



Geprüfter Jahresbericht und -abschluss

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. DEZEMBER 2023



HINWEIS: Bitte beachten Sie, dass für die weiteren Teilfonds BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund, BNY Mellon Dynamic Total Return Fund, BNY Mellon US Opportunities Fund, BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund, BNY Mellon S&P 500® Index Tracker, BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund, BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund, BNY Mellon U.S. Credit Select Income Fund, BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund, BNY Mellon Pan European Equity Fund, BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund, BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund, BNY Mellon Asia Rising Stars Fund, BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Food Innovation Fund, BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund, BNY Mellon Future Life Fund und BNY Mellon Absolute Return Equity Fund keine Anzeige gemäß § 310 KAGB erstattet worden ist und Anteile dieser Teilfonds an Anleger im Geltungsbereich des Kapitalanlagegesetzbuches nicht vertrieben werden dürfen.



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
AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERBESTÄNDE	29
GESAMTERGEBNISRECHNUNG	294
BILANZ	315
VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS, DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN, PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST	335
ERLÄUTERUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS	345
BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT)	613
VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN	668
WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)	670
ANLAGE 1: OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (UNGEPRÜFT)	671
ANLAGE 2: ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (UNGEPRÜFT)	673
ANLAGE 3: VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE- VERORDNUNG (UNGEPRÜFT)	691

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 2023 50 aktive Fonds (31. Dezember 2022: 51).

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 Credit Fund*	Insight Investment Management (Global) Limited	11. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund ⁽¹⁾	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 Asian Income Fund	Newton Investment Management Limited	9. Mai 2014
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	Newton Investment Management Limited*	10. Dezember 2001
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	Newton Investment Management North America	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 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 Hard 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 Fund*	Insight Investment Management (Global) Limited	26. Juni 2023
BNY Mellon Food Innovation Fund ^{(2)*}	Newton Investment Management Limited	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Earth Fund ⁽³⁾	Newton Investment Management Limited	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Life Fund ⁽⁴⁾	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 Opportunities Fund	Newton Investment Management Limited*	13. November 2012
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	Auflegungs- datum
BNY Mellon Global Leaders Fund	Walter Scott & Partners Limited	7. Dezember 2016
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund ⁽⁵⁾	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	Newton Investment Management Japan Ltd*	12. Dezember 2013
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	Walter Scott & Partners Limited	17. Juli 2023
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 Pan European Equity Fund ⁽⁶⁾	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker ⁽⁷⁾	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 ⁽⁸⁾	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 Emerging Markets Fund	Newton Investment Management Limited	23. September 2022
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
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 ⁽⁹⁾	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 EM Debt Impact Fund*	Insight Investment Management (Global) Limited	24. Januar 2023
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

⁽¹⁾ Dieser Fonds wurde am 9. Oktober 2023 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁽²⁾ Dieser Fonds wurde am 10. November 2023 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁽³⁾ Dieser Fonds wurde am 10. November 2023 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁽⁴⁾ Dieser Fonds wurde am 10. November 2023 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁽⁵⁾ 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.

⁽⁶⁾ 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.

⁽⁷⁾ 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.

⁽⁸⁾ Dieser Fonds wurde am 8. Dezember 2023 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁽⁹⁾ 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.

SONSTIGE WICHTIGE ANGABEN

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

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.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 31. Dezember 2023 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 darf der Verwaltungsrat den Jahresabschluss nicht genehmigen, sofern er nicht davon überzeugt ist, dass dieser 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 auch sonst 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 zu 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, D01E4X0, 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 Jahresabschluss der Gesellschaft wird auf der Website von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (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 die 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.

ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

Durch ihre Anlagentätigkeit ist die Gesellschaft verschiedenen Arten von Risiken ausgesetzt, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten verbunden sind, in die 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 die Verwaltungsratsmitglieder zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 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.

Anteilsinhaber 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 Anteilsinhaber 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. Außerdem werden die Anteilsinhaber auf die Bestimmungen des Prospekts verwiesen, die sich mit Interessenkonflikten befassen.

Daher ist der Verwaltungsrat der Gesellschaft unter Berücksichtigung der Bestätigungen seitens der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. und ihrer jeweiligen 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. Anteilshaber 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 und
- (iii) den OGAW-Vorschriften der Zentralbank.

Exemplare aller oben genannten Dokumente liegen am eingetragenen Sitz der Gesellschaft in One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, D01E4XO, 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) eingesehen werden kann und 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, die für die laufende Verwaltung der Gesellschaft und die 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 Anteilshaber 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 Anteilshaber, die mindestens ein Zehntel des eingezahlten Anteilskapitals der Gesellschaft repräsentieren, den Verwaltungsrat zur Einberufung einer Versammlung der Anteilshaber 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 Anteilshaber erfolgen.

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

Die Anteilshaber können beschließen, einen ordentlichen Beschluss oder einen Sonderbeschluss auf einer Anteilshaberversammlung zu genehmigen. Ein ordentlicher Beschluss der Gesellschaft oder der Anteilshaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten Klasse erfordert die absolute Mehrheit der abgegebenen Stimmen der Anteilshaber, 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 Anteilshaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten Anteilsklasse, unter anderem einen Beschluss zur Änderung der Gründungsurkunde und der Satzung, ist eine Mehrheit von mindestens 75 % der persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter auf der Hauptversammlung anwesenden und abstimmenden Anteilshaber 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 sieben 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 Stimmengleichheit 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.

Das Application Approval Committee für Teilfonds (der „Ausschuss“) wurde vom Verwaltungsrat der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft eingerichtet. Er dient hauptsächlich der Unterstützung der jeweiligen Verwaltungsräte bei der Erfüllung ihrer Aufsichtspflichten in Bezug auf die Einreichung von Anträgen neuer Teilfonds oder im Fall speziell delegierter Änderungen in bestehenden Teilfonds oder in der Fondsdokumentation (die z. B. durch regulatorische Aktualisierungen oder wesentliche Änderungen erforderlich sind) bei der Zentralbank.

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 fünf Bestellungen in den und zwei Rücktritte aus dem Verwaltungsrat.

DER VERWALTUNGSRAT

Es folgt eine Liste mit den Namen der Personen, die während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 Mitglieder des Verwaltungsrats waren:

David Dillon (Ire)^*

Gerald Rehn (US-Amerikaner) (zurückgetreten am 8. Februar 2023)

Greg Brisk (Brite)

Claire Cawley (Irin)^<^*

Caylie Stallard (Neuseeländerin)

Mark Flaherty (Ire)

Sarah Cox (Britin) (bestellt am 9. Februar 2023)

Sandeep Sumal (Brite) (bestellt am 30. August 2023)

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

< Vorsitzender des Verwaltungsrats

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

* Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES GESELLSCHAFTSSEKRETÄRS

Die Verwaltungsratsmitglieder (einschließlich ihrer Angehörigen) und der Gesellschaftssekretär Tudor Trust Limited hielten während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine Beteiligungen an der Gesellschaft.

POLITISCHE SPENDEN

In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 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 zum 2. September 2014 zu den Abschlussprüfern der Gesellschaft ernannt und ihrer Wiederbestellung entsprechend zugestimmt.

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: 23. April 2024

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE

für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (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 Prüfvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilsinhaber der Gesellschaft gemäß unserer Rolle als Verwahrstelle der Gesellschaft und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit der Erteilung dieses Prüfvermerks 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 nach eigenem Ermessen für angemessen hält, um pflichtgemäß sicherzustellen, dass die Gesellschaft in jeder wesentlichen Hinsicht (i) in Übereinstimmung mit den in der Gründungsurkunde und Satzung und den betreffenden Vorschriften verankerten Anlage- und Kreditaufnahmebeschränkungen und (ii) darüber hinaus in Übereinstimmung mit der Gründungsurkunde und Satzung sowie den betreffenden Vorschriften geführt wurde.

BESTÄTIGUNGSVERMERK

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 Gründungsurkunde und Satzung 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: 23. April 2024

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

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

BESTÄTIGUNGSVERMERK

Wir haben den Jahresabschluss der BNY Mellon Global Funds, plc („die Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum Samstag, 31. Dezember 2023 geprüft. Dieser umfasst die Bilanz, die Gesamtergebnisrechnung, die Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern von einlösbaren, 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 Finanzberichterstattungsstandard, 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 2023 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 BESTÄTIGUNGSVERMERK

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 Bestätigungsvermerks.

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 Bestätigungsvermerk 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 in Section 305 bis 312 des Act vorgeschriebenen Angaben zu der Vergütung und zu Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht erteilt hat.

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

JEWEIFIGE 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 Bestätigungsvermerk 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 unter: 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 Bestätigungsvermerke 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: 24. April 2024

BERICHTE DER ANLAGEVERWALTER

KONJUNKTUR- & MARKTÜBERBLICK

Einleitung

Die globalen Aktienmärkte (einschließlich des Vereinigten Königreichs, Europas und der USA) verzeichneten positive Renditen in den zwölf Monaten, auf die sich der Jahresbericht und der Abschluss beziehen.

Die verbreitete Besorgnis über die hohe Inflation und die hohen Zinssätze ließ im Laufe des Herbstes nach. Zum Jahresende keimte dann die Hoffnung auf Zinssenkungen auf. In vielen Ländern stiegen die BIP-Zahlen (der gesamte Mehrwert aller Waren und Dienstleistungen in einer Volkswirtschaft). Infolgedessen kamen von den Unternehmen erste ermutigendere Gewinnmeldungen.

Die Industrieländer schnitten besser ab als die Schwellenländer. Festverzinsliche Wertpapiere (Unternehmens- und Staatsanleihen) hatten die meiste Zeit des Jahres über zu kämpfen. Im November setzte ein Aufwärtstrend bei den Kursen ein – und ein entsprechender Abwärtstrend bei den Renditen (den Erträgen aus einer Anlage). Staatsanleihen erzielten letztlich eine positive Rendite für das Jahr, blieben aber hinter den Ergebnissen von Unternehmensanleihen zurück.

Ungeachtet des Endergebnisses verzeichneten Aktien im Berichtszeitraum eine Berg- und Talfahrt. Sie wurden im Februar und März von einer Mini-Bankenkrise erschüttert (drei regionale US-Banken gingen in Konkurs und die Credit Suisse brach zusammen). Im Oktober kam es zum Konflikt im Nahen Osten und der Krieg in der Ukraine ging weiter. Abseits der politischen Landschaft wuchs bei den Anlegern zudem die Besorgnis, dass die Zinsen auf einem erhöhten Niveau bleiben müssten, um die nach wie vor hohe Inflation zu bekämpfen.

Die US-Notenbank (Fed), die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of England (BoE) hoben die Zinssätze in der ersten Hälfte des Jahres 2023 wiederholt an. Doch als der Herbst nahte, ging die Inflation in den großen Volkswirtschaften weiter zurück, da die Energiepreise sanken. Die Zentralbanken beendeten die Zinserhöhungen. Zentralbanken in Ländern wie China, Brasilien und Chile gingen zu Zinssenkungen über und setzten die Zinsen in der zweiten Hälfte des Jahres 2023 gleich mehrmals herab.

In bestimmten Regionen bestand jedoch weiterhin die Gefahr einer Rezession. Die Wirtschaftsdaten fielen in den USA und Indien vielversprechend aus, in Europa und im Vereinigten Königreich dagegen eher schwach. Das Wirtschaftswachstum in Japan und China schwankte, enttäuschte die Anleger aber im Durchschnitt. In den USA, aber auch in Indien blieb das Wachstum jedoch robust.

Am Ende des Berichtszeitraums herrschte auf breiter Front die Überzeugung vor, dass die Zentralbanken in den Industrieländern im Jahr 2024 Zinssenkungen einleiten würden. Das war für die Anleger eine willkommene Entwicklung. Deren positive Stimmung schlug sich mit Blick auf das neue Jahr in höheren Kursen für Anleihen und Aktien nieder.

Nordamerika

Der US-Markt entwickelte sich stark und überrundete andere globale Aktienmärkte.

Globale Technologiewerte wie Apple und Amazon trieben die Indizes S&P 500 und Nasdaq nach oben.

Die Inflation ging weiter kontinuierlich zurück und sank von 6,4 % im Januar auf 3,4 % im Dezember, da die Energiepreise nachgaben.

Die Fed hob die Leitzinsen im Berichtszeitraum viermal an. Diese stiegen dadurch von 4,5 % auf 5,5 % (der höchste Stand seit 22 Jahren). Im Dezember deuteten die geldpolitischen Entscheidungsträger der Fed an, dass sie für 2024 mit Zinssenkungen rechneten (stellten allerdings auch fest, dass der Kampf gegen die Inflation noch nicht gewonnen sei).

Das BIP-Wachstum war weiterhin robust und die Arbeitslosenzahlen blieben im Berichtszeitraum niedrig.

Europa

Europas Märkte legten im Berichtszeitraum zu. Dessen ungeachtet verunsicherten das schwächere BIP-Wachstum und die erheblichen geopolitischen Sorgen die Anleger. Der britische Aktienmarkt tendierte ebenfalls stärker, konnte aber nicht mit den kontinentaleuropäischen Märkten Schritt halten.

In der Eurozone und im Vereinigten Königreich ging die Inflation weiter zurück. In der Eurozone lag sie im Dezember bei 2,9 %. Im Vereinigten Königreich hielt sich die Inflation auf einem höheren Niveau, doch lag sie im Dezember bei 4,0 %.

Die EZB hob die Zinssätze sechsmal an, bis sie schließlich die Marke von 4,5 % erreichten. Im Vereinigten Königreich setzte die BoE die Zinssätze von 3,5 % auf 5,25 % herauf, beließ sie aber auf ihren letzten beiden Sitzungen des Jahres unverändert. Obwohl die EZB ebenso wie die BoE offiziell erklärten, dass es noch zu früh sei, um über Zinssenkungen zu sprechen, erwarten die Anleger, dass die Leitzinsen im Jahr 2024 sinken werden.

Das Wirtschaftswachstum fiel in ganz Europa schwach aus. Das BIP der Eurozone ging im dritten Quartal zurück. Die britische Wirtschaft stagnierte im zweiten Quartal mit 0 % Wachstum und schrumpfte im dritten Quartal um 0,1 %. Die Anleger zeigten sich weiterhin besorgt, dass beide Volkswirtschaften 2024 in die Rezession abgleiten könnten.

Asien

Nach einer schwachen ersten Jahreshälfte legten die asiatischen Märkte im zweiten Halbjahr zu. China war der schwächste Markt, und das langsame Wirtschaftswachstum enttäuschte die Anleger.

Japans Aktienmarkt entwickelte sich gut und schnitt besser ab als andere asiatische Märkte. Der Nikkei Index des Landes erreichte Anfang Juli den höchsten Stand seit 33 Jahren, da die Anleger allmählich glaubten, das Land könne der Deflation endlich entkommen. Dank der Technologiewerte schnitten Südkorea und Taiwan ebenfalls gut ab.

Die meisten asiatischen Zentralbanken beließen ihre Zinssätze unverändert. Der Grund war die allgemein verbesserte Inflationslage. In China senkte die Zentralbank die Leitzinsen und den Mindestreservesatz (der Barmittelbestand, den die Geschäftsbanken vorhalten müssen) geringfügig. Die Inflation ging in den meisten Ländern zurück.

Das BIP-Wachstum war uneinheitlich. In China stieg das BIP im zweiten Quartal um 6,3 % im Vergleich zum Vorjahr, verlangsamte sich dann allerdings im dritten Quartal auf 4,9 %. In Indien blieb die Wirtschaft robust. Sie wuchs im zweiten und dritten Quartal 2023 mit einer Jahresrate von über 7 %. Die Wirtschaft Japans wuchs im zweiten Quartal auf Jahresbasis um 3,6 %, schrumpfte dann aber im dritten Quartal um 2,9 %. Dies war das schwächste Wachstum des Landes seit über drei Jahren.

Festverzinsliche

An den Märkten für Staatsanleihen sanken die Kurse in Pfund Sterling, da die Anleihenrenditen stiegen. In US-Dollar verringerten sich die Renditen allerdings, und die Kurse stiegen. Gegen Ende des Jahres nahmen die Erwartungen zu, dass die großen Zentralbanken – in den USA, im Vereinigten Königreich und in Europa – die Zinssätze im Jahr 2024 senken würden.

Die Schuldtitel von Unternehmen, ergo Unternehmensanleihen, schnitten besser ab als die von Ländern emittierten Schuldpapiere.

Die Anleihenmärkte erlebten in den letzten beiden Monaten des Jahres eine deutliche Rally, und zwar eine der stärksten seit Jahrzehnten, als die Erwartung sinkender Zinsen in den Markt eingepreist wurde.

Währungen und Rohstoffe

Der US-Dollar war das ganze Jahr über volatil, blieb aber gegenüber dem Euro und dem Pfund Sterling weitgehend unverändert. Die Erwartung, die Fed würde die Zinsen 2024 senken, ließ den Dollar gegen Jahresende schwächer werden.

Das Pfund Sterling legte gegenüber dem US-Dollar und dem Euro zu.

Der japanische Yen zeigte gegenüber dem US-Dollar Schwäche, wertete aber gegen Ende des Jahres deutlich auf.

Die Ölpreise gaben nach, und Rohöl der Sorte West Texas Intermediate fiel von ca. 80 USD pro Barrel zu Beginn des Jahres auf knapp über 70 USD zum Jahresende.

Der Kupferpreis ging aufgrund der Besorgnis der Anleger über die schwache chinesische Wirtschaft zurück, denn das Metall wird in China üblicherweise stark nachgefragt. Die Preise für Aluminium und Zink waren ebenfalls rückläufig,

während der Goldpreis im Dezember auf ein neues Allzeithoch kletterte.

Alle Daten zur Wertentwicklung beziehen sich, soweit nicht anders angegeben, auf die Gesamtrenditen in Landeswährungen vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023. Quelle: Lipper Hindsight und Bloomberg.

ALTERNATIVE ANLAGEN**BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND**

Die Anteilsklasse Euro S des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 7,11 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 3,47 % für den Referenzwert, den 3-Monats-EURIBOR, jeweils in Euro.

Die Verwaltung der Fondsinvestitionen in Anleihen, sowohl Emissionen von Staaten als auch von Unternehmen, trug besonders zur Erzielung dieser Rendite bei. Die Verwaltungsgesellschaft passte die Beteiligungen des Fonds entsprechend den Marktbewegungen an.

In der ersten Hälfte des Jahres 2023 waren die Anleger sehr besorgt über die anhaltend hohe Inflation, die für die Unbeständigkeit der Anleihenmärkte verantwortlich war. Der Fokus der Verwaltungsgesellschaft auf der Länderauswahl (wobei Schwellenländer oft favorisiert wurden) half dem Fonds, eine schwierige Zeit zu überstehen, und trug zur positiven Rendite bei.

Im dritten Quartal 2023 mieden die Anleger risikoreichere Anlagen in der Erwartung, dass die Zentralbanken weitere Zinserhöhungen vornehmen könnten. In diesem Zeitraum zahlte sich die Auswahl der Staatsanleihen durch die Verwaltungsgesellschaft aus.

Später, als die Inflationsraten in den Sinkflug übergingen, erwachte unter den Anlegern die Erwartung, dass die Zinsen 2024 gesenkt werden könnten. Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte im Oktober die Gewichtung von US-Staatsanleihen im Fonds. Dies war den Erträgen des Fonds förderlich, da die Märkte für Staatsanleihen im November und Dezember eine starke Erholung erlebten.

