351	Assurant Inc	625	80.024
Alphabet Inc - Class A	10	18.048	Applied Materials Inc	728	79.510
Assurant Inc	119	15.896	Las Vegas Sands Corp	1.220	75.704
Mosaic Co/The	555	14.876	Vulcan Materials Co	453	74.619
Ameriprise Financial Inc	67	14.335	Eli Lilly & Co	355	71.322
Voya Financial Inc	238	13.472	Hess Corp	1.068	71.259
VF Corp	156	12.574	Union Pacific Corp	341	69.151
Las Vegas Sands Corp	215	11.958	QUALCOMM Inc	494	67.588
Biogen Inc	43	11.951	Bank of America Corp	1.842	66.841
Marathon Petroleum Corp	265	11.928	NXP Semiconductors NV	336	58.758
PPL Corp	415	11.568	Exxon Mobil Corp	978	56.357
Chubb Ltd	62	9.808	Becton Dickinson and Co	221	53.647
			Corning Inc	1.441	53.359
			Micron Technology Inc	613	52.330
			Philip Morris International Inc	598	50.879
			Ally Financial Inc	1.188	50.744

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	30.291	13.126.210	SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	30.291	13.128.150
Exxon Mobil Corp	164.039	9.208.327	Goldman Sachs Group Inc/The	30.832	10.296.611
UnitedHealth Group Inc	19.765	8.276.641	PPL Corp	292.331	8.398.121
Exelon Corp	153.674	7.416.591	Eaton Corp Plc	53.770	8.045.760
Charles Schwab Corp/The	95.862	7.076.283	Chubb Ltd	46.951	7.873.395
Chubb Ltd	38.864	6.918.058	Bank of America Corp	193.595	7.797.505
Devon Energy Corp	262.019	6.624.035	Ally Financial Inc	157.425	7.763.269
Northrop Grumman Corp	17.019	6.248.832	JPMorgan Chase & Co	51.021	7.757.379
Cisco Systems Inc/Delaware	114.331	6.217.451	Morgan Stanley	88.354	7.383.690
CVS Health Corp	70.239	5.846.055	Marathon Petroleum Corp	115.994	6.597.593
Newmont Corp	89.263	5.379.397	CF Industries Holdings Inc	127.183	6.181.813
Merck & Co Inc	61.986	5.205.246	Union Pacific Corp	28.212	6.000.471
Wells Fargo & Co	111.421	5.068.352	Wells Fargo & Co	111.421	5.207.718
Bank of America Corp	124.014	4.735.272	Newmont Corp	89.263	5.100.539
Assurant Inc	31.248	4.670.930	Vulcan Materials Co	28.333	5.042.834
Willis Towers Watson Plc	20.341	4.659.541	Exxon Mobil Corp	79.926	4.888.298
Freeport-McMoRan Inc	122.628	4.553.767	Applied Materials Inc	37.346	4.657.962
Eli Lilly & Co	22.111	4.514.778	Eli Lilly & Co	19.967	4.544.975
Medical Properties Trust Inc (REIT)	213.287	4.467.003	Hess Corp	60.307	4.346.269
Comerica Inc	51.492	4.359.130	Philip Morris International Inc	45.667	4.344.534
JPMorgan Chase & Co	26.838	4.354.687	General Motors Co	77.378	4.282.308
Vistra Corp	222.216	4.336.252	L3Harris Technologies Inc	19.386	4.140.119
Morgan Stanley	45.000	4.322.339	Mondelez International Inc	67.293	4.115.421
AES Corp/The	171.691	4.263.384	Weyerhaeuser Co (REIT)	110.400	4.048.457
Organon & Co	124.689	4.142.291	QUALCOMM Inc	27.189	3.989.100
State Street Corp	44.774	4.123.947	Carrier Global Corp	79.402	3.928.465
Marathon Petroleum Corp	64.018	4.012.049	Medtronic PLC	32.551	3.694.661
Voya Financial Inc	64.466	3.905.874	Devon Energy Corp	96.431	3.679.767
Mondelez International Inc	67.293	3.860.230	Voya Financial Inc	55.366	3.559.583
AbbVie Inc	33.730	3.834.728	Las Vegas Sands Corp	61.868	3.415.788
Medtronic PLC	30.882	3.806.151	ConocoPhillips	65.646	3.278.206
QUALCOMM Inc	26.382	3.786.347	US Bancorp	60.198	3.210.596
Ameriprise Financial Inc	15.359	3.759.418	Assurant Inc	19.758	3.111.355
Norfolk Southern Corp	14.293	3.724.099	Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	58.652	3.110.613
US Bancorp	63.539	3.707.507	Phillips 66	38.091	3.076.311
Newell Brands Inc	141.155	3.585.506	Bristol-Myers Squibb Co	48.922	3.046.265
L3Harris Technologies Inc	16.077	3.400.582	Ameriprise Financial Inc	10.210	2.836.413
Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	57.980	3.178.626	Truist Financial Corp	48.029	2.639.453
International Game Technology Plc	119.928	3.115.097	VF Corp	33.193	2.633.769
Valero Energy Corp	38.668	3.073.467	Viatis Inc	192.131	2.601.325
Viatis Inc	192.131	2.990.348	Valero Energy Corp	38.668	2.574.723
EQT Corp	140.746	2.979.271	Charles Schwab Corp/The	31.511	2.457.038
CME Group Inc	12.906	2.910.922			
Clearway Energy Inc	89.479	2.800.374			
Vodafone Group Plc ADR	154.311	2.722.521			
General Motors Co	46.731	2.683.321			

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 3.303% 01-Nov-2039	21.635.000	23.084.329	Virginia College Building Authority 1.865% 01-Feb-2031	12.000.000	11.782.440
City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033	11.000.000	14.729.330	Massachusetts School Building Authority 1.753% 15-Aug-2030	11.000.000	11.192.060
City of New York NY 4.000% 01-Mar-2050	11.000.000	12.685.530	Triborough Bridge & Tunnel Authority 5.000% 15-Nov-2049	8.725.000	11.191.383
San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5.000% 01-May-2049	10.000.000	12.252.900	California Infrastructure & Economic Development Bank 2.716% 01-Oct-2040	10.240.000	10.164.224
Massachusetts School Building Authority 3.395 % 15-Oct-2040	11.450.000	12.142.761	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2044	8.000.000	10.081.200
New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Mar-2044	10.000.000	11.490.800	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045	5.500.000	7.127.560
Piedmont Municipal Power Agency 5.000% 01-Jan-2030	8.700.000	11.119.644	City Of South Miami Health Facilities Authority Inc 5.000% 15-Aug-2047	5.000.000	6.148.600
New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046	9.510.000	11.016.860	University of California 4.000% 15-May-2051	5.020.000	5.994.282
Triborough Bridge & Tunnel Authority 5.000% 15-Nov-2049	8.725.000	10.956.244	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.410% 01-Jul-2036	6.000.000	5.909.700
San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.375% 01-Aug-2034	10.000.000	10.690.900	Massachusetts Port Authority 5.000% 01-Jul-2040	4.000.000	5.146.920
California Community Choice Financing Authority 4.000% 01-Feb-2052	8.750.000	10.652.775	Sycamore Community City School District 4.000% 01-Dec-2028	3.270.000	4.037.600
State of New York 3.110% 15-Feb-2037	10.000.000	10.619.700	Black Belt Energy Gas District 4.000% 01-Oct-2049	3.470.000	3.928.248
New York State Urban Development Corp 2.840% 15-Mar-2032	10.000.000	10.450.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 0.010% 15-Nov-2052	3.000.000	3.000.000
California Infrastructure & Economic Development Bank 2.716% 01-Oct-2040	10.240.000	10.444.186	Tennessee Energy Acquisition Corp 4.000% 01-Nov-2049	2.245.000	2.484.542
Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045	8.000.000	10.347.200	New York City Housing Development Corp 4.249% 01-May-2030	2.340.000	2.340.000
New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028	10.000.000	10.007.200	California Housing Finance 3.656% 01-Feb-2029	2.000.000	2.000.000
Santa Monica-Malibu Unified School District 2.944% 01-Aug-2036	9.500.000	10.003.310	State of Texas 4.000% 01-Aug-2029	1.375.000	1.542.379
County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029	10.000.000	10.000.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 3.790% 01-Jul-2021	1.460.000	1.460.000
Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2044	8.000.000	9.959.920	New Jersey Higher Education Student Assistance Authority 3.350% 01-Dec-2029	1.140.000	1.140.000
Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034	9.890.000	9.890.000	County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033	1.000.000	1.061.450
University of California 1.997% 15-May-2031	10.000.000	9.874.400			
Indianapolis Local Public Improvement Bond Bank 4.000% 01-Jun-2040	8.000.000	9.311.840			
City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028	8.250.000	8.583.960			
State of New York 3.170% 15-Feb-2038	7.500.000	7.915.725			
Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039	7.600.000	7.791.216			
Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031	7.240.000	7.648.626			
North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033	7.000.000	7.165.480			
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-May-2043	6.000.000	6.961.320			
City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2036	5.110.000	6.343.758			
School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	5.435.000	6.342.047			
Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044	5.000.000	6.089.150			
Massachusetts School Building Authority 1.753% 15-Aug-2030	6.000.000	5.922.180			
University of California 4.000% 15-May-2051	5.020.000	5.914.966			
City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2040	4.500.000	5.692.410			
Pennsylvania Higher Educational Facilities Authority 4.000% 15-Aug-2044	4.965.000	5.670.129			
City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029	5.485.000	5.499.261			
State of Oregon Department of Transportation 2.851% 15-Nov-2032	5.000.000	5.427.900			
California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031	5.000.000	5.323.700			
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.400% 01-Aug-2025	5.000.000	5.321.500			

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund\* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036	8.965.000	10.819.176	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040	4.162.000	5.669.550
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028	8.311.000	8.291.200	American Tower Corp 0.500% 15-Jan-2028	3.766.000	3.729.416
Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	6.803.000	7.602.148	Commonwealth Bank of Australia 'REGS' 3.305% 11-Mar-2041	4.491.000	3.584.065
Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025	7.400.000	7.427.690	XLIT Ltd FRN 3.250% 29-Jun-2047	2.980.000	3.358.365
Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	7.034.000	7.011.913	UBS Group AG 0.625% 24-Feb-2033	3.416.000	3.323.495
Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	6.700.000	6.665.145	Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025	3.200.000	3.216.954
OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.125% 01-Jul-2024	6.242.000	6.315.113	BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024	3.000.000	3.099.930
CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	6.200.000	6.261.745	UBS AG/London 'eMTN' 0.750% 21-Apr-2023	2.910.000	2.965.668
CCEP Finance Ireland DAC 0.875% 06-May-2033	6.112.000	6.075.389	Morgan Stanley 'GMTN' 1.000% 02-Dec-2022	2.920.000	2.963.450
Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024	6.041.000	6.040.396	ALD SA 'EMTN' 1.250% 11-Oct-2022	2.900.000	2.945.820
HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028	4.800.000	6.032.844	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 2.500% 28-May-2024	2.684.000	2.878.021
XLIT Ltd FRN 3.250% 29-Jun-2047	5.247.000	5.898.806	SES SA FRN (Perpetual) 4.625% 02-Jan-2170	2.760.000	2.838.329
ING Groep NV 'EMTN' 1.000% 20-Sep-2023	5.700.000	5.873.287	Medtronic Global Holdings SCA 'EMTN' 0.000% 02-Dec-2022	2.695.000	2.709.595
Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.125% 05-Feb-2024	5.700.000	5.759.103	Molson Coors Beverage Co 1.250% 15-Jul-2024	2.579.000	2.664.598
Coca-Cola Co/The 0.800% 15-Mar-2040	5.941.000	5.663.128	Ball Corp 0.875% 15-Mar-2024	2.640.000	2.661.912
Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040	4.162.000	5.556.865	Heineken NV 'EMTN' 2.875% 04-Aug-2025	2.370.000	2.657.993
RELX Finance BV 0.000% 18-Mar-2024	5.361.000	5.385.712	Covivio Hotels SACA 1.000% 27-Jul-2029	2.600.000	2.654.951
CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.625% 03-Jul-2029	4.984.000	5.305.979	Diageo Finance PLC 'EMTN' 1.000% 22-Apr-2025	2.494.000	2.600.269
Grand City Properties SA 'EMTN' 0.125% 11-Jan-2028	5.500.000	5.305.671	National Australia Bank Ltd 'gmtn' 0.625% 30-Aug-2023	2.500.000	2.552.625
Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	5.326.000	5.261.917	Credit Agricole Assurances SA FRN 4.750% 27-Sep-2048	1.900.000	2.349.968
			AT&T Inc 1.800% 14-Sep-2039	2.250.000	2.318.850
			Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051	2.553.000	2.274.178
			Diageo Finance PLC 'EMTN' 2.375% 20-May-2026	2.029.000	2.262.545
			TenneT Holding BV FRN (Perpetual) 2.374% 22-Oct-2170	2.152.000	2.235.928
			Coca-Cola Europacific Partners PLC FRN 0.000% 16-Nov-2021	2.200.000	2.200.000
			Diageo Finance PLC 'EMTN' 2.500% 27-Mar-2032	1.840.000	2.197.420
			BMW Finance NV 'EMTN' 0.625% 06-Oct-2023	2.109.000	2.152.762

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.



# ANHANG 1

## OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (ungeprüft)

Gemäß der OGAW-V-Richtlinie, den irischen Umsetzungsvorschriften und den Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) zur Vergütung im Rahmen von OGAW („der OGAW-Vergütungskodex“) ist die Gesellschaft verpflichtet, Einzelheiten zu der von der Verwaltungsgesellschaft im Geschäftsjahr an ihre Mitarbeiter gezahlten Vergütung offenzulegen.

In Übereinstimmung mit den Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG, geändert durch die Richtlinie 2014/91/EG, (die „OGAW-Richtlinie“) unterliegt die Verwaltungsgesellschaft den in Artikel 14(b) der OGAW-Richtlinie genannten Vergütungsregelungen. Diese fordern von den Verwaltungsgesellschaften von OGAW die Einführung von Vergütungsvorschriften, -verfahren und -praktiken, die:

- mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind;
- nicht zur Übernahme von übermäßigen Risiken ermutigen, die mit den Risikoprofilen oder der maßgeblichen Dokumentation des OGAW nicht vereinbar sind; und
- die Verwaltungsgesellschaft des OGAW nicht daran hindern, pflichtgemäß im besten Interesse des OGAW zu handeln.

Die Verwaltungsgesellschaft wendet ihre Vergütungspolitik und -praxis in einer Weise an, die ihrer Größe und der Größe des von ihr verwalteten OGAW, ihrer internen Organisation und der Art, dem Umfang und der Komplexität ihrer Geschäfte angemessen ist. Daneben wendet die Verwaltungsgesellschaft bei der Ernennung von Dritten, die gemäß einer formalen Übertragungsvereinbarung im Namen des OGAW Anlageentscheidungen treffen, die sich auf das Risikoprofil der jeweiligen Teilfonds auswirken können, das Verhältnismäßigkeitsprinzip an.

Das Geschäftsmodell der Verwaltungsgesellschaft ist in weitestem Sinne darauf ausgelegt, nicht das Eingehen übermäßiger Risiken zu fördern. In Übereinstimmung mit den Anforderungen der OGAW-Richtlinie ergreift die Verwaltungsgesellschaft angemessene Maßnahmen, um natürliche Personen zu identifizieren, die der Verwaltungsgesellschaft Dienstleistungen erbringen und deren Tätigkeit einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und des von ihr verwalteten OGAW haben können, und die als „identifizierte Mitarbeiter“ bezeichnet werden, unter anderem:

- satzungsmäßige Verwaltungsratsmitglieder;
- Mitglieder der Geschäftsführung und andere Mitarbeiter auf derselben Einkommensstufe;
- die Leiter der Kontrollfunktionen und
- sonstige Risikoträger, unter anderem alle Mitarbeiter, deren Tätigkeiten – einzeln oder gemeinsam als Teil einer Gruppe – wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder eines von ihr verwalteten OGAW haben können.

Die geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhalten keine direkte Vergütung von der Verwaltungsgesellschaft. Die unabhängigen, nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhalten von der Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung für ihre Dienstleistungen, die ein festes und kein variables Vergütungselement enthält.

Die Geschäfte und Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft und des von ihr verwalteten OGAW werden weitgehend von Mitarbeitern anderer Unternehmen der BNY Mellon Group durchgeführt. Die Vergütung dieser Mitarbeiter wird von der Geschäftsführung des betreffenden Geschäftsbereichs in Übereinstimmung mit den globalen und regionalen Richtlinien, Grundsätzen und Praktiken von BNY Mellon festgelegt. Sofern es Service-Vereinbarungen gibt, oder die Portfolioverwaltung formal übertragen wurde, versucht die Verwaltungsgesellschaft sicherzustellen, dass Vergütungsvereinbarungen für identifizierte Mitarbeiter als ebenso wirksam eingestuft werden wie jene, denen die Verwaltungsgesellschaft direkt unterliegt, einschließlich der Grundsätze der Verhältnismäßigkeit. Daneben soll mit dem Risikorahmen, den die Verwaltungsgesellschaft bei Vereinbarungen zur Übertragung der Portfolioverwaltung zugrunde legt, sichergestellt werden, dass die bei diesen Dritten mit der Durchführung von Aufgaben betrauten Personen, nicht in der Lage sind, das Risikoprofil des OGAW wesentlich zu beeinflussen.