Die Auswahl der Unternehmensanleihen durch die Verwaltungsgesellschaft trug ebenfalls zu den Erträgen bei. Einen besonders starken Wertbeitrag leisteten die Anlagen in Hochzinsanleihen, da sich die Anleger mit Investitionen in Risikoanlagen allmählich wieder wohler fühlten.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN CREDIT FUND*

In der kurzen Zeit seit der Auflegung des Fonds am 11. Dezember 2023 bis zum 31. Dezember 2023 erzielte die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds eine Rendite von 0,36 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 0,21 % für den Referenzwert, den 3-Monats-EURIBOR.

Die Verwaltungsgesellschaft interessiert sich für Vermögenswerte, mit denen die an den Anleihenmärkten erzielbaren Gewinne abgeschöpft werden können, während der Fonds gleichzeitig vor unnötigen Risiken bewahrt werden soll.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Fonds am 9. Oktober 2023 erzielte die Anteilsklasse Sterling R (Acc.) des Fonds eine Rendite von 0,52 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 3,27 % für den Referenzwert, SONIA (30 Tage aufgezinste), jeweils in Pfund Sterling.

Mehrere europäische Aktien des Fonds schwächelten, was wiederum die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums beeinträchtigte. Dazu gehörten Aktien eines deutschen Industriekonzerns, einer Schweizer Versicherungsgesellschaft, einer Vermögensverwaltungsgesellschaft, eines belgischen Automobilimporteurs und eines deutschen Mischkonzerns.

ALTERNATIVE ANLAGEN Forts.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND Forts.

Die Beteiligung des Fonds an einem britischen Energieunternehmen leistete einen wichtigen Wertbeitrag, als das Unternehmen im Sommer seine Gewinn- und Cashflow-Ziele nach oben korrigierte. Die Verwaltungsgesellschaft verkaufte die Aktie im Anschluss an eine Phase mit kräftigen Kursgewinnen.

Andere Aktien, die sich 2023 positiv auf die Rendite auswirkten, waren ein deutsches Werkstoffunternehmen, ein europäischer Getränkekonzern, eine britische Finanzgruppe und ein britisches Produktionsunternehmen.

Vor dem Hintergrund der zunehmenden Besorgnis über die hartnäckig hohe Inflation und die unsicheren Konjunkturaussichten hat die Verwaltungsgesellschaft einige Beteiligungen an Unternehmen erworben, deren Erträge tendenziell weniger empfindlich auf den Konjunkturzyklus reagieren.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Die Anteilsklasse Euro U (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -0,41 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 3,29 % für den Referenzwert, der 1-Monats-EURIBOR, jeweils in Euro.

Die von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählten Wandelanleihen brachten 2023 leichte Verluste.

In der ersten Jahreshälfte sorgten sich die Anleger über die penetrant hohe Inflation, die für die Unbeständigkeit der Anleihenmärkte verantwortlich war. Einige der Anleihenbestände des Fonds verloren in diesem Zeitraum an Boden, u. a. Anleihen von Bau-, Reise- und Technologieunternehmen.

Auch etliche Fondspositionen in den Sektoren Versorger und Basiskonsumgüter zeigten Schwäche. Diese Sektoren können sich in Abschwungphasen tendenziell gut behaupten, in einem steigenden Markt aber zurückbleiben.

Im dritten Quartal des Jahres mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aus Angst vor weiteren potenziellen Zinserhöhungen durch die Zentralbanken. In diesem Berichtszeitraum gerieten die Beteiligungen des Fonds in Sektoren wie Autos und Medien in Rückstand. Diese Sektoren entwickeln sich oft dann gut, wenn die Konjunkturaussichten besser sind.

Später, als die Inflation den Rückzug antrat, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung auf Zinssenkungen. Die Verwaltungsgesellschaft identifizierte mehrere Anlagegelegenheiten unter den neu emittierten Wandelanleihen. Die Verwaltungsgesellschaft stockte zudem die Fondsbestände in Nordamerika auf. Dies hat sich ausgezahlt, da die Anleihenmärkte zum Jahresende stiegen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 11,27 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 5,26 % für den FTSE 3 Month US T Bill Index.

Positionen in Währungen und Staatsanleihen aus Schwellenländern waren im Verlauf des Jahres die Hauptfaktoren für die gute Wertentwicklung des Fonds. Bei den Schwellenländerwährungen resultierten die Positionen im mexikanischen Peso und im ungarischen Forint in den besten Ergebnisse. Beide Währungen werteten im Jahr 2023 stark auf.

Sowohl in Mexiko als auch in Ungarn lagen die Zinssätze Ende des Jahres bei über 10 % und damit deutlich höher als in den USA, im Vereinigten Königreich und in der Eurozone. Dies bedeutete, dass diese Währungen ein starkes „Carry“ boten (die Möglichkeit, von den Unterschieden zwischen zwei Zinssätzen zu profitieren).

Unter den Staatsanleihen entwickelte sich eine Long-Position in japanischen zehnjährigen Anleihen mit stark. In Japan blieben die Zinsen am kurzen Ende negativ. Dies bedeutete, dass Anleihen mit längeren Laufzeiten ein attraktives Carry boten.

Short-Positionen bei Staatsanleihen aus Industrieländern erzielten ebenfalls gute Ergebnisse. Darunter befanden sich einige fünfjährige US-Staatsanleihen und zehnjährige kanadische Staatsanleihen.

Die größten Negativbeiträge leisteten Währungsengagements in Industrieländern. Hier waren es eine Long-Position im US-Dollar und eine Short-Position im Schweizer Franken, die den Fonds am meisten kosteten.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2024

AKTIEN

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Inc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 11,71 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 8,40 % für den FTSE Asia Pacific ex Japan TR Index.

Die Entscheidungen der Verwaltungsgesellschaft, in welche Sektoren und Länder sie investiert, wirkten sich besonders positiv auf die Fondsrenditen aus. Die Tatsache, dass der Fonds stärker als der Index in Informationstechnologie investiert ist und sich nur minimal in China engagiert, hat die Renditen beflügelt.

Die Auswahl der Einzeltitel, in die die Verwaltungsgesellschaft investiert hat, erwies sich als positiv, insbesondere im Basiskonsumgütersektor und in Taiwan. Die besten Aktienwerte im Fonds waren taiwanische Technologieunternehmen, die im Jahresverlauf ein starkes Gewinnwachstum berichteten.

Der Verzicht auf bestimmte chinesische Software-, Spiele- und E-Commerce-Aktien war für die Rendite des Fonds ebenfalls von Vorteil. Diese Aktien schütteten nicht die für den Fonds erforderliche Mindestdividende aus.

Die Aktien des Fonds aus Hongkong, insbesondere im Immobiliensektor, brachten keine Unterstützung. Dass der Fonds in Indien nicht so stark investiert war wie der Referenzwert, wirkte sich ebenfalls negativ auf die Rendite aus.

Auch die Beteiligungen des Fonds an großen Versicherungsgesellschaften mit umfangreichen Geschäften in China blieben hinter den Erwartungen zurück.

Die Verwaltungsgesellschaft stockte ihre Beteiligungen in den Sektoren Technologie und Telekommunikation auf. Die Verwaltungsgesellschaft verkaufte einige Finanz- und Technologietitel, deren Kurse stark gestiegen waren, um die Gewinne mitzunehmen.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON ASIAN OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 0,12 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 7,69 % im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index TR.

Die Aktienwerte, in die die Verwaltungsgesellschaft investierte, belasteten die Erträge. Aktien von Unternehmen mit Sitz in China sowie aus den Sektoren Informationstechnologie (IT) und Basiskonsumgüter beeinträchtigten die Erträge.

Ein Blick auf die Aktienwerte zeigt, dass die Kurse mehrerer chinesischer Unternehmen aus den Bereichen Gesundheit, Lebensmittelproduktion und Lebensmitteleinzelhandel, in denen der Fonds investiert ist, gefallen sind. Das Engagement in asiatischen Versicherungsgesellschaften, insbesondere in solchen, die einen großen Teil ihrer Geschäfte in China abwickeln, wirkte sich ebenfalls negativ aus. Auch Aktien aus dem Bereich der Solarzellenproduktion tendierten schwächer.

Ein positiver Aspekt ist, dass die Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft, mehr Aktien aus dem IT-Sektor zu halten als der Index, dem Fonds zu einer positiven Rendite verhalf.

Die Aktienkurse einiger der im Fonds gehaltenen indischen Aktien legten zu. Das galt unter anderem für Titel aus den Bereichen Lebensmittellieferung sowie Finanz- und Kommunikationsdienstleistungen. Bestimmte Halbleiterhersteller schnitten ebenfalls gut ab. Der Verzicht auf einen großen chinesischen E-Commerce-Titel war ein weiterer Pluspunkt.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte das Fondsentagement in Indien, da es hier starke Wachstumsaussichten gab und ein paar Aktien gute Gelegenheiten boten. Dazu gehörten Werte aus den Bereichen Unternehmenstechnologie und Lebensmittellieferung. Aufgrund des intensiven Wettbewerbs in der Branche beschloss die Verwaltungsgesellschaft, Beteiligungen an Solarzellen- und Lithiumbatterieherstellern zu verkaufen.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 26,13 % nach Abzug von Gebühren, während sein Referenzwert, der MSCI AC World Net Return Index, 22,20 % verbuchte, jeweils in US-Dollar.

Der Hauptgrund für die gute Wertentwicklung des Fonds war eine starke Wertpapierausswahl unter Unternehmen, die Halbleiter und Halbleiterausstattung herstellen. Besonders hervorzuheben sind die Aktien eines Unternehmens mit Sitz in den Vereinigten Staaten, das Chips für die künstliche Intelligenz herstellt. Außerdem profitierte der Fonds von einer gelungenen Titelauswahl im Softwaresektor, wo er gegenüber dem Referenzwert übergewichtet war.

Auf der negativen Seite machten die Aktienausswahl sowie eine im Vergleich zum Referenzwert größere Position auf den Kapitalmärkten diese positiven Aspekte teilweise zunichte. Ein weiterer Schwachpunkt war die Titelauswahl bei Banken.

Im Laufe des Jahres erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Gewichtung des Fonds in den Bereichen Finanz- und IT-Dienstleistungen sowie unter Gesundheitsversorgern und -dienstleistern. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die Gewichtungen des Fonds in den Bereichen Kapitalmärkte, Textilien, Bekleidung, Luxusgüter und Seetransport.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 23,71 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 32,99 % im MSCI Brazil 10/40 NR Index, beide in US-Dollar.

Die Position des Fonds im Bildungssektor trug ebenso zur positiven Renditeentwicklung bei wie seine Investitionen in den Sektoren Basiskonsumgüter und Nahrungsmittelverarbeitung.

Die Positionen des Fonds in den Sektoren Basiskonsumgüter und Stahl führten zu Wertabzügen. Gleiches galt für die bestehende Übergewichtung des Fonds im Öl- und Gassektor gegenüber dem Referenzwert.

Die Verwaltungsgesellschaft verkaufte die Beteiligungen des Fonds an einem Einzelhandelsunternehmen und einem Versorger aufgrund betrieblicher Probleme. Eine Position in einer staatseigenen Bank wurde aufgrund von Bedenken hinsichtlich ihrer Kapitalverwendung und ihrer künftigen Marge ebenfalls verkauft.

Dank eines starken Agrarsektors entwickelte sich die Konjunktur in Brasilien allgemein besser als erwartet.

ARX Investimentos Ltda
Januar 2024

AKTIEN Forts.

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 22,79 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 25,67 % für den S&P 500 Net Total Return Index.

Die Fondserträge wurden vor allem durch die Untergewichtung von Unternehmensanteilen geschmälert. Hier hatte der Fonds ein durchschnittliches Engagement von 96 %. Die Verwaltungsgesellschaft hielt Aktien angesichts der Gewinnaussichten für teuer. Der US-Aktienmarkt erreichte 2023 jedoch ein neues Allzeithoch. Dies wurde durch überdurchschnittlich hohe Gewinne der größten Technologiewerte mit Sitz in den USA angetrieben.

Während des gesamten Jahres lag die Zielallokation des Fonds für Aktien bei 90 %. Das durchschnittliche Engagement war jedoch höher als die Zielgewichtung, da die Verwaltungsgesellschaft Call-Optionen nutzte. Dies ermöglichten es dem Fonds, an Marktrallys teilzuhaben.

Die durchschnittliche Allokation des Fonds von 2,5 % in US-Staatsanleihen wirkte sich geringfügig negativ aus. Die Barposition, die im Durchschnitt 1,4 % des Fondsvermögens betrug, hatte einen leicht positiven Effekt.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON FOOD INNOVATION FUND*

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Fonds am 10. November 2023 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von -11,31 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des MSCI AC World NR Index 11,76 % betrug, jeweils in US-Dollar.

In Anbetracht des auf das Nahrungsmittelsystem ausgerichteten Mandats des Fonds war dieser im Verhältnis zum Index nicht so stark im Sektor Informationstechnologie (IT) investiert und hielt ungleich mehr Basiskonsumwerte. Dies erwies sich als nachteilig. Dass der Fonds dadurch auf bestimmte große IT-Aktien aus den USA verzichtet hatte, richtete den größten Schaden an. Der Im Vergleich zum Referenzwert höhere Anteil von Basiskonsumwerten war ein weiterer Nachteil.

Fast alle der zehn ertragsschwächsten Aktien im Fonds stammten aus den USA. Auf dieser Liste standen Nahrungsmittelproduzenten, Hersteller landwirtschaftlicher Geräte und Industrielwerte.

Andererseits war es für den Fonds vorteilhaft, dass er keine Finanzwerte hielt. Ebenfalls günstig wirkte, dass der Fonds nicht so stark in Gesundheitswerten investiert war wie der Index.

Die Verwaltungsgesellschaft kaufte eine Reihe von Aktien von Unternehmen aus den Bereichen Nahrungsmittelproduktion, Ernährung, Medizin und Abfallwirtschaft.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Fonds am 10. November 2023 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von -13,18 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des MSCI AC World NR Index 11,76 % betrug, jeweils in US-Dollar.

Die Aktienausswahl der Verwaltungsgesellschaft hat die Fondserträge stark belastet. Zu den Verlusten für den Fonds trugen US-amerikanische Aktienwerte bei. Auch Aktien aus dem IT-Sektor waren der Wertentwicklung nicht zuträglich.

Aktien aus dem Bereich der grünen Energietechnologien verbuchten eine schwache Performance. Die Nullgewichtung bestimmter Halbleiterhersteller schmälerte ebenfalls die Rendite, da diese Aktien sehr gut abschnitten.

Außerdem wurden die Erträge durch die Übergewichtung des Fonds in den Sektoren Industrie und Versorger in Mitleidenschaft gezogen. Die Aktien mit der schlechtesten Wertentwicklung im Fonds waren tatsächlich zwei Unternehmen aus dem Bereich der sauberen Energien, die sich auf Energiequellen wie Sonnen- und Windenergie konzentrieren.

Andererseits war es für den Fonds vorteilhaft, dass er keine Finanzwerte hielt. Ebenfalls günstig wirkte, dass der Fonds nicht so stark in Gesundheitswerten investiert war wie der Index.

Bestimmte Industrielwerte brachten gute Ergebnisse. Der Verzicht auf gewisse große US-Pharma- und Energieaktien war ein Pluspunkt.

Die Verwaltungsgesellschaft engagierte sich in mehreren Unternehmen aus dem Bereich der sauberen Energien, die Produkte für eine nachhaltigere Welt herstellen.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Fonds am 10. November 2023 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von -4,07 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des MSCI AC World NR Index 11,76 % betrug, jeweils in US-Dollar.

Die Aktienausswahl der Verwaltungsgesellschaft hat die Fondserträge belastet. Infolge des Anlagemandats des Fonds stammte der Großteil seiner Beteiligungen aus dem Gesundheitssektor, dessen Entwicklung im Jahresverlauf zu wünschen übrig ließ. Der Fonds hielt Aktien einiger US-Medizinunternehmen, die sich mit der Behandlung von Schlafmangel und dem Diabetesmonitoring befassen. Diese Titel verzeichneten starke Kursrückgänge.

Das der Fonds nicht in Aktien aus dem Bereich Informationstechnologie (IT) engagiert war, minderte seinen Ertrag, da der IT-Sektor im Referenzwert am besten abschnitt.

Die Aktienausswahl der Verwaltungsgesellschaft in den USA war nicht hilfreich. Das galt vor allem für den Basiskonsumgütersektor.

Positiv zu bewerten ist, dass die großen US-amerikanischen und europäischen Pharmawerte des Fonds eine gute Performance verbuchten. Die Untergewichtung der Schwellenländer im Vergleich zum Referenzwert war ebenfalls von Vorteil.

Die Verwaltungsgesellschaft kaufte mehrere neue Aktienwerte, die dem Anlagemandat des Fonds entsprachen. Dazu gehörten Anbieter von Tierbedarf und Luxusgütern. Außerdem wurden eine Unternehmen für medizinische Geräte und ein Spezialist für das digitale Gesundheitswesen gekauft.

AKTIEN Forts.

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND Forts.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 6,30 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 9,83 % für den MSCI Emerging Markets NR Index, jeweils in US-Dollar.

Die Wertpapierauswahl schmälerte die Rendite im Berichtszeitraum, insbesondere im Sektor Informationstechnologie (IT).

Die Aktienkurse mehrerer im Fonds gehaltener chinesischer Consumer-Health-Unternehmen, Lebensmittelproduzenten und Lebensmitteleinzelhändler gaben stark nach. Des Weiteren wurden die Renditen durch Beteiligungen an asiatischen Versicherern beeinträchtigt, insbesondere an solchen, die in großem Umfang in China tätig sind. Aktien von Solarzellenherstellern zeigten ebenfalls Schwäche.

Positiv anzumerken ist, dass die Entscheidungen der Verwaltungsgesellschaft über die Höhe der Investitionen in den einzelnen Sektoren den Erträgen des Fonds zugutekamen. Es hat sich bewährt, IT-Aktien gegenüber dem Referenzwert überzugewichten. Die Aktien von Unternehmen in der Mikrochipproduktion erwirtschafteten gute Erträge.

Unterdessen stiegen die Aktienkurse bestimmter Finanzdienstleister aus Brasilien und Indien stark an.

Die Verwaltungsgesellschaft baute das Fondsengagement in Indien aus, denn das Land hat solide Wachstumsaussichten und bietet attraktive Gelegenheiten auf dem Aktienmarkt. Dazu gehörten die Aktien von Automobilherstellern und Lebensmittellieferanten. Der harte Wettbewerb unter den Herstellern von Solarzellen veranlasste die Verwaltungsgesellschaft, Aktien von Unternehmen in dieser Branche abzustoßen.

Newton Investment Management Limited*
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 9,58 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 24,18 % für den FTSE World TR Index.

Ein Pluspunkt ist, wie gut die Finanzwerte des Fonds abgeschnitten haben – vor allen Dingen US-amerikanische Versicherungsunternehmen. Ebenfalls positiv wirkte, dass der Fonds weniger Grundstoffaktien hielt als der Referenzwert. Darüber hinaus verzeichneten einige der von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählten Technologietitel eine gute Wertentwicklung, insbesondere die Hersteller von elektronischen Bauteilen und Werkstoffen.