Die Vergütungsphilosophie und die Vergütungsgrundsätze von BNY Mellon basieren auf der Gewährung einer Gesamtvergütung, die ihre Kernwerte Kundenfokus, Integrität, Teamwork und herausragende Leistungen unterstützt. Leistung wird sowohl auf der Mitarbeiter- als auch auf Unternehmensebene belohnt und anhand finanzieller und anderer Faktoren bewertet. Dadurch sollen die Interessen von Mitarbeitern und Anteilshabern bzw. Kunden abgestimmt und Anreize für Aktivitäten geschaffen werden, die zu einem überdurchschnittlichen Finanzergebnis und langfristigem Wertzuwachs beitragen. Gleichzeitig soll sichergestellt werden, dass anreizbasierte Vergütungsvereinbarungen Mitarbeiter nicht zum Eingehen unnötiger und übermäßiger Risiken ermutigen. Die Gesamtvergütungsstruktur von BNY Mellon stellt ein ausgewogenes Verhältnis zwischen kurzfristigen und langfristigen Anreizen und eine Mischung aus Bar- und Aktienvergütung dar. Dies soll Mitarbeiter vom Eingehen übermäßiger Risiken abhalten, die sich nachteilig auf die langfristigen Ergebnisse von Unternehmen innerhalb der BNY Mellon Group auswirken können und einen wesentlichen Teil ihrer eigenen Vergütung beeinflussen.

BNY Mellon hat auf globaler, regionaler und auf Unternehmensebene Vergütungsausschüsse eingerichtet, die für die Überwachung der Mitarbeitervergütung und Mitarbeiterpläne und -programme zuständig sind. Die Verwaltungsgesellschaft verfügt nicht über einen gesonderten Vergütungsausschuss.

Vergütung für identifizierte Mitarbeiter für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021:

	<b>USD</b>
<b>Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr (ohne MwSt.)</b>	<b>433.406</b>
Davon feste Vergütung	241.795
Davon variable Vergütung	191.611

# ANHANG 2

## ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (ungeprüft)

### WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE

Die Gesellschaft hat am 27. November 2015 mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London (der „Verleiher“) eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen.

In der nachfolgenden Tabelle sind der Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere nach Fonds als Anteil der ausleihbaren Vermögenswerte insgesamt sowie der Nettoinventarwert jedes Fonds per 31. Dezember 2021 angegeben:

Fonds	Währung	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere	% der Summe der ausleihbaren Vermögenswerte	% des Nettoinventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	48.964.810	18,51	11,64
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	465.481	1,44	0,38
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	1.044.909	100,00	1,10
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	16.448.484	2,79	2,55
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	3.079.695	1,69	1,61
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	155.871	0,79	0,75
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	20.082.140	100,00	1,05
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	36.648.023	5,20	5,04
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	39.651.491	8,58	7,15
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	2.380.707	8,18	7,18
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	8.189.363	16,71	7,21
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	2.006.090	11,16	7,19
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	13.035.578	16,91	10,37
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	39.208.171	15,03	14,21
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	2.382.798	6,25	5,85
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	60.059.217	23,36	13,82
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	40.652.715	9,82	9,18
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	6.999.787	5,86	1,62
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	3.593.546	1,32	0,87
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	23.517.538	15,39	14,11
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	16.769.732	7,54	7,36
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	292.837	0,02	0,01
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	165.980	0,53	0,25
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	100.866.936	14,98	12,73
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.171.333	6,27	3,60
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	465.167.861	2,48	2,20
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	275.321	0,02	0,02
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	24.734.281	100,00	2,49
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	11.643.158	14,64	14,34
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	15.845.066	5,57	5,32

Die Sicherheiten werden im Namen des Verleihers im Auftrag seiner Kunden gehalten; die effektive Trennung nach zugrunde liegenden Kunden erfolgt in den Büchern und Aufzeichnungen des Verleihers. Die Sicherheiten werden auf einem Konto beim Tri-Party-Agent gehalten, der als Abrechnungs und Sammelstelle für Wertpapiere und Sicherheiten zwischen dem Verleiher und dem Entleiher fungiert. Als Tri-Party-Agents werden Euroclear, Global Collateral Management – The Bank of New York Mellon Institutional Bank und JPMorgan Chase Bank, N.A. genutzt (wenn JPMorgan der Entleiher ist). Bei bilateralen Geschäften werden die Sicherheiten auf einem Konto beim Verleiher gehalten.

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Beträge, die zum 31. Dezember 2021 bei jedem Sicherheitentreuhänder als Sachsicherheiten gehalten wurden, die im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden:

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>		<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	41.745.413		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	37.236.215
	Euroclear Triparty	11.668.557		Euroclear Triparty	223.504
		<b>53.413.970</b>			<b>37.459.719</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>		<b>GBP</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	512.816		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	3.120.320
		<b>512.816</b>		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	13.575.034
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>		<b>USD</b>		Euroclear Triparty	23.836.970
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	1.193.781		JPMorgan Chase Bank, N.A.	1.152.554
		<b>1.193.781</b>			<b>41.684.878</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	15.080.569		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	413.162
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	2.780.571		Euroclear Triparty	2.111.556
		<b>17.861.140</b>			<b>2.524.718</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	3.153.750		Euroclear Triparty	9.029.862
		<b>3.153.750</b>			<b>9.029.862</b>
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	83.787		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	431.655
	Euroclear Triparty	75.718		Euroclear Triparty	1.730.427
		<b>159.505</b>			<b>2.162.082</b>
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	21.303.384		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	509.053
		<b>21.303.384</b>		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.754.275
				Euroclear Triparty	11.768.583
					<b>14.031.911</b>

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>		<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>		<b>USD</b>
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		11.274.888	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		18.495.338
Euroclear Triparty		30.014.962			<b>18.495.338</b>
		<b>41.289.850</b>			
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>		<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>		<b>EUR</b>
Euroclear Triparty		2.430.658	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		322.352
		<b>2.430.658</b>			<b>322.352</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>		<b>GBP</b>
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		23.060.549	The Bank of New York Mellon Institutional Bank		169.468
The Bank of New York Mellon Institutional Bank		3.161.022			<b>169.468</b>
Euroclear Triparty		37.469.917			
		<b>63.691.488</b>	<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>		<b>USD</b>
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>		<b>USD</b>	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		2.561.092
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		7.566.142	The Bank of New York Mellon Institutional Bank		9.826.930
Euroclear Triparty		35.542.059	Euroclear Triparty		93.028.719
		<b>43.108.201</b>			<b>105.416.741</b>
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>		<b>USD</b>
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		4.846.536	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		581.685
Euroclear Triparty		2.661.106	Euroclear Triparty		669.524
		<b>7.507.642</b>			<b>1.251.209</b>
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>		<b>JPY</b>
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		756.342	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		473.254.470
The Bank of New York Mellon Institutional Bank		2.945.851	JPMorgan Chase Bank, N.A.		37.250.971
		<b>3.702.193</b>			<b>510.505.441</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>		<b>EUR</b>
The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		1.176.274	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London		289.724
The Bank of New York Mellon Institutional Bank		13.428.966			<b>289.724</b>
Euroclear Triparty		9.697.894			
		<b>24.303.134</b>			

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>		<b>USD</b>	<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>		<b>USD</b>
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	27.226.897		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	10.444.038
		<b>27.226.897</b>		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	6.580.204
					<b>17.024.242</b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>		<b>EUR</b>			
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	12.849.081			
		<b>12.849.081</b>			

Nachfolgend Angaben zu Art und Qualität der im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommenen Sicherheiten:

- (1) Schuldverschreibungen und Wertpapiere, die von folgenden Staaten, Behörden und Institutionen begeben oder garantiert wurden, sofern diese ein Rating von (i) mindestens AA der Ratingagentur Standard & Poor's oder (ii) mindestens AA der Ratingagentur Fitch bzw. (iii) mindestens Aa2 der Ratingagentur Moody's aufweisen: Australien, Belgien, Dänemark, Deutschland, Finnland, Frankreich, Irland, Italien, Japan, Kanada, Luxemburg, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Österreich, Portugal, Schweden, Schweiz, Spanien, das Vereinigte Königreich, die Vereinigten Staaten von Amerika;
- (2) Schuldverschreibungen, sofern diese ein Rating von (i) mindestens AAA der Ratingagentur Standard & Poor's oder (ii) mindestens AAA der Ratingagentur Fitch bzw. (iii) mindestens Aaa2 der Ratingagentur Moody's aufweisen, der folgenden supranationalen Emittenten: Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, Europäische Investitionsbank, Europäische Union, Interamerikanische Entwicklungsbank, Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung; International Finance Corporation;
- (3) Aktienwerte aus den folgenden Indizes: AEX 25 (Niederlande), CAC 40 (Frankreich), DAX 30 (Deutschland), Euro 50 (Eurozone), FTSE 100 (Vereinigtes Königreich), Nikkei 225 (Japan), SMI 20 (Schweiz), S&P 500 (Vereinigte Staaten von Amerika);
- (4) FTSE100 DBV (Klasse F10) wie im Crest Reference Manual definiert und
- (5) unstripped British Government Stock (Klasse UBG) wie im CREST Reference Manual definiert.

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Art und Qualität der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2021:

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	12.835.549		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	159.505
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	40.578.421				<b>159.505</b>
			<b>53.413.970</b>				
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>			<b>GBP</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	177.831		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	21.303.384
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	334.985				<b>21.303.384</b>
			<b>512.816</b>				
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	1.193.781		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	37.459.719
			<b>1.193.781</b>				<b>37.459.719</b>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.175.469		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	41.684.878
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	14.685.671				<b>41.684.878</b>
			<b>17.861.140</b>				
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.153.750		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.524.718
			<b>3.153.750</b>				<b>2.524.718</b>
				<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>			<b>USD</b>
					Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	9.029.862
							<b>9.029.862</b>
				<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>			<b>USD</b>
					Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.162.082
							<b>2.162.082</b>

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	14.031.911		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.458.843
			<b>14.031.911</b>		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	243.350
							<b>3.702.193</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	30.014.962		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	24.303.134
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	11.274.888				<b>24.303.134</b>
			<b>41.289.850</b>				
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.430.658		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	9.663.126
			<b>2.430.658</b>		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	8.832.212
							<b>18.495.338</b>
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>			<b>EUR</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	40.691.308		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	322.352
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	23.000.180				<b>322.352</b>
			<b>63.691.488</b>				
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>			<b>GBP</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	38.574.522		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	169.468
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	4.533.679				<b>169.468</b>
			<b>43.108.201</b>				
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>			<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.661.106		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	105.416.660
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	4.846.536		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	81
			<b>7.507.642</b>				<b>105.416.741</b>
				<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>			<b>USD</b>
					Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	776.307
					Aktien	Anerkannte Aktienindizes	474.902
							<b>1.251.209</b>



**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

<b>Fonds</b>	<b>Art der Sicherheiten</b>	<b>Qualität der Sicherheiten</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>			<b>JPY</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	237.257.543
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	<u>273.247.898</u>
			<b><u>510.505.441</u></b>
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>			<b>EUR</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	289.724
			<b><u>289.724</u></b>
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	9.092.865
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	<u>18.134.032</u>
			<b><u>27.226.897</u></b>
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>			<b>EUR</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	5.324.044
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	<u>7.525.037</u>
			<b><u>12.849.081</u></b>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>			<b>USD</b>
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	11.711.944
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	<u>5.312.298</u>
			<b><u>17.024.242</u></b>

In den folgenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, per 31. Dezember 2021 aufgeführt:

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>	<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund^</b>	<b>USD</b>
French Republic	5.867.878	United States of America	3.153.750
Amazon.com Inc	4.057.827		
Xilinx Inc	2.999.580	<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund^</b>	<b>USD</b>
JPMorgan Chase & Co	2.832.902	United States of America	83.788
Gilead Sciences Inc	2.498.310	French Republic	75.703
German Federal Republic	2.290.481	Republic of Austria	14
McDonald's Corp	2.278.364		
Moderna Inc	1.774.901	<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund^</b>	<b>USD</b>
Booking Holdings Inc	1.463.441	United States of America	21.303.384
Capital One Financial Corp	1.434.020		
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	<b>GBP</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund^</b>	<b>USD</b>
United States of America	102.338	United States of America	37.236.216
French Republic	49.892	French Republic	206.531
ITOCHU Corp	24.943	Republic of Finland	14.698
FUJIFILM Holdings Corp	24.943	European Investment Bank	1.684
Fast Retailing Co Ltd	24.943	Inter-American Development Bank	318
MINEBEA MITSUMI Inc	22.251	The Grand Duchy of Luxembourg	161
Kubota Corp	19.852	International Bank for Reconstruction & Development	111
Sojitz Corp	15.516		
Central Japan Railway Co	14.877	<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	<b>USD</b>
Japan Post Holdings Co Ltd	13.994	United States of America	15.857.020
		French Republic	12.266.043
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	<b>USD</b>	German Federal Republic	7.700.606
NVIDIA Corp	119.378	Kingdom of the Netherlands	1.490.085
L3Harris Technologies Inc	92.245	Commonwealth of Australia	1.206.506
Eli Lilly & Co	83.684	European Investment Bank	709.768
Boston Scientific Corp	62.220	International Bank for Reconstruction & Development	645.424
Abbott Laboratories	57.109	Kingdom of Sweden	521.595
BHP Group Plc	48.548	Republic of Austria	476.929
Amgen Inc	48.012	Republic of Finland	420.554
Global Payments Inc	47.283		
Cadence Design Systems Inc	45.869	<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	<b>USD</b>
Porsche Automobil Holding SE	45.548	United States of America	2.905.950
		Amazon.com Inc	1.374.000
		Xilinx Inc	972.081
		JPMorgan Chase & Co	718.586
		Gilead Sciences Inc	621.021
		McDonald's Corp	555.851
		Moderna Inc	433.022
		Meta Platforms Inc	400.256
		Pfizer Inc	384.023
		Booking Holdings Inc	357.105

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>	<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	<b>USD</b>
German Federal Republic	932.488	French Republic	3.275.076
French Republic	794.775	United States of America	2.714.934
United States of America	445.669	German Federal Republic	2.297.917
Kingdom of the Netherlands	240.243	European Investment Bank	1.575.302
Commonwealth of Australia	59.300	Norwegian Government	1.120.189
Republic of Austria	36.203	International Bank for Reconstruction & Development	1.012.324
Republic of Finland	6.361	Republic of Finland	709.090
International Bank for Reconstruction & Development	5.411	Kingdom of the Netherlands	346.510
European Investment Bank	3.946	Commonwealth of Australia	319.433
Government of Canada	229	Kingdom of Denmark	306.588
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	<b>EUR</b>
European Investment Bank	1.779.826	French Republic	15.336.005
French Republic	1.746.590	German Federal Republic	6.114.007
Norwegian Government	1.312.261	European Investment Bank	1.833.202
International Bank for Reconstruction & Development	1.126.634	International Bank for Reconstruction & Development	1.173.175
German Federal Republic	889.698	Norwegian Government	1.164.134
Republic of Finland	811.087	Kingdom of the Netherlands	1.147.731
United States of America	588.461	Commonwealth of Australia	969.038
Kingdom of Denmark	359.292	Volkswagen AG	939.963
Kingdom of the Netherlands	296.993	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	914.714
Inter-American Development Bank	116.694	Republic of Finland	895.562
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>	<b>EUR</b>
French Republic	645.099	French Republic	1.778.451
United States of America	431.655	German Federal Republic	344.457
European Investment Bank	280.493	Kingdom of Sweden	100.475
Norwegian Government	205.485	Kingdom of the Netherlands	62.061
International Bank for Reconstruction & Development	176.537	Commonwealth of Australia	50.371
Republic of Finland	142.646	Swiss Federation	48.683
German Federal Republic	136.073	Republic of Austria	21.805
Kingdom of Denmark	56.261	Republic of Finland	10.727
Kingdom of the Netherlands	47.602	International Bank for Reconstruction & Development	7.123
Inter-American Development Bank	18.611	European Investment Bank	6.138
		<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	<b>USD</b>
		French Republic	16.936.852
		German Federal Republic	12.796.591
		United States of America	3.162.585
		Commonwealth of Australia	2.646.649
		Kingdom of the Netherlands	2.089.024
		Republic of Austria	1.379.390
		Apple Inc	1.140.162
		Republic of Finland	895.748
		Rio Tinto Plc	843,477
		UnitedHealth Group Inc	691,701