Einer der Hauptfaktoren, der die Rendite belastete, war jedoch, dass der Fonds nicht so viele der wachstumsstärksten großen US-Technologiewerte hielt. Der Grund dafür: Diese Unternehmen erfüllen nicht die strengen Renditekriterien des Fonds.

Die Aktienauswahl belastete die Performance. Nach Regionen führen die nordamerikanischen Aktien des Fonds die schlechtesten Ergebnisse ein. Nach Sektoren schnitt das Gesundheitswesen besonders schwach ab. Die Aktienkurse einiger großer europäischer Pharmaunternehmen fielen deutlich.

Was die Käufe und Verkäufe angeht, so kaufte die Verwaltungsgesellschaft in der ersten Jahreshälfte mehrere Banken aus Schwellenländern und stockte einige Positionen in den Sektoren Consumer-Health-Produkte und Lebensmittel auf.

Die Verwaltungsgesellschaft verkaufte einige Aktien, nachdem deren starke Kursentwicklung zu einem Rückgang ihrer Dividendenrenditen geführt hatte.

Newton Investment Management Limited*
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 10,21 % nach Abzug von Gebühren, während der S&P Global Infrastructure NR Index 5,78 % verbuchte.

Im Versorgungssektor zahlte sich die Aktienausswahl der Verwaltungsgesellschaft aus und trug positiv zum Fondsertrag bei. Am besten fiel hier die Performance im Teilssektor der Stromversorger aus. Auch die gute Aktienausswahl im Energiesektor steigerte die Fondsrendite.

Die Position des Fonds im Immobiliensektor wirkte sich negativ aus. Hier waren es vor allem die börsennotierten Real Estate Investment Trusts, die dem Fonds Wertabzüge bescherten. Die Untergewichtung im Industriesektor schadete dem Fonds ebenfalls. Dies galt insbesondere für den Bereich der Verkehrsinfrastruktur, der im Jahresverlauf eine gute Wertentwicklung erzielte.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte im Laufe des Jahres die Gewichtungen des Fonds im Versorgersektor und im Sektor Kommunikationsdienste. Gleichzeitig reduzierte die Verwaltungsgesellschaft die Gewichtungen des Fonds in den Sektoren Immobilien und Industrie.

Die Verwaltungsgesellschaft verkaufte eine Immobilienposition und baute neue Positionen in Kommunikationsdiensten und Versorgern auf.

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum ein Plus von 20,38 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 23,79 % für den MSCI World NR Index, jeweils in US-Dollar.

Positionen in den Sektoren Basiskonsumgüter und Industrie trugen dazu bei, dass der Fonds diese Rendite erzielen konnte. Der Verzicht auf Aktien von Energieunternehmen – sie hatten gegen Ende des Jahres Probleme, als die Ölpreise fielen – trug ebenfalls zur Performance bei.

Die Aufschlüsselung nach Regionen zeigt, dass Aktien aus Europa (ohne das Vereinigte Königreich) den Ertrag steigerten.

Andererseits führten die Beteiligungen in Asien (ohne Japan) zu geringen Wertabzügen. Auch die Investitionen in den Sektoren Informationstechnologie und Nicht-Basiskonsumgüter waren nicht hilfreich.

Ein dänischer Pharmatitel trug dank des Erfolgs seiner beiden Medikamente für die Gewichtsabnahme am meisten zur Jahresrendite bei. Unternehmen, die Plattformen für künstliche Intelligenz herstellen, und die Entwickler der dafür notwendigen Halbleiterchips haben vor dem Hintergrund der Begeisterung über das Potenzial dieser neuen Technologie während des Jahres ebenfalls eine gute Wertentwicklung vorgelegt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat im Verlauf des Jahres

AKTIEN Forts.

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND Forts.

keine neuen Aktien zugekauft. Eine Beteiligung, ein Biotechnologieunternehmen, wurde verkauft.

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 19,94 % nach Abzug von Gebühren, während der MSCI AC World Index NR eine Rendite von 22,20 % verbuchte.

Die Entscheidungen der Verwaltungsgesellschaft zur Einzeltitelauswahl beeinträchtigten die Wertentwicklung des Fonds, insbesondere die Titelauswahl im Sektor Informationstechnologie (IT).

Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, die in großem Umfang in China tätig sind (AIA Group und Ping An Insurance), kamen schlecht weg. Bestimmte Positionen in europäischen Pharmawerten (Roche, Bayer und Lonza) schmälerten die Erträge ebenfalls. Auch die Nullgewichtung bestimmter führender Technologieunternehmen aus den USA, darunter Meta Platforms, erwies sich als nicht hilfreich.

Die Auswahl der US-Aktien durch die Verwaltungsgesellschaft war gelungen, doch die Untergewichtung der USA gegenüber dem Referenzwert schadete der Rendite. Die USA verzeichneten im Jahr 2023 die beste Performance am Aktienmarkt.

Insgesamt hat die Einzeltitelauswahl im IT-Sektor die Renditen geschmälert, doch waren die drei Unternehmen mit der besten Performance für den Fonds Technologieunternehmen: Microsoft, SAP und Applied Materials. Beteiligungen an Industriewerten (Trane Technologies, RELX und Ebara) trugen ebenfalls zur Rendite bei.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte ihr Engagement in künstlicher Intelligenz (KI) und kaufte Aktien des führenden KI-Chipherstellers NVIDIA. Technologiewerte mit Führungspositionen auf dem Halbleitermarkt, darunter Taiwan Semiconductor, wurden hinzugefügt. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte Positionen in Aktien, deren Kurse sich stark entwickelt hatten, unter anderem SAP und RELX.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Die Anteilsklasse JPY W des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -5,09 % nach Abzug von Gebühren, verglichen 23,48 % für den Russell/Nomura Small Cap Total Return Index, jeweils in japanischen Yen.

Die Einzeltitelauswahl der Verwaltungsgesellschaft beeinträchtigte die Wertentwicklung des Fonds.

Allerdings trug der Verzicht auf Investitionen in den Sektoren Pharma und Immobilien dazu bei, die Verluste zu begrenzen. Darüber hinaus war der Fonds stärker als der Referenzwert im Sektor Metallerzeugnisse investiert, was den Erträgen zugute kam.

Übergewichtete Positionen im Dienstleistungs-, Informations- und Kommunikationssektor zehrten diese Gewinne jedoch wieder auf. Die Nullgewichtung des Eisen- und Stahlsektors beeinträchtigte die Wertentwicklung ebenfalls.

Was die Einzeltitel angeht, trugen die Positionen in der Chemie-, Elektro- und Fertigungsindustrie dazu bei, die Verluste zu begrenzen.

Bestimmte Positionen in den Sektoren Marketing und Unterhaltung schmälerten die Fondserträge.

Die Verwaltungsgesellschaft nahm im Jahresverlauf acht neue Investitionen auf und veräußerte die Fondspositionen in sechs verschiedenen Unternehmen.

Unter anderem eröffnete sie eine Position in einem Stiftproduzenten und in einer inländischen Bank.

Zu den Verkäufen gehörten eine Position in einem Elektrounternehmen und ein Marketingunternehmen, das in der Gesundheitsbranche tätig ist.

Newton Investment Management Japan Ltd*
Januar 2024

BNY MELLON LONG-TERM EUROPEAN EQUITY FUND*

Im Zeitraum von der Auflegung des Fonds am 17. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023 erzielte die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds eine Rendite von 3,96 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 5,17 % für den MSCI Europe NR Index.

Der Fonds war während des Jahres stärker im Sektor Informationstechnologie (IT) investiert als der Referenzwert. In Verbindung mit einer erfolgreichen Einzeltitelauswahl beim Engagement in IT-Titeln trug dies dazu bei, dass der Fonds eine positive Rendite erzielen konnte.

Schädlich für die Fondsrendite war dagegen die Untergewichtung von Finanztiteln. Der einzige Finanztitel des Fonds schnitt schlecht ab.

Nach Ländern aufgeschlüsselt, war der Fonds in Italien und in der Schweiz klar übergewichtet. Die Position in der Schweiz schadete der Performance ebenso wie die Aktien aus dem Vereinigten Königreich.

Ein dänischer Pharmatitel trug dank des Erfolgs seiner beiden Medikamente für die Gewichtsabnahme am meisten zur Jahresrendite bei. Unternehmen, die Plattformen für künstliche Intelligenz herstellen, und die Entwickler der dafür notwendigen Halbleiterchips haben vor dem Hintergrund der Begeisterung über das Potenzial dieser neuen Technologie während des Jahres ebenfalls eine gute Wertentwicklung vorgelegt.

Der einzige Energietitel des Fonds entwickelte sich ebenfalls gut.

Bis zum Jahresende wurden sechs Titel veräußert. Im Anschluss an die Auflegung des Fonds im Juli gab es keine Neuzugänge.

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2024

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum ein Plus von 17,10 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 19,60 % für den MSCI World NR Index, jeweils in Euro.

Positionen in den Sektoren Basiskonsumgüter und Werkstoffe trugen dazu bei, dass der Fonds diese positive Rendite erzielen konnte. Der Verzicht auf Aktien

AKTIEN Forts.

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND Forts.

von Energieunternehmen – sie hatten gegen Ende des Jahres Probleme, als die Ölpreise fielen – trug ebenfalls zur Performance bei. Die Tatsache, dass der Fonds den Gesundheitssektor höher gewichtete als der Index, schmälerte die Gesamtrendite. Positiv zu vermerken ist allerdings, dass sich die Aktienwerte des Fonds in diesem Sektor gut entwickelt haben.

Aus Länderperspektive trugen die japanischen Aktien des Fonds positiv zu den Renditen bei, während Aktien aus anderen asiatischen Regionen eine Underperformance verzeichneten.

Der Fonds hielt nur zwei der „Magnificent Seven“ – Technologiewerte, die im Jahr 2023 im Mittelpunkt des Interesses standen –, was die Wertentwicklung drückte. Diese beiden Technologieunternehmen trugen jedoch am stärksten zu den Erträgen bei. Zwei weitere Beteiligungen, die auf die Fortschritte im Bereich der künstlichen Intelligenz ausgerichtet sind, generierten ebenfalls Wert. Ein dänischer Pharmatitel trug dank des Erfolgs seiner beiden Medikamente für die Gewichtsabnahme zur Performance bei.

Die Verwaltungsgesellschaft kaufte im Laufe des Jahres sechs neue Aktien und verkaufte vier.

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2024

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums verzeichnete die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds eine Rendite von 17,16 % nach Abzug von Gebühren, gegenüber 22,20 % im MSCI AC World NR Index, beide in US-Dollar.

Die Titelauswahl im Chemiesektor beeinträchtigte die Rendite des Fonds. Das Gleiche galt für den Maschinensektor.

Die Rendite des Fonds wurde durch dessen große Position in der Softwarebranche angetrieben. Dieser Sektor entwickelte sich besser als der Gesamtmarkt. Die Auswahl der Aktien in diesem Bereich war gleichermaßen hilfreich. Eine hohe Allokation in Halbleitern und Halbleiterausrüstung zahlte sich ebenfalls aus.

Über das Jahr hinweg erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Gewichtungen des Fonds in mehreren Marktsegmenten. Dazu gehörten die Sektoren Software, IT-Dienstleistungen und Automobilkomponenten.

Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte überdies die Gewichtung des Fonds in einer Reihe von Sektoren. Dazu zählten die Sektoren Elektrogeräte, Chemikalien und Halbleiterausrüstung.

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2024

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 17,14 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des S&P EuroZone SmallCap TR Index bei 13,97 %.

Die Aufschlüsselung nach Ländern zeigt, dass die Aktienauswahl der Verwaltungsgesellschaft in Frankreich gelungen war und die Fondserträge steigerte. Dies gilt insbesondere für den französischen Immobilien- und den dortigen Industriesektor.

Die Aktienauswahl in Spanien war hingegen weniger erfolgreich. Dadurch wurde die Fondsrendite beeinträchtigt. Die Untergewichtung des Fonds in Spanien war ebenfalls abträglich, da der spanische Markt im Jahr 2023 stark anstieg.

Aus Sektorsicht war die Positionierung des Fonds in Kommunikationsdienstleistungen hilfreich. Das lag an der Einzeltitelauswahl in Italien und Frankreich. Die Positionierung des Fonds im Energiesektor machte die Gewinne jedoch teilweise zunichte. Dies war auf eine wertmindernde Positionierung in Österreich zurückzuführen.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte die Fondsgewichtung im Finanzsektor, indem sie die Aktien eines Versicherungsunternehmens erwarb. Die Gewichtung des Energiesektors wurde durch das Aufstocken einer Bestandsposition erhöht.

Gleichzeitig reduzierte die Verwaltungsgesellschaft die Fondsbestände im Industriesektor, indem eine Beteiligung an einem Maschinenbauunternehmen verkauft wurde. Die Verwaltungsgesellschaft verringerte die Position des Fonds im Versorgungssektor, in dem sie ein paar der Fondsbeteiligungen stützte.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Fonds am 8. Dezember 2023 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von -5,54 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 17,29 % für den MSCI AC World NR Index.

In diesem Berichtszeitraum sah die Verwaltungsgesellschaft mehr Chancen im Biotechnologiesektor als bei Life Science Tools. Die Mittel des Fonds wurden gemäß dieser Einschätzung eingesetzt.

Die größten Negativbeiträge stammten unter anderem von Aktien eines Gentherapieunternehmens und eines DNA-Sequenzierungsunternehmens. Die Aktien eines Spezialisten für die Behandlung von Stoffwechselkrankheiten entwickelten sich ebenfalls schlecht. Die Beteiligungen an diesen Unternehmen führten zu einer Belastung der Fondsrenditen.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 3,60 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des MSCI Emerging Markets NR Index bei 9,83 %.

Die Einzeltitelauswahl minderte die Rendite. Beteiligungen an chinesischen Aktien beeinträchtigten die Fondserträge. Dazu gehörten Unternehmen, die in der chinesischen Versicherungsbranche und im dortigen Gesundheitswesen tätig sind. Die Aktienkurse von Unternehmen, die Materialien für Elektrofahrzeuge (EV) herstellen, gaben ebenfalls stark nach.

Der Fonds profitierte von den Beteiligungen an einigen großen europäischen Herstellern von Mikrochips. Dennoch blieb das Fondsengagement im Technologiesektor insgesamt hinter den Erwartungen zurück. Die Unternehmen, die im Bereich der grünen Energie tätig sind, präsentierten sich ausgesprochen schwach.

Positiv anzumerken ist, dass die Rendite des Fonds von der Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft profitierte, sich im Vergleich zum Index stärker in Indien und nicht so stark

AKTIEN Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EMERGING MARKETS FUND Forts.

in China zu engagieren. Die Untergewichtung des Sektors Nicht-Basiskonsumgüter war ebenfalls ein positiver Faktor.

Die Entscheidung zum Verzicht auf bestimmte Konsumgüteraktien in China, die Schwäche zeigten, verbesserte das Ergebnis. Ebenfalls gut abgeschnitten haben einige der globalen Basiskonsumgüteraktien des Fonds.

Angesichts der niedrigen Aktienkurse stockte die Verwaltungsgesellschaft ihre Bestände in der Solar- und EV-Branche auf. Die Verwaltungsgesellschaft kaufte überdies Anteile an einigen Industrieunternehmen. Währenddessen reduzierte sie die Bestände des Fonds in Gesundheitswerten und in Aktien von in China tätigen Versicherungen.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EQUITY FUND*

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 16,61 % nach Abzug von Gebühren, während der MSCI AC World NR Index eine Rendite von 22,20 % verbuchte.

Die Begeisterung der Anleger für KI machte diesen Appetit auf den IT-Sektor. Dessen Übergewichtung im Portfolio leistete einen positiven Wertbeitrag. Allerdings erwies sich Titelauswahl in diesem Sektor als so enttäuschend, dass der positive Effekt mehr als zunichte gemacht wurde.

Auch hatte die Titelauswahl bei Versorgern und Finanzwerten einen negativen Effekt. Die beiden Versicherungsgesellschaften AIA Group und Ping An hatten zu kämpfen, da die anhaltenden Bedenken hinsichtlich des makroökonomischen Umfelds in China belastend wirkten.

Die Titelauswahl war bei Industrie- und Basiskonsumgütern vorteilhaft. Unterstützt durch die Nachfrage nach energieeffizienten Upgrades leistete Trane Technologies, der Hersteller von Heizungs-, Lüftungs- und Klimatechnik, einen positiven Wertbeitrag. Microsoft schnitt ebenfalls gut ab, da mehrere Titel im Laufe des Jahres von dem Momentum im Zusammenhang mit KI profitierten.

Das Portfolio verzeichnete im Berichtszeitraum verschiedene beträchtliche Veränderungen, einen Teil davon in Verbindung mit dem Übergang zu einem nachhaltigen Mandat. Zu den größten Neuzugängen im Portfolio zählten der Einzelhändler Costco Wholesale, der Hersteller von Grafikprozessoren Nvidia und Ingersoll Rand, der führende Anbieter von Kompressionstechnologie.

Zu den wichtigsten Verkäufen gehörten das Versorgungsunternehmen Exelon, die US-Eisenbahngesellschaft Norfolk Southern, der Getränkehersteller Diageo und die Universal Music Group.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD C (Inc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,73 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 25,67 % für den S&P 500 NR Index.

Die Fondserträge wurden durch die Untergewichtung im Bereich Informationstechnologie (IT) beeinträchtigt. Durch die Begeisterung der Anleger für künstliche Intelligenz entwickelte sich der IT-Sektor im Jahr 2023 gut. Die Aktienausswahl innerhalb des IT-Sektors erwies sich als allerdings als wenig hilfreich. Der Fonds war in geringerem Umfang im Sektor Kommunikationsdienste engagiert als der Referenzwert, was die Fondrendite schmälerte. Die Auswahl bestimmter Einzeltitel zehrte ebenfalls einen Teil der Gewinne auf.

Im Laufe des Jahres profitierte der Fonds von seiner Untergewichtung im Basiskonsumgütersektor. Aktien aus wachstumsorientierten Branchen schnitten besser ab als defensivere Titel, wie sie im Basiskonsumgütersektor zu finden sind. Die Nullgewichtung von Aktien aus dem Immobiliensektor trug ebenfalls dazu bei, eine positive Rendite für den Fonds zu erwirtschaften. Der Immobiliensektor bot 2023 ein schwaches Bild.

Im Laufe des Jahres stockte die Verwaltungsgesellschaft die Beteiligungen des Fonds in den Sektoren Werkstoffe, Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen auf. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die Beteiligungen des Fonds in den Sektoren IT, Industrie und Versorger.

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2024

FESTVERZINSLICHE

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 11,95 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 13,04 % für den Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate USD Hedged TR Index.

Die übergewichtete Position des Fonds in neuen „Fallen Angels“ (Anleihen, die erst kürzlich ihren Investment-Grade-Status eingebüßt haben) zahlte sich über weite Strecken des Jahres nicht aus.

Die Wertpapierauswahl belastete leicht.

Eine kleine Position in einer ausgefallenen Anleihe aus dem Werkstoffsektor schmälerte die Fondsrendite, doch konnten Positionen in Banken einen Teil der Verluste ausgleichen.

Preisunterschiede und Transaktionskosten haben sich im Laufe des Jahres kaum ausgewirkt.

Insight North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,65 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 9,10 % für den Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate TR Index USD Hedged.

Die Auswahl der Anleihen, in die die Verwaltungsgesellschaft investierte, wirkte sich im Jahresverlauf positiv aus.

Besonders ergiebig waren die Anleihen von Banken und Technologieunternehmen.

Die Anleger hielten sich im dritten Quartal 2023 von risikoreicheren Anlagen fern, weil sie befürchteten, die Zinsen könnten noch steigen. Die Fondsbestände an Anleihen mit BBB-Rating waren zu diesem Zeitpunkt nicht hilfreich.

Später, als die Inflationsraten nachgaben, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung auf Zinssenkungen für 2024. Zum Jahresende entwickelten sich die Anleihenmärkte sehr gut. Die Bestände des Fonds an Anleihen mit BBB-Rating aus verschiedenen Sektoren legten zu.

Insight North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 11,76 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 13,68 % für den US HY Fallen Angel 3% Cap TR Index.

Die Investitionen des Fonds in Unternehmensanleihen erwiesen sich bei der Erzielung dieser Rendite als besonders unterstützend.

In der ersten Jahreshälfte 2023 sorgten sich die Anleger um die anhaltend hohe Inflation. Dies löste Volatilität auf den Anleihenmärkten aus. Gleich mehrere der Unternehmensanleihen, in die die Verwaltungsgesellschaft investiert hatte, entwickelten sich dennoch gut.

Dies wurde jedoch durch die Schwäche der Fondsbestände in neueren „Fallen Angels“ (Anleihen, die erst kürzlich ihren Investment-Grade-Status eingebüßt haben) kompensiert. Diese Anleihen gaben aufgrund von Rezessionsängsten nach.

Im dritten Quartal 2023 mieden die Anleger risikolastigere Anlagen aufgrund der Angst, dass die Zentralbanken noch weitere Zinserhöhungen vornehmen könnten. Obwohl die Fondsbeteiligungen in den Sektoren Energie und Transport gut abschnitten, reichte dies nicht aus, um die Schwäche in anderen Bereichen auszugleichen.

Später, als die Inflationsraten nachgaben, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung auf Zinssenkungen für 2024. Die Anleihenmärkte verzeichneten im November und Dezember eine kräftige Rally, und die Bestände des Fonds an neueren „Fallen Angels“ erholten sich. Die Sektoren, die in der Regel eine gute Wertentwicklung verbuchen, wenn die Wirtschaft in einer besseren Verfassung ist, leisteten einen starken Beitrag zur Performance.

Insight North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 12,08 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 13,45 % für den Bloomberg US Corporate High Yield TR Index.

Die Investitionen des Fonds in Unternehmensanleihen trugen zur Erzielung dieser Rendite bei.

In der ersten Hälfte des Jahres 2023 fanden die Anleger die penetrant hohe Inflation bedenklich, die für Unbeständigkeit auf den Anleihenmärkten sorgte. Diverse Unternehmensanleihen, in die die Verwaltungsgesellschaft investierte, entwickelten sich positiv.

Dies wurde jedoch durch die Schwäche der Fondsbestände in neueren „Fallen Angels“ (Anleihen, die erst kürzlich ihren Investment-Grade-Status eingebüßt haben) kompensiert. Diese Anleihen gaben aufgrund von Rezessionsängsten nach. Aus demselben Grund zeigten auch einige qualitativ höherwertige Anleihen Schwäche.

Im dritten Quartal 2023 mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aufgrund der Angst, dass die Zentralbanken noch weitere Zinserhöhungen vornehmen könnten. Die Bestände des Fonds im Energie- und Bankensektor entwickelten sich gut und glichen die Schwäche in den Konsumsektoren und bei den Immobilienanleihen aus.

Später, als die Inflation nachgab, fassten die Anleger Vertrauen in die Vorstellung, dass die Zinssätze 2024 gesenkt werden könnten. Die Anleihenmärkte erholten sich im November und Dezember deutlich. Die Beteiligungen des Fonds an Technologieunternehmen und Banken erzielten eine gute Performance, Anlagen in den Sektoren Konsum

FESTVERZINSLICHE Forts.

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

und Verkehr hinkten jedoch hinterher.

Insight North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,23 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 9,08 % für den JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index Broad Diversified (CEMBI - BD) TR Index.

Die Anpassung der Fondsbestände an Unternehmensanleihen an die Marktbewegungen erwies sich als hilfreich.

In der ersten Hälfte des Jahres 2023 waren die Märkte durch eine hohe Volatilität gekennzeichnet. Die Anleger sorgten sich über die anhaltend hohe Inflation. Die Investitionen des Fonds in China, insbesondere im Immobilien- und Technologiesektor, führten zu Abzügen von der Performance und machten den positiven Beitrag südafrikanischer Unternehmensanleihen zunichte.

In den Sommermonaten hielten sich die Anleger von risikolastigeren Vermögenswerten fern, da sie das Gefühl hatten, dass die großen Zentralbanken die Zinssätze erhöhen könnten. In diesem Zeitraum trugen die Bestände des Fonds an Hochzinsanleihen aus Mittel- und Osteuropa zur Rendite bei.

Allerdings wurde dies durch Investitionen in asiatischen Unternehmensanleihen, allen voran Emissionen großer chinesischer Technologieunternehmen, mit schlechter Performance kompensiert.

Später, als die Inflation nachgab, gewannen Anleger allmählich die Zuversicht, dass die Zinssätze 2024 gesenkt werden könnten. Die Auswahl der Unternehmensanleihen durch die Verwaltungsgesellschaft hatte vor dem Hintergrund einer Marktrally ebenfalls positive Effekte.

Infolge der verbesserten Wirtschaftsaussichten wurden mehrere Hochzinsanleihen in das Portfolio aufgenommen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 10,13 % nach Abzug von Gebühren, während der JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global TR Index eine Rendite von 10,45 % verbuchte.

Der wichtigste positive Beitrag zur Fondsrendite kam von den Spreads – die zusätzliche Rendite, die Anleger bei Investitionen in risikoreichere Anleihen abschöpfen wollen. Der Beitrag der Fondsduration (die dessen Empfindlichkeit gegenüber Zinsänderungen misst) war relativ neutral.

In Bezug auf die Spreads erwiesen sich vor allem Short-Positionen in China, Saudi-Arabien und den Vereinigten Arabischen Emiraten als positiv. Ein Long-Engagement in Nigeria trug ebenfalls Früchte.

Die größten Wertabzüge durch Spreads brachten Long-Positionen in Ecuador und Israel und eine Short-Position in El Salvador.

In der ersten Jahreshälfte verringerte die Verwaltungsgesellschaft ihr Engagement in Staats- und Unternehmensanleihen mit Investment Grade, da diese im Vergleich zu ihren US-Pendants allmählich teuer wirkten. Später verringerte die Verwaltungsgesellschaft das Engagement in Anleihen mit BB-Rating, indem sie die Bestände in Paraguay und Südafrika zurückfuhr.

Im Laufe des Jahres managte die Verwaltungsgesellschaft aktiv die Fondsbestände in türkischen Staatsanleihen. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die übergewichtete Position des Fonds in der Jahresmitte, nachdem die Anleihenurse gestiegen waren. Zum Jahresende stockte sie die Position wieder auf.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 15,32 % nach Abzug von Gebühren, während der JP Morgan GBI-EM Global Diversified TR Index eine Rendite von 12,70 % verbuchte.

Der wichtigste positive Beitrag zu den Renditen des Fonds resultierte aus der Durationspositionierung, die die Sensitivität des Fonds gegenüber Zinsänderungen misst. Die Währungspositionierung war ebenfalls zuträglich. Staatsanleihen in lokaler Währung hatten einen neutralen Effekt.

Die Long-Positionen des Fonds in Kolumbien, Südafrika und Ungarn steigerten den Ertrag. Das Short-Engagement in der Türkei zahlte sich ebenfalls ordentlich aus. Bei den Währungen verbesserten die Türkei, Ägypten und Chile die Fondsrendite.

Für Wertabzüge durch die Duration waren hauptsächlich Short-Positionen in Polen, Rumänien und Ägypten verantwortlich. Bei den Währungen schaden Südafrika und Malaysia den Erträgen.

Zu Beginn des Jahres erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Gewichtung asiatischer Währungen. Zudem baute sie Long-Positionen im thailändischen Baht und im ungarischen Forint auf.

Zu Beginn des Jahres begann die Verwaltungsgesellschaft bei Staatsanleihen, die Position des Fonds in Mittel- und Osteuropa auszubauen. Hier war der Fonds zuvor untergewichtet. Dies geschah zum Teil durch eine stärkere Gewichtung Ungarns. Gegen Ende des Jahres stockte die Verwaltungsgesellschaft die Positionen in Staatsanleihen aus Kolumbien, Chile und der Türkei auf.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

FESTVERZINSLICHE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 13,33 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 11,12 % für den Referenzwert, einen zusammengesetzten Index bestehend aus 50 % JP Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified TR Index, 25 % JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global TR Index und 25 % JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified TR Index (jeweils in US-Dollar). Die wichtigsten positiven Beiträge zur Performance kamen von den Spreads (die zusätzliche Rendite, die Anleger anstreben, wenn sie risikoreichere Anleihen halten) und der Duration (die die Empfindlichkeit des Fonds gegenüber Zinssätzen misst). Auch die Währungspositionierungen waren hilfreich.

Bei Spreads kamen die wichtigsten positiven Wertbeiträge von Long-Positionen in Nigeria, Argentinien und Mexiko. In puncto Duration lagen Long-Positionen in Kolumbien, Ungarn und Korea im Fonds an der Spitze.

Die größten Wertabzüge durch Spreads brachten Long-Positionen in Ecuador und Israel und eine Short-Position in El Salvador. Bei der Duration leisteten Long-Positionen in Polen und Short-Positionen in Saudi-Arabien und China die größten Negativbeiträge.

In der ersten Jahreshälfte verkaufte die Verwaltungsgesellschaft einige Anleihen mit Investment Grade, da diese im Vergleich zu ihren US-Pendants allmählich teuer wirkten. Mitte des Jahres reduzierte die Verwaltungsgesellschaft die übergewichtete Position des Fonds in türkischen Staatsanleihen, nachdem deren Kurse angestiegen waren. Diese Position wurde dann zum Jahresende wieder aufgestockt.

Die Verwaltungsgesellschaft baute im Jahresverlauf Long-Positionen im thailändischen Baht und im ungarischen Forint auf. Bei polnischen Staatsanleihen und bei den übergewichteten Positionen in Brasilien und Argentinien wurden Gewinne mitgenommen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 13,37 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 10,97 % für den zusammengesetzten Referenzwert (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).

Es zahlte sich aus, genau im Auge zu behalten, wie die Investitionen des Fonds in Staats- und Unternehmensanleihen auf die Marktbewegungen reagierten.

Der Überblick über wichtige Wirtschaftsindikatoren wie beispielsweise die Inflationsraten und die Maßnahmen der Zentralbanken half der Verwaltungsgesellschaft, diese Renditen einzufahren. Positionen in bestimmten Ländern und Branchen wurden angepasst, wenn dies notwendig erschien. Die Fondserträge profitierten von diesem Ansatz.

Die Investitionen des Fonds an den Devisenmärkten wurden ebenso scharf im Blick behalten.

Die von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählten Anleihen entwickelten sich im Laufe des Jahres gut und trugen im Vergleich zum Referenzwert positiv zur Fondsrendite bei.

Beteiligungen in Argentinien, Brasilien, China, Mexiko, Nigeria, Rumänien und der Ukraine waren im Jahresverlauf am einträglichsten.

Es gab keine nennenswerten Negativfaktoren.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 7,64 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond TR Index eine Rendite von 7,19 %.

Die Anpassung der Fondsanlagen in Staats- und Unternehmensanleihen an die Marktbewegungen erwies sich als besonders zweckdienlich, um diese Rendite zu erzielen.

In der ersten Hälfte des Jahres 2023 waren die Anleger sehr besorgt über die anhaltend hohe Inflation, die für die Unbeständigkeit der Anleihemärkte verantwortlich war. Die Auswahl der Unternehmensanleihen (die von einem Unternehmen emittiert werden) durch die Verwaltungsgesellschaft zahlte sich aus. Anleihen aus dem Bankensektor leisteten besonders hohe Wertbeiträge.

Im dritten Quartal 2023 mieden die Anleger risikolastigere Anlagen aufgrund der Erwartung, dass die Zentralbanken die Zinsen erneut erhöhen könnten. In diesem Berichtszeitraum verfolgte die Verwaltungsgesellschaft einen vorsichtigeren Ansatz bei der Investition in Staatsanleihen, was der Rendite zugutekam. Ausgewählte Investitionen in Unternehmensanleihen zahlten sich ebenfalls ordentlich aus.

Im November und Dezember weckten die nachlassenden Inflationsraten bei den Anlegern Zuversicht, dass die Zinssätze im Jahr 2024 gesenkt werden könnten. Investitionen in bestimmten europäischen Märkten für Staatsanleihen leisteten weiterhin einen positiven Beitrag zur Fondsperformance.

Die Unternehmensanleihen des Fonds entwickelten sich am Jahresende besonders gut, da es zu einer Rally bei Risikoanlagen kam.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,86 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der Markt iBoxx Euro Corporates TR Index eine Rendite von 8,19 %.

Die Anpassung der Investitionen des Fonds in Unternehmensanleihen an die Marktbewegungen hat mit zu dieser Rendite beigetragen.

In der ersten Hälfte des Jahres 2023 waren die Märkte von Volatilität gekennzeichnet, da die Sorgen vor hartnäckiger Inflation zunahmen. Taktische Long-Positionen in Unternehmensanleihen steigerten in dieser Zeit die Fondserträge ebenso wie die Performance einiger Bestände in Bankanleihen.

Im dritten Quartal des Jahres mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aus Angst vor weiteren potenziellen Zinserhöhungen durch die Zentralbanken. Mehrere Beteiligungen des Fonds verloren in dieser Zeit an Boden.

FESTVERZINSLICHE Forts.

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND Forts.

Darunter befanden sich Anleihen von Automobilherstellern, Banken und Versorgungsunternehmen.

Später, als die Inflation den Rückzug antrat, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung auf Zinssenkungen. Am Jahresende entwickelten sich die Anleihenmärkte daher gut.

Die Verwaltungsgesellschaft beteiligte sich an mehreren Neuemissionen. Der Fonds tätigte überdies einige Investitionen in den Sektoren Versorgungsunternehmen und Immobilien. Insgesamt hat die Wahl der Anleihen die Renditen angetrieben, insbesondere in den Sektoren Telekommunikation und Versorger.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON FLOATING RATE CREDIT FUND*

Während des Zeitraums von der Auflegung des Fonds am 26. Juni 2023 bis zum 31. Dezember 2023 erzielte die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds eine Rendite von 5,81 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 1,99 % für den 3-Monats-EURIBOR.

Die Verwaltung der Fondsbestände an variabel verzinslichen Schuldtiteln – sie zahlen einen variablen Zinssatz auf der Grundlage eines Referenzsatzes (im Gegensatz zu einer Anleihe mit einem Festzins) – hatte positive Effekte.

Die Einzeltitelauswahl der Verwaltungsgesellschaft für den Fonds war gelungen. Diese Beteiligungen trugen dazu bei, dass der Fonds im Laufe des Jahres ein besseres Ergebnis erwirtschaftete als der Referenzwert.

Der Fonds profitierte zudem von der Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft, in Wertpapiere mit einem weiter in der Zukunft liegenden Fälligkeitsdatum zu investieren.

Die taktische Steuerung des Engagements des Fonds während der Auf- und Abwärtsbewegungen an den Anleihenmärkte im Laufe des Jahres beflügelte die Performance ebenfalls.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 2,63 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 4,13 % für den JP Morgan Global GBI Unhedged TR Index.

Die Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft, in Schwellenländeranleihen zu investieren, trug Früchte und verhalf dem Fonds über das Jahr hinweg zu einer positiven Rendite.

Die Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft, den Fonds im Vergleich zum Index mit einer geringeren Duration zu positionieren (was ihn gegenüber Zinsänderungen empfindlicher macht), hat in der ersten Hälfte des Jahres 2023 gut funktioniert. In den letzten Monaten des Jahres – als die Zinssätze fielen und die Kurse langlaufender Staatsanleihen stiegen – schmälerte diese Positionierung die Rendite jedoch.

Bei Währungen beeinträchtigte eine Long-Position im japanischen Yen die Performance des Fonds.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte die Duration des Fonds in der ersten Jahreshälfte, indem sie etliche Staatsanleihen kaufte. Die Duration wurde im dritten Quartal durch den Verkauf langlaufender britischer Staatsanleihen und den Kauf neuseeländischer Staatsanleihen mit kurzer Laufzeit verringert. In den letzten Monaten des Jahres erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Duration erneut, hielt sie aber unter dem Durationsniveau des Index.

Außerdem kamen einige Anleihen aus Schwellenländern hinzu.

Newton Investment Management Limited*
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 9,17 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 8,68 % für den Bloomberg Global Aggregate Credit USD-Hedged Total Return Index, beide in US-Dollar.

Insbesondere trug die Auswahl der Anleihen durch die Verwaltungsgesellschaft dazu bei, diese Rendite zu erzielen.

Der Fonds investierte in eine Reihe traditionell starker europäischer Immobiliengesellschaften. Nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft waren diese Unternehmen in der Zeit, als die Zinssätze stiegen und die Immobilienbewertungen fielen, zu Unrecht von der negativen Stimmung in der Branche abgestraft worden. Dies zahlte sich aus, da der Sektor gegen Ende des Jahres zulegte.

Der Fonds hielt übergewichtete Positionen in Banken und Versicherern, mit einer Ausrichtung auf europäische Unternehmen.

Auch taktische Long-Positionen bei Unternehmensanleihen waren den Erträgen förderlich.

Die Verwaltungsgesellschaft platzierte eine „Relative-Value-Investition“ in der Überzeugung, dass die Märkte die Wertpapiere europäischer Unternehmen im Vergleich zu ihren US-amerikanischen Pendants zu niedrig bewertet hatten. Auch diese leistete einen Wertbeitrag.

Eine kleine Position in Staatsanleihen aus Industrieländern führte in der ersten Jahreshälfte zu Wertabzügen.

In den Sektoren Immobilien, Finanzen und Versorger hielt der Fonds größere Positionen als der Referenzwert. Die Verwaltungsgesellschaft bevorzugte Versorgungsunternehmen, da sich dieser Sektor tendenziell selbst dann gut entwickelt, wenn der Markt nachgibt.

Als sich die risikoreicheren Märkte aufgrund der für 2024 erwarteten Zinssenkungen erholten, erhöhte die Verwaltungsgesellschaft Mitte Dezember die Gewichtung von Unternehmensanleihen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 3,25 % nach Abzug von Gebühren, während der SOFR (30-Day Compounded) + 2% eine Rendite von 7,08 % verbuchte.

Alle Segmente des Anleihenmarktes, in die die Verwaltungsgesellschaft investiert hat, erzielten positive Renditen. Die besten Renditen für den Fonds wurden durch Anleihen von Regierungen der Schwellenländer (insbesondere Lateinamerikas) erzielt.

FESTVERZINSLICHE Forts.

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND Forts.

Investment-Grade-Unternehmensanleihen (Unternehmensanleihen mit guter Bonität) erzielten im Laufe des Jahres hohe Renditen. Auch Hochzinsanleihen schnitten gut ab. Die Anleger kauften diese Anleihen aufgrund ihrer höheren Zinszahlungen, die noch attraktiver sein dürften, falls die Zinsen 2024 fallen.