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>		<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	
	USD		USD
German Federal Republic	11.395.856	United States of America	3.641.267
French Republic	10.390.864	French Republic	3.001.559
United Kingdom	9.445.966	German Federal Republic	1.804.767
United States of America	2.514.893	Kingdom of the Netherlands	1.165.853
Kingdom of the Netherlands	2.311.012	NVIDIA Corp	686.687
Commonwealth of Australia	807.845	L3Harris Technologies Inc	530.612
Kingdom of Sweden	604.364	Eli Lilly & Co	481.369
Republic of Austria	348.285	Boston Scientific Corp	357.900
European Investment Bank	294.143	Abbott Laboratories	328.504
Swiss Federation	292.657	BHP Group Plc	286.124
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>		<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	
	USD		EUR
French Republic	1.492.154	GlaxoSmithKline Plc	32.235
German Federal Republic	869.946	BHP Group Plc	32.235
Apple Inc	215.925	Prudential Plc	27.897
Rio Tinto Plc	211.258	Royal Dutch Shell Plc	26.347
United States of America	198.250	Meta Platforms Inc	25.202
UnitedHealth Group Inc	173.244	Unilever Plc	20.807
GlaxoSmithKline Plc	167.584	Vinci SA	18.315
Goldman Sachs Group Inc/The	157.297	Compass Group Plc	17.327
ViacomCBS Inc	145.419	Barclays Plc	17.322
BHP Group Plc	131.444	Ashtead Group Plc	17.121
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>		<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)^</b>	
	USD		GBP
United States of America	3.103.832	United States of America	169.468
French Republic	219.906		
German Federal Republic	51.646	<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>	
Kingdom of the Netherlands	48.517		USD
Government of Canada	34.942	French Republic	52.420.684
GlaxoSmithKline Plc	24.335	German Federal Republic	25.656.722
BHP Group Plc	24.335	United States of America	14.105.281
Prudential Plc	21.060	Kingdom of the Netherlands	4.101.854
Royal Dutch Shell Plc	19.890	United Kingdom	3.687.697
Meta Platforms Inc	19.025	European Investment Bank	1.489.987
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>		Commonwealth of Australia	949.311
	USD	Republic of Finland	944.011
United States of America	14.011.842	Norwegian Government	885.424
French Republic	5.060.255	International Bank for Reconstruction & Development	774.448
German Federal Republic	3.205.621		
United Kingdom	479.447		
Kingdom of the Netherlands	463.085		
European Investment Bank	314.833		
International Bank for Reconstruction & Development	296.002		
Commonwealth of Australia	223.565		
Republic of Finland	68.764		
Kingdom of Sweden	61.915		

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>	<b>Sicherheitsgeber</b>	<b>Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten</b>
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	<b>EUR</b>
German Federal Republic	41.1350	French Republic	2.153.934
French Republic	136.531	United States of America	1.829.189
Commonwealth of Australia	104.247	German Federal Republic	976.181
Tesla Inc	47.490	Meta Platforms Inc	348.997
Republic of Austria	44.940	Royal Dutch Shell Plc	328.180
Kingdom of the Netherlands	41.871	Xilinx Inc	316.129
IHS Markit Ltd	41.724	Intuit Inc	316.128
Apple Inc	38.733	Alphabet Inc	316.127
Keyence Corp	22.027	HSBC Holdings Plc	264.510
Pfizer Inc	18.135	GlaxoSmithKline Plc	185.947
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>	<b>JPY</b>	<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	<b>USD</b>
French Republic	104.239.201	United States of America	9.793.842
United States of America	78.331.806	German Federal Republic	1.251.883
Kingdom of the Netherlands	24.619.981	Kingdom of the Netherlands	403.719
NVIDIA Corp	20.738.383	Vinci SA	377.504
German Federal Republic	18.199.809	Tesla Inc	377.035
L3Harris Technologies Inc	16.024.839	General Motors Co	339.760
Eli Lilly & Co	14.537.660	Coca-Cola Co/The	306.539
Government of Canada	11.866.737	French Republic	262.500
Boston Scientific Corp	10.808.823	AT&T Inc	260.843
BHP Group Plc	10.242.149	GlaxoSmithKline Plc	255.353
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund^</b>	<b>EUR</b>		
United States of America	289.724		
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>	<b>USD</b>		
French Republic	5.779.892		
Meggitt Plc	1.560.624		
United States of America	1.304.940		
Koninklijke KPN NV	1.104.873		
Dassault Systemes SE	1.070.301		
Avast PLC	1.058.347		
Kingdom of the Netherlands	961.567		
German Federal Republic	941.509		
Stellantis NV	752.319		
Kering SA	638.742		

^ Wenn zum 31. Dezember 2021 weniger als zehn Sicherheitsgeber vorhanden waren, wurden alle Emittenten einbezogen.

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Währungen der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2021:

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	<b>USD</b>
Australischer Dollar	107.736	Kanadischer Dollar	86.982
Brasilianischer Real	24.922	Euro	313.437
Dänische Krone	184.117	Japanischer Yen	578.143
Euro	9.030.169	Pfund Sterling	230.523
Indische Rupie	21.973	US-Dollar	16.652.055
Indonesische Rupiah	42.420		<b>17.861.140</b>
Lari	2.385	<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	<b>USD</b>
Mexikanischer neuer Peso	58.882	US-Dollar	3.153.750
Norwegische Krone	685.656		<b>3.153.750</b>
Pfund Sterling	75.394	<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>	<b>USD</b>
Russischer Rubel	40.079	Euro	75.717
Südafrikanischer Rand	60.387	US-Dollar	83.788
Schwedische Krone	15.524		<b>159.505</b>
Schweizer Franken	26.993	<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	<b>USD</b>
Türkische Lira	1.097	US-Dollar	21.303.384
US-Dollar	43.036.236		<b>21.303.384</b>
	<b>53.413.970</b>	<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	<b>USD</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	<b>GBP</b>	Euro	223.167
Kanadischer Dollar	6.619	Pfund Sterling	1
Euro	88.445	US-Dollar	37.236.551
Japanischer Yen	238.249		<b>37.459.719</b>
Pfund Sterling	6.683		
Schweizer Franken	310		
US-Dollar	172.510		
	<b>512.816</b>		
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	<b>USD</b>		
Euro	86.890		
Japanischer Yen	29.485		
Pfund Sterling	92.897		
Schweizer Franken	4.283		
US-Dollar	980.226		
	<b>1.193.781</b>		

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD
<b>BNY Mellon Emerging Market Corporate Debt Fund</b>	<b>USD</b>	Dänische Krone	56.261
Australischer Dollar	1.206.506	Euro	973.745
Brasilianischer Real	99.295	Pfund Sterling	23.039
Kanadischer Dollar	127.019	Norwegische Krone	209.518
Dänische Krone	24.039	Schwedische Krone	4.744
Euro	22.505.593	Schweizer Franken	6.914
Indische Rupie	87.542	US-Dollar	887.861
Indonesische Rupiah	169.008		<b>2.162.082</b>
Lari	9.500		
Mexikanischer neuer Peso	234.593		
Norwegische Krone	90.479		
Pfund Sterling	13.721		
Russischer Rubel	159.680		
Südafrikanischer Rand	240.591		
Schwedische Krone	2.027		
Schweizer Franken	125.306		
Türkische Lira	4.371		
US-Dollar	16.585.608		
	<b>41.684.878</b>		
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>	<b>USD</b>		
Australischer Dollar	59.300		
Kanadischer Dollar	229		
Euro	2.019.336		
Pfund Sterling	121		
Norwegische Krone	62		
US-Dollar	445.670		
	<b>2.524.718</b>		
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	<b>USD</b>		
Dänische Krone	359.292		
Euro	3.746.693		
Pfund Sterling	147.125		
Norwegische Krone	1.338.014		
Schwedische Krone	30.293		
US-Dollar	3.408.445		
	<b>9.029.862</b>		