Von Regierungen begebene Anleihen (insbesondere US-Schuldtitel, die in den nächsten Jahren fällig werden) trugen ebenfalls zu den Fondserträgen bei.

Schwäche zeigten dagegen Anleihen mit einer langen Laufzeit (mit weit in der Zukunft liegenden Fälligkeitsterminen), die von den Regierungen der USA, des Vereinigten Königreichs und Neuseelands begeben wurden. Die Call-Optionen des Fonds (die Möglichkeit, aber nicht die Verpflichtung zum Kauf von Wertpapieren) auf Staatsanleihen verloren ebenfalls an Wert. Die Währungsabsicherung schmälerte die Rendite zusätzlich.

In der ersten Jahreshälfte erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Duration des Fonds (die seine Sensitivität gegenüber Zinssätzen misst). Dies geschah durch den Zukauf verschiedener Staatsanleihen. Später wurde die Duration dann reduziert, hauptsächlich durch den Verkauf langlaufender US-Staatsanleihen. Im weiteren Verlauf des Jahres erhöhte die Verwaltungsgesellschaft die Investitionen des Fonds in japanischen Staatsanleihen mit langen Laufzeiten und Staatsanleihen aus Schwellenländern.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 12,87 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 13,78 % für den ICE BofA Developed Markets High Yield Constrained Total Return Index, jeweils in US-Dollar.

Die Einzeltitelauswahl der Verwaltungsgesellschaft trug zu dieser starken Rendite bei. Besonders zuträglich waren Anleihen aus den Sektoren Dienstleistungen und Telekommunikation. Die Bestände des Fonds an Collateralised Loan Obligations und Bankkrediten leisteten ebenfalls einen Beitrag zu der positiven Rendite.

Die Sektorallokation wirkte allerdings leicht abträglich. Der Fonds war in den Sektoren Telekommunikation und Verpackungen stärker vertreten als der Referenzwert, was sich nicht auszahlte.

Die Höhe der Barwerte im Fonds schmälerte die Rendite ebenfalls.

Für die Zukunft erwartet die Verwaltungsgesellschaft gute Anlagegelegenheiten in Anleihen im gesamten Spektrum der Kreditratings, einschließlich Anleihen mit einem niedrigeren Rating, die stabil erscheinen und nicht ausfallgefährdet sind. Anleihen aus dem Finanz-, Verpackungs- und Telekommunikationssektor erscheinen der Verwaltungsgesellschaft am attraktivsten. Die eher auf die Verbraucher ausgerichteten Sektoren werden skeptischer betrachtet.

Alcentra NY, LLC
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 13,20 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 4,96 % für den SOFR (90 Tage aufgezinst), jeweils in US-Dollar.

Die Verwaltung der Investitionen des Fonds in hochverzinslichen Unternehmensanleihen als eine Reaktion auf die Bewegungen am Markt hat mit zu dieser Rendite beigetragen.

In der ersten Jahreshälfte sorgten sich die Anleger über die penetrante hohe Inflation, die für die Unbeständigkeit der Anleihenmärkte verantwortlich war. Der Fokus der Verwaltungsgesellschaft auf Anleihen, die von Unternehmen mit einem starken Cashflow begeben wurden, trug in diesem Berichtszeitraum positiv zur Fondsrendite bei. Der Fonds profitierte auch davon, dass er Anleihen von Banken und von Unternehmen mied, bei denen die Ausfallwahrscheinlichkeit am größten war.

Im dritten Quartal des Jahres mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aus Angst vor weiteren potenziellen Zinserhöhungen durch die Zentralbanken. In diesen Monaten bewährte sich die Einzeltitelauswahl der Verwaltungsgesellschaft bei Hochzinsanleihen (die tendenziell als risikoreicher gelten). Der Fokus auf Anleihen von Unternehmen mit besserer Bonität hatte ebenfalls einen positiven Effekt auf die Rendite.

Später, als die Inflationsraten nachgaben, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung, dass die Zinssätze 2024 gesenkt werden würden. Die Verwaltungsgesellschaft stockte die Beteiligungen des Fonds an qualitativ höherwertigen Unternehmensanleihen weiter auf. Gleichzeitig mied sie riskantere Sektoren wie Immobilien, Einzelhandel, Technologie und Banken. Das zahlte sich aus.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 2,57 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 5,29 % für den Referenzwert, den 1-Monats-EURIBOR + 2%.

Anlagen mit einem „höheren Risiko“, wie z. B. Schwellenländeranleihen, leisteten den größten Beitrag zu den positiven Renditen des Fonds. Anleihen, die von den Regierungen Kolumbiens, Brasiliens und Perus begeben wurden, waren besonders hilfreich.

Anleihen von Regierungen der Industrieländer sowie Unternehmensanleihen steigerten die Rendite ebenfalls. Im November und Dezember entwickelten sich diese Anlagen besonders gut.

Leichte Verluste brachte dagegen das Engagement in Staatsanleihen aus Bolivien und Ecuador. Der Fonds generierte Erträge aus US-amerikanischen, australischen und neuseeländischen Staatsanleihen. Anleihen-Futures aus anderen Ländern hatten den gegenteiligen Effekt.

Der Fonds bezog Mitte des Jahres eine Position im japanischen Yen, die sich als nachteilig erweisen sollte. Der japanische Yen war im Jahr 2023 die schwächste Währung eines maßgeblichen Industrielands.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte das Fondsengagement in den Schwellenländern, indem sie Anleihen aus Brasilien, Mexiko und Indonesien kaufte, die auf die jeweilige Lokalwährung lauteten. Ebenfalls wurden in US-Dollar denominierte Anleihen gekauft. In der zweiten Jahreshälfte

FESTVERZINSLICHE Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND Forts.

wurde eine Long-Position in japanischen Staatsanleihen mit einer Laufzeit von 30 bis 40 Jahren eingeführt.

Am Jahresende, als erste Anleger auf eine Zinssenkung der US-Notenbank im Jahr 2024 spekulierten, reduzierte die Verwaltungsgesellschaft die Bestände des Fonds in US-Dollar.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 10,10 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 6,67 % für den LIPPER Bond Global USD Average.

Trotz einer starken Marktvolatilität in der ersten Jahreshälfte kam der Fonds auf eine positive Rendite. Die besten Wertbeiträge resultierten aus den übergewichteten Positionen in Unternehmensanleihen (Anleihen, die von einem Unternehmen und nicht von einer Regierung ausgegeben werden) und anderen „risikoreichen“ Vermögenswerten.

In der zweiten Jahreshälfte, als die Inflationsraten immer weiter zurückgingen, kam unter den Anlegern die Hoffnung auf, die Zinserhöhungen könnten beendet sein. Dies war insbesondere in den letzten beiden Monaten des Jahres 2023 der Fall.

Vor diesem hoffnungsvollen Hintergrund profitierte die lange Durationspositionierung des Fonds (die ihn empfindlicher gegenüber Zinsänderungen macht). Die inflationsempfindlichen Positionen des Fonds und die Positionen in Unternehmensanleihen trugen ebenfalls positiv zur Rendite bei.

Insight North America LLC
Januar 2024

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse USD C (Acc.) des Fonds eine Rendite von 7,61 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 7,64 % für seinen Referenzwert, einem zusammengesetzten Index, der zu 50 % aus dem Bloomberg Barclays Municipal Tax-Exempt TR Index und zu 50 % aus dem Bloomberg Barclays US Municipal Taxable TR Index besteht.

Die Verwaltung der Anlagen in US-amerikanischen Kommunalanleihen war der Rendite des Fonds förderlich. Diese Anleihen werden von lokalen Bezirksregierungen und Bundesstaaten begeben, um Infrastrukturprojekte zu finanzieren.

In der ersten Jahreshälfte waren die Märkte volatil, da sich die Anleger um die hartnäckig hohe Inflation sorgten. Der Fokus der Verwaltungsgesellschaft auf Kommunalanleihen, die durch Einnahmen aus bestimmten Projekten gedeckt sind, steigerte die Rendite des Fonds. Den gleichen Effekt hatte ein Fokus auf Emittenten mit geringerer Ausfallwahrscheinlichkeit.

Im dritten Quartal des Jahres mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aus Angst vor weiteren potenziellen Zinserhöhungen durch die Zentralbanken. In diesem Berichtszeitraum zahlten sich die Auswahlentscheidungen der Verwaltungsgesellschaft bei der Investition in Kommunalanleihen aus. Die Renditen wurden dadurch begünstigt, dass der Fokus auf Sektoren lag, die von einer starken US-Wirtschaft profitieren, wie z. B. das Transportwesen.

Im vierten Quartal, als die Inflation nachzulassen begann, rechnete der Markt für 2024 verstärkt mit Zinssenkungen. Die Verwaltungsgesellschaft legte ihren Schwerpunkt auf Kommunalanleihen aus den bevölkerungsreichsten und wirtschaftlich stärksten Bundesstaaten. Dazu gehören New York und Kalifornien.

Insight North America LLC
Januar 2024

RESPONSIBLE HORIZONS EM DEBT IMPACT FUND*

Im Zeitraum seit Auflegung des Fonds am 24. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von 5,08 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des J.P. Morgan EM Credit Green, Social and Sustainability Bond Diversified Index (USD Hedged) 5,84 % betrug, jeweils in US-Dollar.

Die Auswahl von Impact-Anleihen durch die Verwaltungsgesellschaft, die bestimmte ökologische oder soziale Ziele unterstützen, trug positiv zu den Fondserträgen bei.

Der Fonds verzeichnete zwar aufgrund der Auflegung in einem steigenden Markt einen verhaltenen Start, schnitt aber in den Frühlingsmonaten gut ab, da er nicht so stark in Immobilien und Staatsanleihen investiert war.

In den Herbstmonaten, als dem Anlegerpublikum die nach wie vor hohe Inflation und die hohen Zinssätze zusetzten, ging die Verwaltungsgesellschaft mit Bedacht vor.

Bis zum Jahresende kam es den Erträgen des Fonds zugute, dass Hoffnung auf einen baldigen Rückgang der Zinsen aufkam. Die Verwaltungsgesellschaft fügte dem Portfolio einige risikoreichere Anlagen hinzu, die zu attraktiven Preisen erworben wurden.

Die Verwaltungsgesellschaft kam der Verpflichtung des Fonds nach, einen positiven ökologischen und sozialen Einfluss auszuüben. Zum Jahresende waren die Bestände des Fonds auf 16 der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ausgerichtet, die auf Bereiche wie saubere Energie und sauberen Transport sowie den Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen abzielen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,79 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index bei 8,19 %.

Die Verwaltung der Anleiheninvestitionen des Fonds trug zu dieser Rendite bei.

In der ersten Jahreshälfte 2023 waren die Märkte von Volatilität gekennzeichnet, da sich die Anleger um die hartnäckig hohe Inflation sorgten. Die Auswahl von Unternehmensanleihen durch die Verwaltungsgesellschaft kam den Fondserträgen in diesem Berichtszeitraum zugute. Allerdings wurden diese positiven Effekte durch

FESTVERZINSLICHE Forts.

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND Forts.

die Auswirkungen der Sektorgewichtungen im Fonds zunichtegemacht.

Im dritten Quartal des Jahres mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aus Angst vor weiteren potenziellen Zinserhöhungen durch die Zentralbanken. In diesem Berichtszeitraum war der Fonds in Versorgern stärker gewichtet als der Referenzwert. Dies steigerte die Fondsrendite. Einige der anderen Fondsbeteiligungen verloren jedoch an Boden.

Später, als die Inflation den Rückzug antrat, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung auf Zinssenkungen. Die Verwaltungsgesellschaft baute neue Positionen in Anleihen von Banken und Versorgungsunternehmen auf. Insgesamt trug die Auswahl von Unternehmensanleihen positiv zur Rendite bei, vor allem im Oktober und November.

Die Verwaltungsgesellschaft hielt sich an die Verpflichtung des Fonds zu verantwortungsbewusstem Investieren und Nachhaltigkeit. Sie sorgte dafür, dass der Fonds eine niedrigere Kohlenstoffintensität auswies als der Referenzwert.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

RESPONSIBLE HORIZONS EURO IMPACT BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 8,76 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 8,40 % für den Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Green Bond Index, jeweils in Euro.

Die Fondserträge wurden durch die von der Verwaltungsgesellschaft getroffene Auswahl grüner Unternehmensanleihen begünstigt. Diese Anleihen sind eine wichtige Finanzierungsquelle für Umweltprojekte.

In der ersten Jahreshälfte waren die Märkte aufgrund wachsender Sorgen über eine hohe Inflation sehr volatil. In diesem Zeitraum steigerten einige der im Fonds gehaltenen grünen Anleihen den Ertrag, insbesondere im europäischen Bankensektor.

Im dritten Quartal mieden die Anleger risikoreichere Anlagen aufgrund der Sorge, dass die Zentralbanken weitere Zinserhöhungen vornehmen könnten. In diesem Zeitraum wurde die Fondsrendite dadurch belastet, dass Anleihen von Immobilienunternehmen im Fonds nicht so stark gewichtet waren wie im Referenzwert. Diese Anleihen entwickelten sich im Herbst gut.

Später im Jahresverlauf, als die Inflation nachgab, erwachte unter den Anlegern die Hoffnung, dass die Zinssätze 2024 gesenkt werden würden. Die Verwaltungsgesellschaft baute neue Positionen im europäischen Versorgungssektor und in Immobilienunternehmen auf. Insgesamt leisteten die Unternehmensanleihen des Fonds positive Beiträge zur Rendite. Die besten Renditen erzielten hier Banken, ein Versorgungsunternehmen und eine Unternehmensberatung.

Die Verwaltungsgesellschaft hielt sich an die Verpflichtung des Fonds, eine positive Auswirkung auf die Umwelt zu erreichen. Viele der Fondsinvestitionen entfallen auf grüne Anleihen von Unternehmen, die erneuerbare Energiequellen, weniger kohlenstoffintensive Transportmittel sowie energiesparende Produkte und Dienstleistungen anbieten.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2024

MULTI-ASSET

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 0,32 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR +4 % p.a. eine Rendite von 7,29 %, jeweils in Euro.

Den größten Beitrag leisteten die „renditeorientierten Anlagen“ des Fonds (Beteiligungen an Unternehmensaktien und -anleihen sowie an alternativen Anlagen). Innerhalb dieses Bereichs leisteten Aktien (oder Unternehmensanteile) einen wichtigen Beitrag zur Wertentwicklung. Die US-Technologiewerte des Fonds, insbesondere diejenigen, die sich mit künstlicher Intelligenz befassen, verbuchten eine besonders gute Performance. Andererseits wurden die Erträge durch Öl- und Gasaktien geschmälert.

Staatsanleihen aus Schwellenländern wie Brasilien und Mexiko verbuchten eine starke Wertentwicklung. Von Unternehmen begebene Anleihen, insbesondere von Banken, brachten ebenfalls einen gewissen Mehrwert.

Die „stabilisierenden Vermögenswerte“ des Fonds (die stabile Erträge aus weniger risikoreichen Anlagen wie Staatsanleihen anstreben) führten zu Wertabzügen. Investitionen, die in der Absicht getätigt wurden, den Fonds während allgemeiner Marktrückgänge zu schützen, verzeichneten eine Underperformance. Das Engagement des Fonds in Gold wirkte sich allerdings positiv auf die Renditen aus, da der Preis für das Edelmetall gegen Jahresende auf ein Allzeithoch kletterte.

Die Verwaltungsgesellschaft nahm Gewinne aus bestimmten ausländischen Anleihen mit niedriger Bonität mit, die eine gute Performance vorgelegt hatten. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die Gewichtung einiger ausländischer Anleihen mit höherem Investment-Grade-Rating. Ein großer Teil des eingeworbenen Kapitals wurde verwendet, um von Schwellenländern begebene Staatsanleihen zu erwerben.

Die Verwaltungsgesellschaft kaufte auch Staatsanleihen mit kurzen Laufzeiten aus den USA und dem Vereinigten Königreich und verkaufte einige Staatsanleihen mit längeren Laufzeiten.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Die Anteilsklasse Sterling C (Inc.) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 1,07 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der SONIA (30 Tage aufgezinst) +4 % ein Plus von 8,70 %, beide in Pfund Sterling.

Den größten Beitrag leisteten die „renditeorientierten Anlagen“ des Fonds (Beteiligungen an Unternehmensaktien und -anleihen sowie an alternativen Anlagen). Innerhalb dieses Bereichs leisteten Aktien (oder Unternehmensanteile) einen wichtigen Beitrag zur Wertentwicklung. Die US-Technologiewerte des Fonds, insbesondere diejenigen, die sich mit künstlicher Intelligenz befassen, verbuchten eine besonders gute Performance. Andererseits wurden die Erträge durch Öl- und Gasaktien geschmälert.

Staatsanleihen aus Schwellenländern wie Brasilien und Mexiko verbuchten eine starke Wertentwicklung.

Alternative Investitionen hinkten etwas hinterher, weil Anlagen im Bereich der Energiespeicherung und -effizienz im Jahr 2023 nicht besonders gut abschnitten.

Die „stabilisierenden Vermögenswerte“ des Fonds (die stabile Erträge aus weniger risikoreichen Anlagen wie Staatsanleihen anstreben) führten zu Wertabzügen. Investitionen, die in der Absicht getätigt wurden, den Fonds während allgemeiner Marktrückgänge zu schützen, verzeichneten eine Underperformance. Das Engagement des Fonds in Gold wirkte sich allerdings positiv auf die Renditen aus, da der Preis für das Edelmetall gegen Jahresende auf ein Allzeithoch kletterte.

Die Verwaltungsgesellschaft nahm Gewinne aus ausländischen Anleihen mit niedriger Bonität mit, die eine gute Performance vorgelegt hatten. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die Gewichtung einiger ausländischer Anleihen mit höherem Investment-Grade-Rating. Ein großer Teil des eingeworbenen Kapitals wurde verwendet, um von Schwellenländern begebene Staatsanleihen zu erwerben.

Die Verwaltungsgesellschaft kaufte auch Staatsanleihen mit kurzen Laufzeiten aus den USA und dem Vereinigten Königreich und verkaufte einige Staatsanleihen mit längeren Laufzeiten.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 2,06 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 9,08 % für den SOFR (30 Tage aufgezinst) +4%, jeweils in US-Dollar.

Den größten Beitrag leisteten die „renditeorientierten Anlagen“ des Fonds (Beteiligungen an Unternehmensaktien und -anleihen sowie an alternativen Anlagen). Innerhalb dieses Bereichs leisteten Aktien (oder Unternehmensanteile) einen wichtigen Beitrag zur Wertentwicklung. Die US-Technologiewerte des Fonds, insbesondere diejenigen, die sich mit künstlicher Intelligenz befassen, verbuchten eine besonders gute Performance. Andererseits wurden die Erträge durch Öl- und Gasaktien geschmälert.

Staatsanleihen aus Schwellenländern wie Brasilien und Mexiko verbuchten eine starke Wertentwicklung. Anleihen von Unternehmen, insbesondere von Banken, wirkten ebenfalls wertsteigernd.

Die „stabilisierenden Vermögenswerte“ des Fonds (die stabile Erträge aus weniger risikoreichen Anlagen wie Staatsanleihen anstreben) führten zu Wertabzügen. Investitionen, die in der Absicht getätigt wurden, den Fonds während allgemeiner Marktrückgänge zu schützen, verzeichneten eine Underperformance. Das Engagement des Fonds in Gold wirkte sich allerdings positiv auf die Renditen aus, da der Preis für das Edelmetall gegen Jahresende auf ein Allzeithoch kletterte.

Die Verwaltungsgesellschaft nahm Gewinne aus bestimmten ausländischen Anleihen mit niedriger Bonität mit, die eine gute Performance vorgelegt hatten. Die Verwaltungsgesellschaft reduzierte die Gewichtung einiger ausländischer Anleihen mit höherem Investment-Grade-Rating. Ein großer Teil des eingeworbenen Kapitals wurde verwendet, um von Schwellenländern begebene Staatsanleihen zu erwerben.

Die Verwaltungsgesellschaft erhöhte ebenfalls das Engagement des Fonds bei US-Staatsanleihen deutlich.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 12,70 %

MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND Forts.

nach Abzug von Gebühren, während sein Referenzwert, der MSCI AC World NR Index (60 %)/JP Morgan Global GBI Unhedged TR Index (40 %), -14,75 % verbuchte, jeweils in US-Dollar.

Die Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft, Unternehmensaktien gegenüber Anleihen den Vorzug zu geben, trug zu einer positiven Rendite bei, da diese Papiere Ende 2023 deutlich besser abschnitten als Anleihen.

Die Auswahl der Sektoren, in die der Fonds investiert, war ein weiterer Pluspunkt. Die Tatsache, dass der Fonds weniger Aktien aus dem Sektor Basiskonsumgüter hielt als die Benchmark war hilfreich. Darüber hinaus vermied die Verwaltungsgesellschaft Energietitel. Das erwies sich als gute Entscheidung, da diese Unternehmen gegen Ende des Jahres im Zuge fallender Ölpreise schlechter abschnitten als der breitere Aktienmarkt.

Die meisten Anleihenbestände des Fonds stammten aus Ländern außerhalb des Vereinigten Königreichs. Bestimmte einzelne Anleihen bewirkten eine Wertsteigerung.

Die Aktienausswahl der Verwaltungsgesellschaft hatte insgesamt einen negativen Effekt auf die Rendite. Aktien, die an europäischen Märkten und im Vereinigten Königreich notiert sind, waren nicht hilfreich. Die Beteiligungen des Fonds im Finanz- und im Technologiesektor schnitten schlecht ab. In mehreren US-Technologiewerten, die sich 2023 sehr gut entwickelten, war der Fonds nicht engagiert.

Der Umstand, dass der Fonds im Vergleich zum Index weniger Aktien und Anleihen aus den USA hielt, wirkte ebenfalls ertragsschmälernd.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -1,02 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des Referenzwerts, des 1-Monats-EURIBOR +4% bei 7,29 %.

Bestimmte Investitionen, die dem Schutz des Fonds vor schwachen Aktienkursen dienen sollten, schmälerten die Erträge, da die Aktienmärkte im Berichtszeitraum zulegten und die positiven Renditen aus dem renditeorientierten Kernbereich des Fonds zunichtegemacht wurden. Im Jahresverlauf führte dies zu einer Negativrendite für den Fonds.

Alternative Investitionen belasteten die Wertentwicklung, insbesondere die Beteiligungen an einigen Unternehmen im Bereich der erneuerbaren Energien. Diese beeinträchtigten die Renditen, da die aktuellen Handelsdaten auf schwierige Bedingungen auf dem Wohnungsmarkt hinwiesen. Hier war die Nachfrage nach sauberer Energie nicht so stark gestiegen wie erwartet.

Die wichtigste positive Antriebskraft für die Fondsperformance war das Aktienengagement. Beteiligungen an US-Unternehmen, die eng mit Fortschritten in der künstlichen Intelligenz im Zusammenhang stehen, verzeichneten eine besonders gute Performance.

Der Fonds hielt Aktien eines führenden US-Pharmaunternehmens, das an Medikamenten zur Behandlung von Diabetes und Fettleibigkeit arbeitet, was die Renditen ebenfalls aufbesserte.

Ansonsten trugen die vom Fonds gehaltenen Anleihen aus Schwellenmärkten positiv zur Rendite bei.

Newton Investment Management Limited
Januar 2024

Alle Daten von Lipper, Stand: 31. Dezember 2023. 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.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Definitionen der in den Berichten der Anlageverwalter verwendeten Finanzbegriffe finden Sie online im Glossar auf <https://www.bnymellonim.com/glossary/>.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 19.514.034			
(31. Dezember 2022: 23.778.339)			
1.950.000	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Bond Fund^	1.973.400	0,68
13.668.492	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund^	17.540.634	6,01
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		19.514.034	6,69
Anleihen			
Australien - 12.907.406			
(31. Dezember 2022: 23.389.985)			
467.286	AFG 2021-2 Trust '2021-2 B' FRN 5.590% 10-Mar-2053	285.158	0,10
1.271.744	Firstmac Mortgage Funding Trust No. 4 Series 2-2020 '2020-2 A2' FRN 6.202% 16-Jan-2052	786.645	0,27
284.438	Flexi ABS Trust 2021-2 '2021-2 C' FRN 5.804% 12-Aug-2027	172.794	0,06
222.151	Latitude Australia Personal Loans Series 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 5.752% 17-Apr-2030	135.357	0,05
561.680	Liberty Series 2021-1 SME '2021-1SME C' FRN 6.190% 10-Nov-2053	335.700	0,11
1.532.621	Liberty Series 2022-1 '2022-1 A1' FRN 5.240% 10-Dec-2053	938.954	0,32
2.000.000	Mortgage House RMBS Series 2022-2 '2022-2 A2' FRN 6.295% 14-Dec-2053	1.238.451	0,42
499.460	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 6.352% 22-Jan-2053	305.690	0,10
2.384.343	Pepper I-Prime 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 5.698% 15-Jul-2053	1.453.731	0,50
1.703.186	Pepper Residential Securities Trust No 34 FRN 6.054% 12-Dec-2063	1.052.113	0,36
857.029	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 6.098% 15-Jan-2063	520.934	0,18
165.853	Pepper Residential Securities Trust No. 31 FRN 5.508% 23-Apr-2063	101.507	0,03
643.780	Pepper Residential Securities Trust No32 FRN 6.208% 23-Jul-2063	397.059	0,14
990.470	Resimac Bastille Trust Series 2021-2NC '2021-2NCX C' FRN 6.041% 03-Feb-2053	603.143	0,21
640.423	Ruby Bond Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 5.804% 12-Mar-2053	389.521	0,13
712.777	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 6.298% 15-Jun-2052	437.320	0,15
770.000	Think Tank Residential Series 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 6.040% 10-Mar-2054	467.936	0,16
1.521.141	Think Tank Residential Series 2022-2 '2022-2 A2' FRN 6.690% 10-Jun-2054	943.261	0,32
810.000	Triton Bond Trust 2022-1 in respect of Series 1 '2022-1 C' FRN 6.040% 11-Sep-2053	485.472	0,17
3.000.000	Triton Bond Trust 2022-3 in respect of Series 1 '2022-3 A2' FRN 6.190% 10-Apr-2054	1.856.660	0,64
Österreich - 6.640.648			
(31. Dezember 2022: 5.105.379)			
2.200.000	Erste Group Bank AG FRN (Perpetual) 4.250% 15-Oct-2027	1.890.240	0,65
1.800.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	1.628.190	0,56
1.500.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	1.586.250	0,54
1.600.000	Raiffeisen Bank International AG FRN (Perpetual) 8.659% 15-Jun-2024	1.535.968	0,53
Belgien - 554.400			
(31. Dezember 2022: 1.105.572)			
600.000	KBC Group NV FRN (Perpetual) 4.250% 24-Oct-2025	554.400	0,19
Bermudas - 2.440.640			
(31. Dezember 2022: -)			
1.762.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	1.825.732	0,63
725.000	SiriusPoint Ltd 'REGS' 4.600% 01-Nov-2026	614.908	0,21

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Brasilien - 2.528.936			
(31. Dezember 2022: 4.256.539)			
10.772.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	2.003.982	0,69
2.826.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	524.954	0,18
Kanada - 3.277.253			
(31. Dezember 2022: -)			
1.300.000	Bank of Montreal FRN (Perpetual) 4.800% 25-Aug-2024	1.131.132	0,39
2.583.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.625% 27-Oct-2081	1.791.651	0,61
380.000	GFL Environmental Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2031	354.470	0,12
Chile - 389.656			
(31. Dezember 2022: 112.248)			
270.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	265.964	0,09
115.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 6.000% 01-Apr-2033	123.692	0,04
China - 492.366			
(31. Dezember 2022: 665.638)			
900.000	China Government Bond 3.020% 27-May-2031	118.255	0,04
2.800.000	China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030	374.111	0,13
Kolumbien - 1.890.807			
(31. Dezember 2022: 1.557.012)			
475.000	Banco GNB Sudameris SA 'REGS' FRN 7.500% 16-Apr-2031	359.927	0,12
880.500.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	181.378	0,06
2.349.600.000	Colombian TES 7.250% 18-Oct-2034	451.834	0,16
2.100.000.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	447.085	0,15
2.233.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	450.583	0,16
Zypern - 2.264.281			
(31. Dezember 2022: 207.715)			
2.198.000	Bank of Cyprus Pcl 'EMTN' FRN 7.375% 25-Jul-2028	2.264.281	0,78
Tschechische Republik - 482.654			
(31. Dezember 2022: -)			
5.020.000	Czech Republic Government Bond 4.500% 11-Nov-2032	214.958	0,07
6.100.000	Czech Republic Government Bond 5.500% 12-Dec-2028	267.696	0,09
Ecuador - 162.379			
(31. Dezember 2022: 162.493)			
355.402	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2040	102.671	0,03
142.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 6.000% 31-Jul-2030	59.708	0,02
Frankreich - 13.346.528			
(31. Dezember 2022: 9.017.822)			
600.000	BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042	545.556	0,19
600.000	BPCE SA FRN 2.125% 13-Oct-2046	489.912	0,17
2.020.000	BPCE SA 'REGS' FRN 7.003% 19-Oct-2034	1.987.595	0,68
200.000	Carrefour SA (Zero Coupon) 0.000% 27-Mar-2024	177.977	0,06
1.500.000	CNP Assurances SACA FRN (Perpetual) 2.650% 21-Mar-2024	1.214.250	0,42
1.000.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Dec-2027	891.940	0,31
162.801	Safran SA (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2028	306.041	0,10
2.710.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 4.750% 26-May-2026	2.155.175	0,74
1.400.000	Sogecap SA FRN 6.500% 16-May-2044	1.528.268	0,52
2.300.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	2.549.079	0,87
2.440.000	WEA Finance LLC '144A' 4.625% 20-Sep-2048	1.500.735	0,51

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Deutschland - 12.595.542			
	(31. Dezember 2022: 113.031.554)	12.595.542	4,32
161.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.625% 06-Nov-2030	149.588	0,05
465.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.875% 24-May-2030	440.464	0,15
870.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 2.750% 19-Mar-2029	874.207	0,30
296.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 3.250% 19-May-2033	305.862	0,11
100.000	Deutsche Post AG 0.050% 30-Jun-2025	97.950	0,03
2.000.000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 6.538% 31-Jan-2028	1.626.460	0,56
1.200.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	1.257.942	0,43
600.000	Sartorius Finance BV 4.875% 14-Sep-2035	637.821	0,22
3.400.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	3.536.646	1,21
1.500.000	Vonovia Finance BV 2.250% 07-Apr-2030	1.351.215	0,46
2.100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029	1.734.934	0,60
700.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	582.453	0,20
Griechenland - 1.842.314			
	(31. Dezember 2022: -)	1.842.314	0,63
1.754.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	1.842.314	0,63
Ungarn - 943.260			
	(31. Dezember 2022: 713.401)	943.260	0,32
139.800.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	313.568	0,11
110.500.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	203.382	0,07
82.220.000	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	205.095	0,07
207.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	221.215	0,07
Indonesien - 704.164			
	(31. Dezember 2022: 483.078)	704.164	0,24
10.700.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	704.164	0,24
Irland - 8.325.642			
	(31. Dezember 2022: 12.301.125)	8.325.642	2,85
390.994	Atom Mortgage Securities DAC FRN 6.570% 22-Jul-2031	405.078	0,14
181.389	Berg Finance 2021 DAC '2021-1 B' FRN 5.452% 22-Apr-2033	168.165	0,06
28.183	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 6.876% 24-Feb-2058	27.993	0,01
278.300	Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC FRN 5.344% 18-Oct-2030	278.789	0,10
611.696	Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC FRN 5.394% 17-Aug-2033	577.180	0,20
137.972	Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 5.594% 17-Aug-2031	131.016	0,04
2.496.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	2.366.882	0,81
951.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	1.006.453	0,34
400.722	Rathlin Residential 2021-1 DAC '2021-1X A' FRN 5.818% 27-Sep-2075	393.592	0,13
28.663	Retiro Mortgage Securities DAC FRN 5.000% 30-Jul-2075	28.628	0,01
131.038	Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 6.871% 17-May-2031	144.352	0,05
422.753	Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 5.716% 22-Dec-2030	405.409	0,14
780.011	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 6.971% 17-Aug-2031	857.518	0,29
1.400.000	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 6.420% 22-Jul-2029	1.534.587	0,53
Israel - 195.403			
	(31. Dezember 2022: -)	195.403	0,07
200.000	Israel Government International Bond 'EMTN' 6.500% 06-Nov-2031	195.403	0,07

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Italien - 3.467.075			
	(31. Dezember 2022: 1.302.888)	3.467.075	1,19
850.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	878.229	0,30
2.352.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	2.483.950	0,85
100.000	Eni SpA 2.950% 14-Sep-2030	104.896	0,04
Japan - 8.468.025			
	(31. Dezember 2022: 4.939.153)	8.468.025	2,90
681.000.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051	3.442.141	1,18
879.850.000	Japan Government Thirty Year Bond 1.200% 20-Jun-2053	5.025.884	1,72
Luxemburg - 2.994.758			
	(31. Dezember 2022: 165.947)	2.994.758	1,03
1.812.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	1.404.479	0,48
193.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 17-Jan-2030	165.470	0,06
377.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 2.000% 17-Jan-2034	295.114	0,10
252.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	239.557	0,08
889.000	SELP Finance Sarl 'EMTN' 3.750% 10-Aug-2027	890.138	0,31
Mexiko - 5.004.432			
	(31. Dezember 2022: 4.936.691)	5.004.432	1,71
100.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 2.625% 24-Feb-2026	100.175	0,03
35.000.000	Mexican Bonos 5.000% 06-Mar-2025	1.769.126	0,61
32.771.500	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	1.614.797	0,55
4.500.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	223.693	0,08
8.800.000	Mexican Bonos 8.000% 31-Jul-2053	418.778	0,14
8.500.000	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	433.503	0,15
4.900.000	Mexican Bonos 10.000% 05-Dec-2024	259.828	0,09
254.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	184.532	0,06
Niederlande - 10.835.705			
	(31. Dezember 2022: 8.503.785)	10.835.705	3,71
400.000	ABN AMRO Bank NV FRN (Perpetual) 4.750% 22-Sep-2027	365.700	0,12
445.000	ASR Nederland NV 3.625% 12-Dec-2028	452.428	0,15
3.770.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	3.373.208	1,16
325.000	Athora Netherlands NV FRN (Perpetual) 7.000% 19-Jun-2025	318.338	0,11
4.000.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN (Perpetual) 3.250% 29-Dec-2026	3.577.000	1,23
460.000	ING Groep NV FRN 6.114% 11-Sep-2034	436.017	0,15
495.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 3.875% 16-May-2027	364.469	0,12
1.935.000	LeasePlan Corp NV FRN (Perpetual) 7.375% 29-May-2024	1.948.545	0,67
Neuseeland - 14.433.881			
	(31. Dezember 2022: 11.547.416)	14.433.881	4,95
15.960.000	New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	8.545.741	2,93
2.000.000	New Zealand Government Bond 4.250% 15-May-2034	1.130.378	0,39
8.418.000	New Zealand Government Bond 4.250% 15-May-2034	4.757.762	1,63
Peru - 256.479			
	(31. Dezember 2022: -)	256.479	0,09
400.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	256.479	0,09
Polen - 2.618.181			
	(31. Dezember 2022: -)	2.618.181	0,90
2.000.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	2.110.500	0,72
2.000.000	Republic of Poland Government Bond 7.500% 25-Jul-2028	507.681	0,18