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	<b>USD</b>
Australischer Dollar	319.433	Australischer Dollar	2.646.649
Dänische Krone	306.588	Euro	37.531.712
Euro	6.869.699	Japanischer Yen	1.710.873
Pfund Sterling	236.090	Norwegische Krone	4.187
Norwegische Krone	1.142.164	Pfund Sterling	5.992.510
Schwedische Krone	25.850	Schweizer Franken	510.447
US-Dollar	5.132.087	Schwedische Krone	1.071
		US-Dollar	15.294.039
	<b>14.031.911</b>		<b>63.691.488</b>
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	<b>EUR</b>	<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>	<b>USD</b>
Australischer Dollar	969.038	Australischer Dollar	807.845
Kanadischer Dollar	4.718	Euro	25.327.234
Dänische Krone	318.499	Japanischer Yen	75.071
Euro	25.336.603	Norwegische Krone	1.331
Japanischer Yen	9.597.349	Pfund Sterling	11.018.114
Norwegische Krone	1.186.963	Schweizer Franken	412.251
Pfund Sterling	805.180	US-Dollar	5.466.355
Schwedische Krone	26.854		<b>43.108.201</b>
Schweizer Franken	25.253		
US-Dollar	3.019.393	<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>	<b>USD</b>
	<b>41.289.850</b>	Australischer Dollar	96.715
		Schweizer Franken	127.847
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>	<b>EUR</b>	Euro	3.038.239
Australischer Dollar	50.372	Pfund Sterling	1.456.887
Euro	2.230.876	Japanischer Yen	80.253
Norwegische Krone	83	US-Dollar	2.707.701
Schweizer Franken	48.682		<b>7.507.642</b>
US-Dollar	100.645		
	<b>2.430.658</b>		



## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>	<b>GBP</b>
Kanadischer Dollar	34.942	US-Dollar	169.468
Euro	338.260		<b>169.468</b>
Pfund Sterling	195.832		
US-Dollar	3.133.159		
	<b>3.702.193</b>	<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>	<b>USD</b>
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>	<b>USD</b>	Australischer Dollar	949.311
Australischer Dollar	223.565	Dänische Krone	242.390
Brasilianischer Real	57.757	Euro	83.321.368
Kanadischer Dollar	30.378	Pfund Sterling	3.963.738
Euro	8.880.065	Norwegische Krone	902.798
Indische Rupie	50.920	Schwedische Krone	20.437
Indonesische Rupiah	98.306	US-Dollar	16.016.699
Lari	5.526		<b>105.416.741</b>
Mexikanischer neuer Peso	136.455	<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fonds</b>	<b>USD</b>
Norwegische Krone	171	Australischer Dollar	104.247
Pfund Sterling	479.449	Euro	667.228
Russischer Rubel	92.880	Japanischer Yen	194.348
Südafrikanischer Rand	139.944	Pfund Sterling	24.331
Schweizer Franken	29.999	Norwegische Krone	172
Türkische Lira	2.543	Schwedische Krone	1.895
US-Dollar	14.075.176	US-Dollar	258.988
	<b>24.303.134</b>		<b>1.251.209</b>
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	<b>USD</b>	<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fonds</b>	<b>JPY</b>
Euro	7.561.415	Kanadischer Dollar	11.866.725
Japanischer Yen	169.605	Euro	180.801.508
Pfund Sterling	1.186.576	Pfund Sterling	41.131.967
Schwedische Krone	49.663	Schweizer Franken	2.083.654
Schweizer Franken	94.049	Japanischer Yen	17.411.861
US-Dollar	9.434.030	US-Dollar	257.209.726
	<b>18.495.338</b>		<b>510.505.441</b>
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	<b>EUR</b>		
Euro	24.097		
Pfund Sterling	259.409		
US-Dollar	38.846		
	<b>322.352</b>		

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
---------------	--

<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fonds</b>	<b>EUR</b>
---	------------

US-Dollar	289.724
-----------	---------

---



---

**289.724**

<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>	<b>USD</b>
--	------------

Kanadischer Dollar	104.958
--------------------	---------

Euro	16.443.259
------	------------

Pfund Sterling	5.194.160
----------------	-----------

Schweizer Franken	556.050
-------------------	---------

Japanischer Yen	71.080
-----------------	--------

US-Dollar	4.857.390
-----------	-----------

---



---

**27.226.897**

<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	<b>EUR</b>
---	------------

Brasilianischer Real	18.110
----------------------	--------

Euro	4.455.447
------	-----------

Indische Rupie	15.967
----------------	--------

Indonesische Rupiah	30.825
---------------------	--------

Japanischer Yen	1.855.356
-----------------	-----------

Georgischer Lari	1.733
------------------	-------

Mexikanischer neuer Peso	42.786
--------------------------	--------

Pfund Sterling	2.015.702
----------------	-----------

Russischer Rubel	29.123
------------------	--------

Südafrikanischer Rand	43.881
-----------------------	--------

Schwedische Krone	3.413
-------------------	-------

Schweizer Franken	222.210
-------------------	---------

Türkische Lira	798
----------------	-----

US-Dollar	4.113.730
-----------	-----------

---



---

**12.849.081**

<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	<b>USD</b>
---	------------

Euro	2.420.401
------	-----------

Japanischer Yen	37.970
-----------------	--------

Pfund Sterling	401.693
----------------	---------

Schweizer Franken	5.527
-------------------	-------

US-Dollar	14.158.651
-----------	------------

---



---

**17.024.242**

**WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.**

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Wertpapierleihgeschäften und den damit verbundenen entgegengenommenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der entliehenen Wertpapiere und bei Sachsicherheiten dem vertraglichen Fälligkeitstermin des als Sicherheit entgegengenommenen Wertpapiers.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Gesamt
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	36.889.140	-	12.075.670	-	48.964.810
Erhaltene Sachsicherheiten	-	64.856	-	41.817	604.565	12.124.312	40.578.420	53.413.970
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	465.481	465.481
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	177.831	334.985	512.816
<b>BNY Mellon Blockchain Innovation Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	1.044.909	1.044.909
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	1.193.781	-	1.193.781
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	8.999.820	-	-	7.448.664	16.448.484
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	93.822	55.702	171.994	2.853.951	14.685.671	17.861.140
<b>BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	3.079.695	-	3.079.695
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	3.153.750	-	3.153.750
<b>BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	155.871	-	155.871
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	159.505	-	159.505
<b>BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	462.638	19.619.502	-	20.082.140
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	21.303.384	-	21.303.384

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fäll- igkeit	Gesamt
<b>BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	535.159	36.112.864	-	36.648.023
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	359.821	210.785	2.148.154	34.740.959	-	37.459.719
<b>BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	39.651.491	-	39.651.491
Erhaltene Sachsicherheiten	-	142.907	372.943	613.779	4.192.982	36.362.267	-	41.684.878
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.380.707	-	2.380.707
Erhaltene Sachsicherheiten	-	36.681	8.581	22.016	184.785	2.272.655	-	2.524.718
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	8.189.363	-	8.189.363
Erhaltene Sachsicherheiten	-	5.588	-	7.084	204.666	8.812.524	-	9.029.862
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.006.090	-	2.006.090
Erhaltene Sachsicherheiten	-	875	7.821	13.994	133.242	2.006.150	-	2.162.082
<b>BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	13.035.578	-	13.035.578
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	21.087	57.520	818.822	13.134.482	-	14.031.911
<b>BNY Mellon Euroland Bond Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	39.208.171	-	39.208.171
Erhaltene Sachsicherheiten	-	119.853	19.796	221.679	2.338.806	27.314.829	11.274.887	41.289.850
<b>BNY Mellon European Credit Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.382.798	-	2.382.798
Erhaltene Sachsicherheiten	-	45	1.037	63.872	223.545	2.142.159	-	2.430.658

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fäll- igkeit	Gesamt
<b>BNY Mellon Global Bond Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	60.059.217	-	60.059.217
Erhaltene Sachsicherheiten	-	2.270	246.900	576.061	5.258.992	34.607.085	23.000.180	63.691.488
<b>BNY Mellon Global Credit Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	1.170.684	39.482.031	-	40.652.715
Erhaltene Sachsicherheiten	-	597.961	58.644	771.963	1.751.447	35.394.507	4.533.679	43.108.201
<b>BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	1.455.020	5.544.767	-	6.999.787
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	645	142.341	2.518.120	4.846.536	7.507.642
<b>BNY Mellon Global Equity Income Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	3.593.546	3.593.546
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	118.055	68.923	205.381	3.066.484	243.350	3.702.193
<b>BNY Mellon Global High Yield Bond Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	23.517.538	-	23.517.538
Erhaltene Sachsicherheiten	-	120.946	18.836	135.821	1.462.049	22.565.482	-	24.303.134
<b>BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	16.769.732	16.769.732
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	18.495.338	-	18.495.338
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	292.837	292.837
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	-	322.352	322.352
<b>BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)</b>	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Entliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	165.980	-	165.980
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	287	7.284	161.897	-	169.468

## WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fäll- ligkeit	Gesamt
<b>BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	100.866.936	-	100.866.936
Erhaltene Sachsicherheiten	-	1.159.881	37.135	305.989	6.092.443	97.821.212	81	105.416.741
<b>BNY Mellon Global Unconstrained Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1.171.333	-	1.171.333
Erhaltene Sachsicherheiten	-	93	2.608	17.152	100.791	655.663	474.902	1.251.209
<b>BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund</b>	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	465.167.861	465.167.861
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	5.969.256	-	231.288.304	273.247.881	510.505.441
<b>BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	275.321	275.321
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	8.776	20.269	260.679	-	289.724
<b>BNY Mellon Mobility Innovation Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	24.734.281	24.734.281
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	27.226.897	-	27.226.897
<b>BNY Mellon Small Cap Euroland Fund</b>	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	11.643.158	11.643.158
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	833	76.093	118.966	5.128.151	7.525.038	12.849.081
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Entlehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	15.845.066	15.845.066
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	196.462	334.603	1.101.450	10.079.429	5.312.298	17.024.242

## TRANSAKTIONEN MIT SWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS

Die nachfolgenden Tabellen enthalten ausführliche Angaben zum gesamten Bruttonominalwert von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps sowie den absoluten beizulegenden Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 31. Dezember 2021:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Gesamter Bruttonominalwert	Absoluter beizulegender Zeitwert	% des Netto- inventarwerts
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>			<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	
	Bank of America Merrill Lynch	Vereinigtes Königreich	45.930.872	2.768.095	2,24
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	30.268.935	1.517.332	1,22

## TRANSAKTIONEN MIT SWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Gesamter Bruttonominalwert	Absoluter beizulegender Zeitwert	% des Netto- inventarwerts
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Forts.</b>			<b>GBP</b>	<b>GBP</b>	
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	43.543.494	2.353.522	1,90
	Morgan Stanley	Vereinigtes Königreich	39.481.308	2.842.160	2,30
	<b>Gesamt</b>		<b>159.224.609</b>	<b>9.481.109</b>	<b>7,66</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>			<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	
	BNP Paribas	Vereinigte Staaten von Amerika	92.142.094	25.221.352	26,51
	<b>Gesamt</b>		<b>92.142.094</b>	<b>25.221.352</b>	<b>26,51</b>

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse der Währungen der vom Fonds im Rahmen von offenen Derivatgeschäften vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 31. Dezember 2021:

Fonds	Währung	Erhaltene Barsicherheiten	Gestellte Barsicherheiten
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>			
	Pfund Sterling	2.530.000	(160.000)
		<b>2.530.000</b>	<b>(160.000)</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>			
	Euro	770.000	-
		<b>770.000</b>	<b>-</b>

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps (Nettoengagement) und der in diesem Zusammenhang entgegengenommenen/gestellten Sicherheiten zum 31. Dezember 2021:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der offenen Derivate.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	11 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Gesamt
<b>BNY Mellon Absolute Return Equity Fund</b>								
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Aktienindex-Swaps	-	-	(452.714)	-	(471.425)	-	-	(924.139)
Aktien-Swaps	-	-	144.652	-	2.906.923	-	-	3.051.575
Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten	2.370.000	-	-	-	-	-	-	2.370.000
<b>BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund</b>								
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien-Swaps	-	-	-	-	(5.233.643)	-	-	(5.233.643)
Total Return Swaps	-	-	-	-	3.952.377	2.271.745	-	6.224.122
Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten	770.000	-	-	-	-	-	-	770.000

# ANHANG 3

## FINANZINDIZES (ungeprüft)

Die nachfolgende Tabelle enthält sämtliche Finanzindizes, die von den jeweiligen Anlageverwaltern der Fonds im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 zu Anlagezwecken verwendet wurden:

<b>Fonds</b>	<b>Für Anlagezwecke verwendeter Index</b>	<b>Markt</b>	<b>Website</b>
<b>BNY Mellon Absolute Return Bond Fund</b>	Markit iTraxx Europe Crossover Index	Europa	<a href="https://www.theice.com">https://www.theice.com</a>
<b>BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund</b>	Markit iTraxx Europe Crossover Index	Europa	<a href="https://www.theice.com">https://www.theice.com</a>
	Markit iTraxx Europe Index	Europa	<a href="https://www.theice.com">https://www.theice.com</a>
<b>BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund</b>	S&P 500 NR Index	U.S.A	<a href="https://www.spglobal.com">https://www.spglobal.com</a>
<b>BNY Mellon U.S. Equity Income Fund</b>	S&P 500 NR Index	U.S.A	<a href="https://www.spglobal.com">https://www.spglobal.com</a>



# ANHANG 4

## VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE-VERORDNUNG (ungeprüft)

### Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Der Anlageverwalter hat die folgenden Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (die „Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor“, „SFDR“) erfüllen:

#### **BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund**

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale umfassen die Eindämmung umweltschädlicher Praktiken (einschließlich solcher, die zum Klimawandel beitragen können, wie z. B. die Gewinnung von Teersanden und Kraftwerkskohle), die Reduzierung der Herstellung umstrittener Waffen und die Förderung verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken im Sinne der Prinzipien des UN Global Compact.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 hat der Anlageverwalter Nachhaltigkeitsindikatoren angewandt, die von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, u. a. von MSCI und Sustainalytics, um die Beurteilung, Bewertung und Überwachung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu unterstützen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds gegenüber dem Referenzwert sein Engagement in Emittenten reduziert hat, die zum Klimawandel beitragen können (z. B. Emittenten, die in der Gewinnung von Teersanden und Kraftwerkskohle aktiv sind), und der Fonds nicht in Emittenten engagiert war, die umstrittene Waffen herstellen oder als Emittenten identifiziert wurden, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen.

#### **BNY Mellon Future Earth Fund**

Die von diesem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale beinhalten das Bestreben, in Unternehmen zu investieren die Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, die dazu beitragen, den Druck auf die Umwelt und die natürlichen Ressourcen auf der Erde zu mindern.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 verwendete der Anlageverwalter Daten zu bestimmten ökologischen, sozialen und Nachhaltigkeitsindikatoren, die sowohl von Emittenten als auch von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, um die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale zu beurteilen, zu bewerten und zu überwachen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale im Wesentlichen erfüllt, da der Fonds in erheblichem Umfang in Unternehmen engagiert war, die Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, die dazu beitragen, den Druck auf die Umwelt und die natürlichen Ressourcen auf der Erde zu mindern. Zudem hatte der Fonds kein wesentliches Engagement in Emittenten, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer Perspektive für schädlich hält (z. B. Unternehmen mit wesentlichen Aktivitäten im Sektor fossile Brennstoffe), und war nicht in Unternehmen engagiert, die als Unternehmen identifiziert wurden, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen.

#### **BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)**

Die von diesen Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale umfassen Bemühungen:

a) Emittenten zu identifizieren und zu vermeiden, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer oder sozialer oder Unternehmensführungsperspektive für schädlich hält, oder die die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung nicht befolgen. Dies beinhaltet auch den Ausschluss von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält.

b) Emittenten zu identifizieren und in Emittenten zu investieren, die proaktiv versuchen, soziale und Umweltfaktoren gut zu managen, um nachhaltige Renditen zu erzielen.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 verwendete der Anlageverwalter Daten zu bestimmten ökologischen, sozialen und Nachhaltigkeitsindikatoren, die sowohl von Emittenten als auch von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu beurteilen, zu bewerten und zu überwachen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds nicht in Emittenten engagiert war, von denen bekannt ist, dass sie gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, oder in Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen tätig sind, und kein wesentliches Engagement in Emittenten hatte, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer, sozialer oder Unternehmensführungsperspektive für schädlich hält (z. B. Unternehmen mit wesentlichen Aktivitäten im Sektor fossile Brennstoffe).

**Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund**

Zu den von diesem Fonds beworbenen Merkmalen kann eine positive Allokation in Emittenten mit stärkeren (besseren) Ratings für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (Environmental, Social and Governance, „ESG“) gehören, wobei Emittenten mit schwächeren (schlechteren) ESG-Ratings ausgeschlossen werden können. Zu den weiteren Merkmalen, die von diesem Fonds beworben werden, kann der Ausschluss von Engagements in Emittenten mit Geschäftseinkünften oder betrieblichen Aktivitäten gehören, die nach Ansicht des Anlageverwalters überhöhte ökologische, soziale oder reputationsbezogene Nachhaltigkeitsrisiken aufweisen.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 bediente sich der Anlageverwalter einer Kombination aus externen und/oder internen Analysen mit Schwerpunkt auf Nachhaltigkeit sowie „Bottom-up“-Kreditanalysen und Einschätzungen zum relativen Wert, um die von dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale vor der Anlage und fortlaufend zu bewerten, zu messen und zu überwachen. Anhand dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds sein Engagement in Unternehmen erhöhte, die nach der internen ESG-Rating-Methode des Anlageverwalters gut abschnitten, wodurch ein besseres durchschnittliches ESG-Rating erzielt wurde als das seines Referenzwerts, des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index. Ferner hielt der Fonds Instrumente und Emittenten mit positiven Auswirkungen, darunter grüne und soziale Anleihen, erreichte ein niedrigeres CO<sub>2</sub>-Intensitätsrating als der Referenzwert und war nicht in Emittenten engagiert, die nachweislich gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen oder an der Herstellung umstrittener Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) beteiligt sind.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 9 der SFDR erfüllen:

**Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund**

Das nachhaltige Anlageziel dieses Fonds besteht darin, eine Gesamtrendite aus Ertrags- und Kapitalwachstum zu erzielen, indem er überwiegend in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldttitelbezogenen Wertpapieren und damit verbundenen FDI investiert, wobei die Erlöse ausschließlich für die teilweise oder vollständige Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen verwendet werden.

Dieser Fonds war am 31. Dezember 2021 noch nicht aufgelegt. Deshalb ist es nicht möglich, einen Vergleich der Gesamtnachhaltigkeitswirkung des Fonds mit den Auswirkungen seines Referenzwerts, des Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Green Bond Index, und eines breiten Marktindex anhand von Nachhaltigkeitsindikatoren vorzulegen.

Außer den oben aufgeführten Fonds verfolgen die Fonds der Gesellschaft kein Ziel oder keine Verpflichtung, in Unternehmen zu investieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben oder als nachhaltige Anlagen qualifiziert sind und daher die Bestimmungen von Artikel 6 der SFDR erfüllen.

**EU-Taxonomie-Verordnung****BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR), Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund**

Der Anlageverwalter hat diese Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 6 der EU-Taxonomie-Verordnung erfüllen.

Die technischen Bewertungskriterien („TSC“) der EU-Taxonomie-Verordnung werden die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte zu jeder Anlage erfordern. Zum 31. Dezember 2021 waren keine ausreichenden verlässlichen, aktuellen und überprüfbareren Daten verfügbar, die es dem Anlageverwalter ermöglicht hätten, die Anlagen dieser Fonds mittels der TSC zu bewerten.

Obwohl es in diesen Fonds Anlagen in Wirtschaftstätigkeiten gab, die zu einem Umweltziel beitragen und für eine Bewertung nach den TSC in Frage kommen können, kann die Verwaltungsgesellschaft derzeit noch keine Angaben zu Folgendem machen:

- a) Das Ausmaß, in dem die Anlagen dieser Fonds in ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten geflossen sind;
- b) Der prozentuale Anteil der Anlagen in ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten am Portfolio dieser Fonds; oder
- c) der prozentuale Anteil des Portfolios dieser Fonds an ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung sowie an Übergangstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung.

**Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund**

Der Anlageverwalter hat den Fonds als Fonds kategorisiert, welcher die Bestimmungen in Artikel 5 der EU-Taxonomie-Verordnung erfüllt.

Die TSC der EU-Taxonomie-Verordnung werden die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte zu jeder Anlage erfordern. Zum 31. Dezember 2021 waren keine ausreichenden verlässlichen, aktuellen und überprüfbaren Daten verfügbar, die es der Verwaltungsgesellschaft ermöglicht hätten, die Anlagen des Fonds mittels der TSC zu bewerten.

Obwohl es im Fonds Anlagen in Wirtschaftstätigkeiten gab, die zu einem Umweltziel beitragen und für eine Bewertung nach den TSC in Frage kommen können, kann die Verwaltungsgesellschaft derzeit noch keine Angaben zu Folgendem machen:

- a) das Ausmaß, in dem die Anlagen des Teilfonds in ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten erfolgten;
- b) der prozentuale Anteil der Investitionen in ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten am Portfolio des Teilfonds; oder
- c) der prozentuale Anteil des Portfolios des Teilfonds an ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung sowie an Übergangstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung.

Abgesehen von den vorstehend aufgeführten Fonds berücksichtigen die den Fonds der Gesellschaft zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

# VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN

## EINGETRAGENER SITZ

One Dockland Central, Guild Street  
IFSC, Dublin 1, D01E4XO  
Irland

## DIE MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind:

David Dillon (Ire)\*^  
Gerald Rehn (US-Amerikaner)  
Greg Brisk (Brite)  
Claire Cawley (Irin)^

Alle vorstehend aufgeführten Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

\* Vorsitzender des Verwaltungsrats

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

## VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.  
2-4 Rue Eugène Ruppert  
L-2453  
Luxemburg

## ANLAGEVERWALTER, UNTERANLAGEVERWALTER UND DELEGIERTE ANLAGEVERWALTER

Mellon Investments Corporation\*  
BNY Mellon Center  
One Boston Place  
201 Washington Street  
Boston, MA 02108-4408  
Vereinigte Staaten von Amerika

Newton Investment Management Limited  
BNY Mellon Centre  
160 Queen Victoria Street  
London EC4V 4LA  
Vereinigtes Königreich

Walter Scott & Partners Limited  
One Charlotte Square  
Edinburgh EH2 4DR  
Schottland  
Vereinigtes Königreich

ARX Investimentos Ltda  
Avenida Borges de Medeiros, 633,  
4th floor, Leblon  
Rio de Janeiro, R.J. 22430-041  
Brasilien

BNY Mellon Asset Management Japan Limited  
Maranouchi Trust Tower Main  
1-8-3 Maranouchi  
Chiyoda – ku  
Toyko 100-0005  
Japan

Insight Investment Management (Global) Limited\*  
BNY Mellon Centre  
160 Queen Victoria Street  
London EC4V 4LA  
Vereinigtes Königreich

Alcentra NY, LLC  
200 Park Avenue  
New York  
10166 NY  
Vereinigte Staaten von Amerika

Insight North America LLC\*  
200 Park Avenue  
New York  
10166 NY  
Vereinigte Staaten von Amerika

Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD.  
9 Temasek Boulevard  
13-01 Suntec Tower Two  
Singapore 038989  
Singapur

Alcentra Limited  
160 Quesen Victoria Street  
London EC4V 4LA  
Vereinigtes Königreich

Newton Investment Management North America LLC\*  
One Boston Place  
201 Washington Street  
Boston MA 02108

## ADMINISTRATOR, REGISTERFÜHRER UND ÜBERTRAGUNGSAGENT

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company  
One Dockland Central, Guild Street  
IFSC, Dublin 1, D01E4XO  
Irland

## GESELLSCHAFTSSEKRETÄR

Tudor Trust Limited  
33 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2, D02 XK09  
Irland

## RECHTSBERATER DER GESELLSCHAFT

Dillon Eustace  
33 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2, D02 XK09  
Irland

## UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

Ernst & Young  
Chartered Accountants & Registered Auditors  
Harcourt Centre  
Harcourt Street  
Dublin 2, D02 YA40  
Irland

## VERWAHRSTELLE

The Bank of New York Mellon SA/NV  
Niederlassung Dublin  
Riverside 2, Sir John Rogerson's Quay  
Grand Canal Dock, Dublin 2  
D02 KV60, Irland

**VERTRIEBSGESELLSCHAFT (OHNE DEN EWR)**

BNY Mellon Investment Management EMEA Limited  
BNY Mellon Centre  
160 Queen Victoria Street  
London EC4V 4LA  
Vereinigtes Königreich

**VERTRIEBSGESELLSCHAFT (INNERHALB DES EWR)**

BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.  
2-4 Rue Eugène Ruppert  
L-2453  
Luxemburg

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

# WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)

## **BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER\***

S&P 500® ist eine Marke von The McGraw-Hill Companies, Inc. und wurde für die Verwendung durch BNY Mellon Global Funds, plc lizenziert. Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wird nicht von Standard & Poor's gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben, und Standard & Poor's übernimmt keine Gewährleistungen hinsichtlich der Ratsamkeit von Anlagen in den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker.

\* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Bitte beachten Sie Folgendes: Wenn ein Fonds der Gesellschaft in die Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen investiert, die direkt oder per Delegation von der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft, BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. („BNY MFM Lux“), oder von einer anderen Gesellschaft, mit der BNY MFM Lux durch eine gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder durch eine direkte oder indirekte Beteiligung von mehr als 10 % des Anteilskapitals oder der Stimmen verbunden ist, berechnet BNY MFM Lux oder die andere Gesellschaft keine Management-, Zeichnungs-, Umtausch- oder Rücknahmegebühren in Bezug auf die Anlage des Fonds in die Anteile dieses anderen Organismus für gemeinsame Anlagen.