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
	Portugal - 2.664.984			
	(31. Dezember 2022: -)	2.664.984	0,91	
2.400.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	2.664.984	0,91	
	Puerto Rico - 95.829			
	(31. Dezember 2022: -)	95.829	0,03	
110.000	Liberty Latin America Ltd 2.000% 15-Jul-2024	95.829	0,03	
	Republik Korea - 7.729.501			
	(31. Dezember 2022: 7.387.300)	7.729.501	2,65	
10.140.000.000	Korea Treasury Bond 3.250% 10-Mar-2053	7.418.822	2,54	
437.500.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	310.679	0,11	
	Rumänien - 497.130			
	(31. Dezember 2022: 955.876)	497.130	0,17	
2.500.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	497.130	0,17	
	Russland - 208.906			
	(31. Dezember 2022: 189.783)	208.906	0,07	
45.400.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026	208.906	0,07	
	Südafrika - 1.420.363			
	(31. Dezember 2022: 2.567.414)	1.420.363	0,49	
19.583.458	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	881.687	0,30	
5.100.000	Republic of South Africa Government Bond 8.250% 31-Mar-2032	217.967	0,08	
7.767.575	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	320.709	0,11	
	Spanien - 10.118.954			
	(31. Dezember 2022: 4.472.390)	10.118.954	3,47	
3.400.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	3.167.338	1,09	
1.600.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	1.680.832	0,58	
1.600.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 3.625% 21-Mar-2029	1.196.720	0,41	
400.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.375% 14-Jan-2026	368.596	0,13	
1.600.000	CaixaBank SA FRN (Perpetual) 3.625% 14-Sep-2028	1.238.000	0,42	
1.700.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	1.495.312	0,51	
1.200.000	Unicaja Banco SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Nov-2026	972.156	0,33	
	Supranational - 167.024			
	(31. Dezember 2022: -)	167.024	0,06	
200.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026	167.024	0,06	
	Schweden - 168.444			
	(31. Dezember 2022: -)	168.444	0,06	
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	168.444	0,06	
	Schweiz - 5.398.111			
	(31. Dezember 2022: 4.462.573)	5.398.111	1,85	
400.000	UBS Group AG '144A' FRN (Perpetual) 9.250% 13-Nov-2033	400.682	0,14	
5.315.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	4.997.429	1,71	
	Thailand - 368.237			
	(31. Dezember 2022: -)	368.237	0,13	
15.111.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	368.237	0,13	
	Türkei - 544.075			
	(31. Dezember 2022: -)	544.075	0,19	
10.675.000	Türkiye Government Bond 12.600% 01-Oct-2025	232.365	0,08	
2.258.560	Türkiye Government Bond 26.200% 05-Oct-2033	72.038	0,03	
7.094.000	Türkiye Government Bond 31.080% 08-Nov-2028	239.672	0,08	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
	Vereinigte Arabische Emirate - 176.452			
	(31. Dezember 2022: -)	176.452	0,06	
200.000	Abu Dhabi National Oil Co 0.700% 04-Jun-2024	176.452	0,06	
	Vereinigtes Königreich - 32.298.676			
	(31. Dezember 2022: 17.811.687)	32.298.676	11,07	
2.082.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 8.450% 31-Jan-2028	2.517.733	0,86	
448.932	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 5.579% 17-Mar-2039	483.637	0,17	
424.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 6.720% 25-Jul-2058	488.036	0,17	
1.900.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 4.375% 15-Mar-2028	1.341.221	0,46	
235.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 6.375% 15-Dec-2025	258.931	0,09	
1.836.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	1.649.279	0,56	
700.000	Chesnara Plc 4.750% 04-Aug-2032	594.737	0,20	
798.000	Co-operative Bank Holdings Ltd/The FRN 6.000% 06-Apr-2027	893.834	0,31	
305.000	Direct Line Insurance Group Plc FRN (Perpetual) 4.750% 07-Dec-2027	275.562	0,09	
225.508	Eurosail 2006-1 Plc '2006-1X B1A' FRN 4.219% 10-Jun-2044	224.531	0,08	
2.079.000	Greene King Finance Plc FRN 7.386% 15-Mar-2036	1.922.453	0,66	
880.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	934.195	0,32	
3.518.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.856% 23-May-2033	3.754.269	1,29	
981.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	1.020.672	0,35	
2.846.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	2.958.673	1,01	
1.023.198	Landmark Mortgage Securities No 1 Plc FRN 4.532% 17-Jun-2038	1.004.301	0,34	
737.800	Marston's Issuer Plc FRN 6.659% 15-Oct-2027	800.336	0,27	
3.250.000	National Grid Plc 'EMTN' 0.750% 01-Sep-2033	2.494.960	0,85	
523.000	Newday Funding Master Issuer PLC - Series 2021-2 6.847% 15-Jul-2029	599.616	0,21	
500.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-3 '2021-3X C' FRN 6.947% 15-Nov-2029	568.290	0,19	
466.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 8.250% 06-Nov-2028	578.561	0,20	
384.269	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS2X B1C' FRN 4.780% 12-Jun-2044	351.991	0,12	
425.220	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS3X M1C' FRN 4.190% 12-Jun-2044	400.015	0,14	
3.435.000	Rothesay Life Plc FRN (Perpetual) 4.875% 13-Apr-2027	2.504.837	0,86	
159.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 7.600% 23-Jan-2029	174.786	0,06	
386.000	Stratton Mortgage Funding 2021-3 Plc '2021-3 D' FRN 6.820% 12-Dec-2043	440.537	0,15	
496.000	SW Finance I Plc 7.375% 12-Dec-2041	610.945	0,21	
357.000	Thames Water Utilities Finance Plc 8.250% 25-Apr-2040	463.906	0,16	
148.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 1.250% 31-Jan-2032	112.151	0,04	
297.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	282.046	0,10	
883.985	Together Asset Backed Securitisation 2021-CRE1 Plc '2021-CRE1 A' FRN 6.598% 20-Jan-2055	1.012.709	0,35	
656.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	580.926	0,20	
	Vereinigte Staaten von Amerika - 39.601.940			
	(31. Dezember 2022: 5.618.012)	39.601.940	13,57	
890.000	3M Co 'MTN' 1.500% 02-Jun-2031	759.060	0,26	
70.000	Airbnb Inc (Zero Coupon) 0.000% 15-Mar-2026	56.994	0,02	
150.000	American Water Capital Corp '144A' 3.625% 15-Jun-2026	136.161	0,05	
552.000	Bristol-Myers Squibb Co 6.250% 15-Nov-2053	574.268	0,20	
580.000	Bristol-Myers Squibb Co 6.400% 15-Nov-2063	612.310	0,21	
2.325.000	Capital One Financial Corp FRN 7.624% 30-Oct-2031	2.304.645	0,79	
1.648.000	Corebridge Financial Inc 5.750% 15-Jan-2034	1.531.158	0,52	
1.024.000	CVS Health Corp 5.875% 01-Jun-2053	980.831	0,34	
688.000	Energy Transfer LP 6.400% 01-Dec-2030	665.879	0,23	
635.000	Energy Transfer LP 6.550% 01-Dec-2033	623.925	0,21	
150.000	Ford Motor Co (Zero Coupon) 0.000% 15-Mar-2026	135.836	0,05	
884.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350% 06-Mar-2030	857.708	0,29	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
491.000	Honeywell International Inc 3.750% 17-May-2032	512.850	0,18
1.243.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	1.330.631	0,46
437.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 5.450% 15-Aug-2030	398.207	0,14
144.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 5.500% 15-Aug-2033	130.196	0,04
4.030.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	3.709.753	1,27
200.000	JPMorgan Chase Bank NA (Zero Coupon) 0.000% 18-Feb-2024	221.160	0,08
3.500.000	Linde Plc 3.625% 12-Jun-2034	3.665.568	1,26
519.000	Norfolk Southern Corp 5.950% 15-Mar-2064	526.862	0,18
3.771.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	3.506.883	1,20
2.670.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 5.939% 18-Aug-2034	2.513.749	0,86
904.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.037% 28-Oct-2033	855.616	0,29
2.437.000	Ryder System Inc 6.600% 01-Dec-2033	2.445.832	0,84
819.000	Tapestry Inc 7.850% 27-Nov-2033	791.048	0,27
998.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.122% 26-Jan-2034	875.589	0,30
1.416.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.867% 08-Jun-2034	1.308.373	0,45
235.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	220.746	0,07
390.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 7.161% 30-Oct-2029	379.850	0,13
2.075.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	1.843.267	0,63
1.925.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	1.703.554	0,58
850.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Jul-2024	747.657	0,26
1.477.000	US Bancorp FRN 5.836% 12-Jun-2034	1.378.154	0,47
1.236.000	US Bancorp FRN 5.850% 21-Oct-2033	1.153.335	0,39
150.000	Ventas Realty LP '144A' 3.750% 01-Jun-2026	144.285	0,05
Gesamtanlagen in Anleihen		221.521.441	75,92
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)			
Frankreich - 1.687.505			
(31. Dezember 2022: 1.634.626)		1.687.505	0,58
700.000	Emeria S.A.S. FRN Term Loan 9.166% 27-Mar-2028	692.500	0,24
1.000.000	Odyssey Investment BidCo Circet Europe Term Loan 7.222% 09-Jul-2028	995.005	0,34
Luxemburg - 1.004.380			
(31. Dezember 2022: 1.365.345)		1.004.380	0,34
1.000.000	Albion Financing 3 S.a r.l. (Albion Financing LLC) 2023-B Incremental Euro Term Loan 9.252% 16-Aug-2026	1.004.380	0,34
Niederlande - 3.691.116			
(31. Dezember 2022: 4.777.175)		3.691.116	1,27
700.000	Kouti B.V. Term Loan 8.705% 31-Aug-2028	703.721	0,24
1.000.000	PEARLS (Netherlands) Bidco B.V. - Caldic BV EUR Term Loan 7.448% 26-Feb-2029	987.500	0,34
1.000.000	Pegasus Bidco B.V. Refresco EUR Term Loan 8.252% 05-May-2029	1.004.890	0,35
1.000.000	UPC Broadband Holding B.V. Term Loan 6.833% 31-Jan-2029	995.005	0,34
Schweden - 1.000.965			
(31. Dezember 2022: 951.250)		1.000.965	0,34
1.000.000	Verisure Holding AB Term Loan 6.969% 09-Jul-2026	1.000.965	0,34
Vereinigtes Königreich - 6.523.088			
(31. Dezember 2022: 7.107.242)		6.523.088	2,24
1.000.000	CD&R Firefly Bidco Ltd Term Loan 11.293% 21-Jun-2028	1.132.064	0,39
1.000.000	Eagle Bidco Limited Term Loan 9.969% 31-Jan-2029	1.099.888	0,38
1.000.000	IVC Acquisition Ltd Term Loan 11.214% 17-Nov-2028	1.141.131	0,39

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
1.146.800	Platform Bidco Ltd Term Loan 8.136% 29-Sep-2028	1.091.100	0,37
844.265	TC Funding I Limited Term Loan 8.938% 21-Jan-2026	921.583	0,32
1.000.000	Zephyr Bidco Limited Term Loan 11.187% 31-Jul-2028	1.137.322	0,39
Vereinigte Staaten von Amerika - 3.334.651		3.334.651	1,14
(31. Dezember 2022: 2.916.818)		3.334.651	1,14
1.858.750	Virgin Media SFA Finance Ltd Term Loan 8.470% 10-Nov-2027	2.125.279	0,73
1.200.000	Windsor Holdings III LLC Term Loan 8.368% 21-Jun-2030	1.209.372	0,41
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		17.241.705	5,91
Total Return Swaps			
Europa - 492.970 (31. Dezember 2022: -)		492.970	0,17
25.000.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	488.747	0,17
2.500.000	Markit iBoxx EUR Contingent Convertible Liquid Developed Markets AT1 Index 20-Mar-2024	4.223	0,00
Total Return Swaps insgesamt		492.970	0,17
Credit Default Swaps - 1.367.500			
(31. Dezember 2022: 1.585.390)			
1.910.000	CDS Apache Corporation 1.000% 20-Dec-2028	28.809	0,01
(1.840.000)	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	323.338	0,11
1.220.000	CDS Intesa SanPaolo SpA 1.000% 20-Dec-2028	43.129	0,02
390.000	CDS Intesa SanPaolo SpA 1.000% 20-Dec-2028	13.787	0,00
1.840.000	CDS M.D.C. Holdings Inc 1.000% 20-Dec-2028	11.426	0,00
1.390.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2028	36.460	0,01
450.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2028	11.804	0,00
1.460.000	CDS Unicredit SpA 1.000% 20-Dec-2028	44.550	0,02
470.000	CDS Unicredit SpA 1.000% 20-Dec-2028	14.341	0,01
(850.000)	CDS UPC Holding BV 5.000% 20-Dec-2028	54.086	0,02
(2.670.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2028	27.643	0,01
(1.630.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2028	110.707	0,04
(1.550.000)	CDS Ziggo Bond Company B.V. 5.000% 20-Dec-2028	71.854	0,02
(3.217.500)	CDX North American High Yield Index Series 41 Version 2 5.000% 20-Dec-2028	171.515	0,06
(50.000.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Jun-2024	197.514	0,07
(11.600.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	206.537	0,07
Credit Default Swaps insgesamt		1.367.500	0,47
Währungsoptionen - 18.023			
(31. Dezember 2022: -)			
1.235.000	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 159.350	250	0,00
624.000	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 185.200	1	0,00
(624.000)	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 188.000	-	0,00
1.202.000	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 149.100	277	0,00
353.026.500	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 141.700	17.495	0,01
Währungsoptionen insgesamt		18.023	0,01
Zinsswaps - 5.402.639			
(31. Dezember 2022: 307.210)			
11.800.000	IRS Pay 104.301231 Receive 1T USD Index 01-Jul-2052	211.866	0,07
4.965.000.000	IRS Receive 1 Year JPY TONA-OIS-Compound Pay Fixed 0.900% 01-Nov-2030	606.377	0,21
5.290.000	IRS Receive 1T EUR Index Pay 122.389003 01-Jun-2053	419.841	0,14
5.100.000	IRS Receive 1T EUR Index Pay 122.389003 03-May-2052	103.081	0,04
5.440.000	IRS Receive 1T EUR Index Pay 127.645149 25-May-2053	586.034	0,20
267.680.000	IRS Receive 3 Month SEK STIBOR Pay Fixed 3.696% 03-Oct-2028	1.382.822	0,47
24.000.000	IRS Receive 6 Month AUD BBR-BBSW Pay Fixed 5.017% 03-Nov-2033	999.160	0,34

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Zinsswaps Forts.			
57.010.000	IRS Receive 6 Month EUR EURIBOR Pay Fixed 2.950% 08-Feb-2028	1.093.458	0,38
Zinsswaps insgesamt		5.402.639	1,85

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 3.012.146 (31. Dezember 2022: 8.645.531)				
7	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2024	835.170	11.684	0,00
121	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2024	14.476.440	567.123	0,20
55	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2024	5.860.525	11.202	0,00
204	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	14.611.416	432.064	0,15
203	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	21.645.033	274.658	0,09
13	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.415.147	3.190	0,00
382	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	37.481.831	760.938	0,26
21	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.060.520	44.705	0,02
121	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	13.668.073	901.197	0,31
1	UK Long Gilt Long Futures Contracts Exp Mar-2024	118.107	5.385	0,00

Offene Terminkontrakte insgesamt		3.012.146	1,03
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.942.977 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 4.245.520)		4.942.977	1,69

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		273.513.435	93,74

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Total Return Swaps			
Europa - (936.718) (31. Dezember 2022: –)			
29.400.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024	(712.187)	(0,24)
6.300.000	IRD 3 Month EURIBOR 20-Mar-2024	(224.531)	(0,08)

Vereinigte Staaten von Amerika - (2.272.106) (31. Dezember 2022: –)			
6.400.000	Markit iBoxx USD Contingent Convertible Liquid Developed Markets AT1 Index 20-Mar-2024	(157.555)	(0,05)
16.850.000	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index 20-Mar-2024	(509.356)	(0,17)
52.250.000	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index 20-Mar-2024	(1.605.195)	(0,55)

Total Return Swaps insgesamt		(3.208.824)	(1,09)

Credit Default Swaps - (4.071.099) (31. Dezember 2022: (5.123.041))			
3.400.000	CDS Barrick Gold Corporation 1.000% 20-Dec-2028	(77.446)	(0,03)
650.000	CDS Beazer Homes USA Inc 5.000% 20-Dec-2028	(52.669)	(0,02)
2.970.000	CDS BorgWarner Inc 1.000% 20-Dec-2028	(39.303)	(0,01)
3.460.000	CDS British American Tobacco plc 1.000% 20-Dec-2028	(27.699)	(0,01)
2.120.000	CDS Canadian Natural Resources Limited 1.000% 20-Dec-2028	(33.414)	(0,01)
3.320.000	CDS Imperial Brands Plc 1.000% 20-Dec-2028	(27.262)	(0,01)
930.000	CDS KB Home 5.000% 20-Dec-2028	(130.596)	(0,05)
(2.590.000)	CDS Ladbroke's Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2028	(70.986)	(0,02)
1.560.000	CDS Lennar Corp 5.000% 20-Dec-2028	(264.555)	(0,09)
1.920.000	CDS PulteGroup Inc 5.000% 20-Dec-2028	(325.516)	(0,11)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps Forts.			
(1.810.000)	CDS Rolls Royce Plc 1.000% 20-Dec-2028	(13.808)	(0,01)
1.960.000	CDS Toll Brothers Finance Corp 1.000% 20-Dec-2028	(2.832)	(0,00)
1.500.000	CDS Transdigm Inc 5.000% 20-Dec-2028	(198.913)	(0,07)
1.840.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2028	(295.644)	(0,10)
3.710.000	CDS Yum! Brands Inc 1.000% 20-Dec-2028	(32.099)	(0,01)
4.135.000	iTraxx Europe Crossover Index Series 40 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	(330.521)	(0,11)
4.965.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(96.459)	(0,03)
58.480.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(1.136.137)	(0,39)
23.755.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2033	(34.282)	(0,01)
54.700.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(830.820)	(0,29)
(4.870.000)	iTraxx Europe Sub Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(50.138)	(0,02)
Credit Default Swaps insgesamt		(4.071.099)	(1,40)

Währungsoptionen - (41.259) (31. Dezember 2022: –)			
(1.235.000)	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 162.000	(5)	(0,00)
(1.235.000)	Euro/Yen Put 04-Jan-2024 155.650	(2.255)	(0,00)
(624.000)	Sterling/Yen Put 02-Jan-2024 180.000	(1.972)	(0,00)
(1.202.000)	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 153.000	(30)	(0,00)
(1.202.000)	US Dollar/Yen Put 25-Jan-2024 143.900	(26.424)	(0,01)
(353.026.500)	Yen/US Dollar Call 16-Jan-2024 138.790	(8.531)	(0,01)
(353.026.500)	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 145.500	(2.042)	(0,00)

Währungsoptionen insgesamt		(41.259)	(0,02)

Zinsswaps - (1.434.617) (31. Dezember 2022: (5.418.137))			
9.435.000	IRS Pay 108.532381 Receive 1T USD Index 25-May-2053	(124.962)	(0,04)
4.965.000.000	IRS Pay Fixed 0.900% Receive 1 Year JPY TONA-OIS-Compound 01-Nov-2030	(606.377)	(0,21)
1.440.000.000	IRS Pay Fixed 1.744% Receive 1 Year JPY TONA-OIS-Compound Pay 01-Nov-2053	(629.507)	(0,22)
20.570.000	IRS Pay Fixed 3.450% Receive 1 Year GBP SONIA-Compound 21-Dec-2028	(73.771)	(0,03)

Zinsswaps insgesamt		(1.434.617)	(0,50)

Swaptions - (2.574) (31. Dezember 2022: (695.235))			
(17.150.000)	iTraxx Europe Index Series 40 Put 18-Sep-2024 0,030	(2.574)	(0,00)

Swaptions insgesamt		(2.574)	(0,00)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %

Offene Terminkontrakte - (6.392.397) (31. Dezember 2022: (6.339.286))				
(507)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(42.869.932)	(1.833.853)	(0,63)
(1.109)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(132.314.790)	(1.608.839)	(0,55)
(338)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(46.441.200)	(1.264.768)	(0,43)
(6)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(824.400)	(24.654)	(0,01)
(21)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.979.480)	(231.860)	(0,08)
(9)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(958.995)	(5.859)	(0,00)
(32)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(29.943.901)	(298.849)	(0,10)
(220)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(22.421.177)	(274.522)	(0,10)
(3)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(305.743)	(10.224)	(0,00)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(5)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(533.129)	(24.128)	(0,01)
(76)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(9.202.401)	(618.526)	(0,21)
(33)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.897.542)	(196.315)	(0,07)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(6.392.397)	(2,19)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (6.580.113) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (10.505.261))			(6.580.113)	(2,25)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(21.730.883)	(7,45)
Nettoumlaufvermögen			40.002.605	13,71
Summe Nettovermögen			291.785.157	100,00

^Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.
 Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Goldman Sachs und HSBC Bank plc.
 Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.
 Der Kontrahent für Zinsswaps ist Goldman Sachs.
 Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank Plc, BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.
 Die Kontrahenten für Total Return Swaps sind BNP Paribas, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.

Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		74,52
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		5,33
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,93
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		3,78
Sonstiges Umlaufvermögen		15,44
Gesamtvermögen		100,00

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (B)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
Euro	US-Dollar	955.026	1.022.000	10. Jan. 24	Lloyds Bank plc	32.712
Euro	US-Dollar	186.823	200.000	10. Jan. 24	Lloyds Bank plc	6.331
Euro	US-Dollar	601.446	637.000	10. Jan. 24	Lloyds Bank plc	26.579
Euro	US-Dollar	15.457.916	16.475.000	10. Jan. 24	Lloyds Bank plc	589.895
Euro	US-Dollar	666.331	710.000	10. Jan. 24	Deutsche Bank AG	25.585
Euro	US-Dollar	510.205	546.000	10. Jan. 24	Lloyds Bank plc	17.462
Kanadischer Dollar	Euro	658.000	447.176	12. Jan. 24	BNP Paribas	848
Kanadischer Dollar	Euro	611.000	413.414	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	2.609
Kanadischer Dollar	Euro	752.000	510.608	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	1.420
Euro	Kanadischer Dollar	565.084	828.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	1.309
Euro	Kanadischer Dollar	285.579	419.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	286
Euro	Kanadischer Dollar	229.702	336.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	924
Euro	Kanadischer Dollar	512.480	750.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	1.814
Euro	Japanischer Yen	102.477	15.904.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	917
Euro	Japanischer Yen	927.553	145.000.000	12. Jan. 24	BNP Paribas	1.612
Euro	Japanischer Yen	47.835	7.490.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	5
Euro	Japanischer Yen	192.284	30.013.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	627
Euro	Japanischer Yen	274.223	42.578.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	2.328
Euro	Schwedische Krone	126.057	1.393.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	408
Ungarischer Forint	Euro	7.869.000	20.506	12. Jan. 24	Deutsche Bank AG	39
Japanischer Yen	Euro	28.905.000	178.119	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	6.463
Koreanischer Won	US-Dollar	4.700.000.000	3.542.433	12. Jan. 24	BNP Paribas	88.067
Koreanischer Won	US-Dollar	2.400.000.000	1.827.410	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	28.269
Neuseeländischer Dollar	Euro	222.000	122.122	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	4.491
Norwegische Krone	Euro	141.000	11.791	12. Jan. 24	BNP Paribas	750
Schwedische Krone	Euro	3.640.000	320.341	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	7.988
Schwedische Krone	Euro	1.857.000	163.329	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	4.173
Schwedische Krone	Euro	1.328.000	119.273	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	514
Schwedische Krone	Euro	2.000.000	177.549	12. Jan. 24	Morgan Stanley	2.852
Schwedische Krone	Euro	4.384.000	392.295	12. Jan. 24	BNP Paribas	3.144
Schwedische Krone	Euro	1.595.000	142.542	12. Jan. 24	BNP Paribas	1.328
Schwedische Krone	Euro	1.613.000	142.499	12. Jan. 24	Morgan Stanley	2.994
Schweizer Franken	Euro	59.000	61.617	12. Jan. 24	Morgan Stanley	2.105
Euro	US-Dollar	898.593	951.000	18. Jan. 24	RBC Europe Limited	40.650
Euro	US-Dollar	1.688.737	1.853.000	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	17.057
Euro	US-Dollar	31.717	34.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	1.044
Euro	US-Dollar	865.449	920.000	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	35.473
Euro	US-Dollar	351.369	384.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	4.944
Euro	US-Dollar	579.613	619.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	21.184
Euro	US-Dollar	16.467.138	17.528.000	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	654.296
Australischer Dollar	US-Dollar	6.710.019	4.412.824	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	138.102
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.078.000	810.321	19. Jan. 24	Morgan Stanley	2.855
Kanadischer Dollar	US-Dollar	933.747	687.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	15.904
Euro	Pfund Sterling	874.642	754.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	7.652
Euro	US-Dollar	18.486.146	20.026.632	19. Jan. 24	Morgan Stanley	419.951
Euro	US-Dollar	677.000	728.643	19. Jan. 24	Morgan Stanley	19.685
Euro	US-Dollar	1.031.000	1.131.615	19. Jan. 24	BNP Paribas	10.161
Euro	US-Dollar	1.604.508	1.734.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	40.252
Japanischer Yen	US-Dollar	1.982.585.826	13.571.327	19. Jan. 24	Morgan Stanley	428.116
Japanischer Yen	US-Dollar	75.435.758	516.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	16.630
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	562.727	345.667	19. Jan. 24	UBS AG	9.022
Pfund Sterling	Euro	754.000	866.127	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	863
Pfund Sterling	Euro	383.000	439.956	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	438
Pfund Sterling	US-Dollar	293.100	367.257	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	5.717
Schwedische Krone	US-Dollar	8.899.105	850.745	19. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	35.242
US-Dollar	Australischer Dollar	310.974	455.000	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	1.230
US-Dollar	Koreanischer Won	398.689	512.960.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	1.920
US-Dollar	Koreanischer Won	335.136	431.995.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	1.053
Euro	Australischer Dollar	278.069	452.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley	617

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
Euro	US-Dollar	378.000	409.580	23. Jan. 24	Morgan Stanley	8.579
Euro	US-Dollar	730.000	800.072	23. Jan. 24	Morgan Stanley	8.373
Euro	US-Dollar	5.519.996	5.860.000	23. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	234.554
Euro	US-Dollar	5.521.613	5.860.000	23. Jan. 24	Lloyds Bank plc	236.172
Euro	US-Dollar	80.000	87.503	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.076
Euro	US-Dollar	5.519.604	5.860.000	23. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	234.162
Euro	US-Dollar	5.521.703	5.860.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley	236.262
Australischer Dollar	Euro	94.000	57.094	2. Feb. 24	Morgan Stanley	602
Australischer Dollar	Euro	150.000	91.361	2. Feb. 24	Morgan Stanley	706
Australischer Dollar	Euro	643.000	393.607	2. Feb. 24	Lloyds Bank plc	1.056
Australischer Dollar	Euro	973.000	594.598	2. Feb. 24	Lloyds Bank plc	2.613
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.755.000	353.645	2. Feb. 24	Morgan Stanley	6.280
Euro	US-Dollar	774.114	844.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	13.333
Euro	US-Dollar	766.711	823.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	24.859
Euro	US-Dollar	1.962.644	2.163.000	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	12.917
Euro	US-Dollar	373.250	400.000	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	12.690
Euro	US-Dollar	339.702	367.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	8.888
Euro	US-Dollar	18.465.822	19.792.000	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	625.325
Euro	US-Dollar	4.681.650	5.065.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	116.062
Euro	Pfund Sterling	1.095.583	941.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	14.626
Euro	Pfund Sterling	578.504	496.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	8.733
Euro	Pfund Sterling	544.881	468.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	7.274
Pfund Sterling	Euro	317.000	363.618	16. Feb. 24	Morgan Stanley	530
Pfund Sterling	Euro	295.000	338.383	16. Feb. 24	Morgan Stanley	493
Euro	US-Dollar	976.215	1.069.000	22. Feb. 24	RBC Europe Limited	131.159
Euro	US-Dollar	15.752.235	17.321.000	22. Feb. 24	Lloyds Bank plc	14.7847
Euro	US-Dollar	916.512	1.000.000	22. Feb. 24	Morgan Stanley	15.618
Euro	US-Dollar	577.568	633.000	22. Feb. 24	HSBC Bank plc	7.302
Chilenischer Peso	US-Dollar	482.890.000	527.749	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	15.080
Chilenischer Peso	US-Dollar	205.360.000	230.637	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	834
Chinesischer Yuan	US-Dollar	90.000	12.631	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	73
Chinesischer Yuan	US-Dollar	1.152.000	162.204	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	459
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	362.160.000	86.641	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	4.843
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	528.650.000	132.002	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	2.093
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	72.000.000	16.978	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	1.185
Tschechische Krone	US-Dollar	814.000	35.749	20. Mrz. 24	Deutsche Bank AG	591
Tschechische Krone	US-Dollar	360.000	15.604	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	447
Ungarischer Forint	US-Dollar	33.714.800	94.180	20. Mrz. 24	BNP Paribas	2.395
Ungarischer Forint	US-Dollar	79.333.000	225.655	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	1.997
Indische Rupie	US-Dollar	20.970.000	251.178	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	129
Indische Rupie	US-Dollar	22.500.000	268.708	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	855
Koreanischer Won	US-Dollar	31.870.000	24.613	20. Mrz. 24	Merrill Lynch International	13
Koreanischer Won	US-Dollar	610.595.000	467.054	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	4.304
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	50.000	10.730	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	215
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	2.430.000	515.431	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	15.853
Mexikanischer Peso	US-Dollar	789.000	44.556	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	1.275
Mexikanischer Peso	US-Dollar	160.000	8.718	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	544
Mexikanischer Peso	US-Dollar	7.840.000	445.099	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	10.546
Mexikanischer Peso	US-Dollar	6.033.500	341.309	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	9.222
Polnischer Zloty	US-Dollar	20.000	4.705	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	354
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	2.931.000	153.981	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	3.344
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	7.855.000	417.019	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	5.044
Taiwan-Dollar	US-Dollar	23.840.000	745.256	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	42.245
US-Dollar	Chilenischer Peso	285.997	250.050.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	3.636
US-Dollar	Taiwan-Dollar	807.561	23.840.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	13.823
US-Dollar	Türkische Lira	88.638	2.802.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	486

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Türkische Lira	156.836	4.947.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	1.167
US-Dollar	Türkische Lira	248.147	7.830.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	1.766
Taiwan-Dollar	US-Dollar	1.170.000	38.761	4. Dez. 24	BNP Paribas	1.146
						EUR 4.942.961
US-Dollar	Euro	737.000	676.695	10. Jan. 24	Morgan Stanley	(11.583)
US-Dollar	Euro	648.000	604.483	10. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(19.689)
US-Dollar	Euro	27.000	25.299	10. Jan. 24	Morgan Stanley	(833)
US-Dollar	Euro	185.000	168.538	10. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(1.583)
Kanadischer Dollar	Euro	313.000	213.449	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(331)
Chinesischer Yuan	Euro	4.205.000	540.068	12. Jan. 24	Deutsche Bank AG	(6.614)
Euro	Kanadischer Dollar	270.263	399.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(1.411)
Euro	Kanadischer Dollar	248.431	371.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(4.179)
Euro	Kanadischer Dollar	115.631	170.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(120)
Euro	Kanadischer Dollar	334.468	498.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(4.615)
Euro	Kanadischer Dollar	185.569	276.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(2.356)
Euro	Kanadischer Dollar	539.645	794.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(980)
Euro	Kanadischer Dollar	250.105	372.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(3.186)
Euro	Japanischer Yen	108.747	17.467.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(2.793)
Euro	Japanischer Yen	13.159.627	2.101.378.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(259.353)
Euro	Japanischer Yen	99.175	16.165.000	12. Jan. 24	Deutsche Bank AG	(4.052)
Euro	Japanischer Yen	1.098.278	172.739.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(4.799)
Euro	Japanischer Yen	48.828	7.716.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(445)
Euro	Neuseeländischer Dollar	13.734.651	24.795.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(406.637)
Euro	Schwedische Krone	211.893	2.366.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(1.521)
Euro	Schwedische Krone	235.750	2.657.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(3.912)
Euro	Schwedische Krone	1.268.175	14.786.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(65.529)
Japanischer Yen	Euro	30.803.000	196.960	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(259)
Japanischer Yen	Euro	29.398.000	188.247	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(518)
US-Dollar	Euro	1.650.000	1.529.517	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(40.587)
US-Dollar	Koreanischer Won	6.917.259	9.100.000.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(117.717)
US-Dollar	Euro	1.042.000	949.625	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(9.588)
US-Dollar	Euro	155.000	143.028	18. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(3.195)
US-Dollar	Euro	140.000	128.499	18. Jan. 24	Morgan Stanley	(2.199)
US-Dollar	Euro	935.000	870.636	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(271.29)
US-Dollar	Euro	2.500.000	2.340.997	18. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(85.628)
Euro	Australischer Dollar	668.298	1.096.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(4.482)
Euro	US-Dollar	1.267.000	1.406.462	19. Jan. 24	BNP Paribas	(1.782)
US-Dollar	Australischer Dollar	345.000	522.749	19. Jan. 24	BNP Paribas	(9.662)
US-Dollar	Australischer Dollar	698.211	1.030.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(2.404)
US-Dollar	Australischer Dollar	366.847	559.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(12.207)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.134.843	1.537.863	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(23.154)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	772.932	5.519.060	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(3.028)
US-Dollar	Euro	3.151.838	2.927.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(83.700)
US-Dollar	Japanischer Yen	339.441	48.647.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(4.696)
US-Dollar	Koreanischer Won	5.734.889	7.517.121.000	19. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(68.995)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	301.609	486.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(5.019)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	391.063	623.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(2.436)
US-Dollar	Norwegische Krone	216.896	2.362.433	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(14.432)
US-Dollar	Pfund Sterling	14.773.681	11.707.719	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(134.705)
US-Dollar	Schwedische Krone	685.000	7143.672	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(26.420)
US-Dollar	Schwedische Krone	364.158	3.678.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.248)
US-Dollar	Schweizer Franken	884.321	769.227	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(33.420)
Euro	Australischer Dollar	93.408	155.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley	(1.735)
Euro	Australischer Dollar	3.081.348	5.138.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley	(72.519)
Euro	Australischer Dollar	163.712	274.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley	(4.478)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Euro	1.000.000	925.701	23. Jan. 24	Morgan Stanley	(23.748)
US-Dollar	Euro	31.721	30.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(1.389)
US-Dollar	Euro	220.000	207.401	23. Jan. 24	Morgan Stanley	(8.972)
Australischer Dollar	Euro	323.000	198.476	2. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(224)
Australischer Dollar	Euro	788.000	483.919	2. Feb. 24	BNP Paribas	(258)
Australischer Dollar	Euro	465.000	286.063	2. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(654)
Euro	Australischer Dollar	14.001.715	23.279.000	2. Feb. 24	Morgan Stanley	(286.539)
US-Dollar	Brasilianischer Real	36.584	180.000	2. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(362)
US-Dollar	Brasilianischer Real	12.001	60.000	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(295)
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.154.411	15.570.490	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(40.527)
US-Dollar	Euro	400.000	371.704	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(11.145)
US-Dollar	Euro	1.300.000	1.191.795	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(19.975)
US-Dollar	Euro	695.000	636.764	7. Feb. 24	Morgan Stanley	(10.291)
US-Dollar	Euro	1.160.000	1.059.268	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(13.645)
US-Dollar	Euro	3.008.000	2.786.560	7. Feb. 24	Morgan Stanley	(75.151)
US-Dollar	Euro	6.622.000	6.058.067	7. Feb. 24	BNP Paribas	(89.000)
US-Dollar	Euro	364.000	332.067	7. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(3.958)
US-Dollar	Euro	3.000.000	2.775.130	7. Feb. 24	Morgan Stanley	(70.932)
Euro	Pfund Sterling	161.884	141.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(87)
Euro	Pfund Sterling	1.068.046	931.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(1.424)
Euro	Pfund Sterling	13.796.879	12.016.000	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(6.291)
Pfund Sterling	Euro	692.000	797.005	16. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(2.082)
Pfund Sterling	Euro	347.000	403.867	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(5.256)
Pfund Sterling	Euro	423.000	488.590	16. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(2.676)
Pfund Sterling	Euro	105.000	120.869	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(252)
Pfund Sterling	Euro	357.000	415.682	16. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(5.585)
Pfund Sterling	Euro	869.000	1.011.424	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(13.175)
Pfund Sterling	Euro	471.000	549.346	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(8.293)
US-Dollar	Euro	2.160.000	1.970.603	22. Feb. 24	Lloyds Bank plc	(24.672)
US-Dollar	Euro	350.000	323.205	22. Feb. 24	Morgan Stanley	(7.892)
Chilenischer Peso	US-Dollar	50.880.000	57.696	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(291)
Indonesische Rupiah	US-Dollar	280.790.000	18.208	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(46)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	4.602.000	249.178	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.418)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	6.930.000	375.306	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.204)
US-Dollar	Chilenischer Peso	182.539	162.416.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(541)
US-Dollar	Chilenischer Peso	32.344	29.430.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(757)
US-Dollar	Chilenischer Peso	255.380	233.867.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(7.494)
US-Dollar	Chilenischer Peso	266.883	238.860.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.210)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	700.345	5.091.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(16.858)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.791.510	7.542.258.163	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(112.439)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	237.296	960.210.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(6.020)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	131.562	524.590.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.560)
US-Dollar	Tschechische Krone	9.804	230.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(435)
US-Dollar	Tschechische Krone	542.648	12.721.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(23.666)
US-Dollar	Ungarischer Forint	21.193	7.470.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(237)
US-Dollar	Ungarischer Forint	28.158	10.100.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(768)
US-Dollar	Ungarischer Forint	982.169	363.209.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(54.988)
US-Dollar	Ungarischer Forint	6.577	2.440.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(388)
US-Dollar	Indische Rupie	36.095	3.020.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(89)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	268.666	4.230.090.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(4.374)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	503.914	8.014.002.375	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(12.857)
US-Dollar	Koreanischer Won	68.677	91.060.000	20. Mrz. 24	RBC Europe Limited	(620)
US-Dollar	Koreanischer Won	268.477	358.954.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(8.013)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	539.238	2.484.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(5.089)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	2.734.813	50.328.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(177.888)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	96.549	1.690.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.731)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	2.733.887	50.328.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(178.722)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	79.928	1.440.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(3.579)
US-Dollar	Polnischer Zloty	260.428	1.038.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(3.766)
US-Dollar	Polnischer Zloty	280.200	1.189.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(20.613)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Rumänischer Leu	269.885	1.273.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(11.888)
US-Dollar	Rumänischer Leu	265.635	1.210.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(3.104)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	66.446	1.250.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(727)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	49.073	930.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(868)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	47.756	900.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(600)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	2.594.081	48.733.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(25.117)
US-Dollar	Thailändischer Baht	365.264	13.057.800	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(17.912)
US-Dollar	Thailändischer Baht	17.267	600.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(388)
US-Dollar	Türkische Lira	67.560	2.168.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(544)
US-Dollar	Hongkong-Dollar	539.751	4.198.439	26. Aug. 24	Goldman Sachs International	(282)
US-Dollar	Taiwan-Dollar	262.284	7.740.000	4. Dez. 24	Barclays Bank PLC	(2.368)
US-Dollar	Taiwan-Dollar	282.826	8.520.000	4. Dez. 24	HSBC Bank plc	(7.843)
EUR						(3.062.015)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling T (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	1.160	1.008	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	367	315	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	Euro	1.008	1.159	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
EUR						4
GBP						3
Pfund Sterling	Euro	4.000	4.611	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
Pfund Sterling	Euro	8.000	9.247	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(46)
Pfund Sterling	Euro	11.921	13.779	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(68)
Pfund Sterling	Euro	2.000	2.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
Pfund Sterling	Euro	2.174.227	2.537.124	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(36.428)
EUR						(36.573)
GBP						(31.787)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	405	352	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	1.262	1.089	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Pfund Sterling	Euro	352	405	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	Euro	16.539	19.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
EUR						12
GBP						10
Euro	Pfund Sterling	19.026	16.539	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	Euro	6.783	7.819	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17)
Pfund Sterling	Euro	12.000	13.871	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(69)
Pfund Sterling	Euro	58.690	68.111	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(608)
Pfund Sterling	Euro	128.869	148.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(735)
Pfund Sterling	Euro	4.941	5.749	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(66)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.

Pfund Sterling	Euro	21.848.331	25.495.001	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(366.054)
					EUR	(367.552)
					GBP	(319.449)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	Euro	993.402	1.148.230	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.684)
Pfund Sterling	Euro	164.198.137	191.604.185	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.751.029)
						EUR
						(2.756.693)
						GBP
						(2.395.911)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD R (Hedged)

US-Dollar	Euro	95.945	87.312	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(733)
US-Dollar	Euro	3.599	3.293	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(45)
US-Dollar	Euro	25.370	23.497	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(603)
US-Dollar	Euro	628.164	583.767	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(16.923)
EUR						(18.304)
USD						(20.275)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD T (Hedged)

US-Dollar	Euro	70.579	64.574	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(884)
US-Dollar	Euro	12.549.514	11.662.541	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(338.092)
					EUR	(338.976)
					USD	(375.484)

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN CREDIT FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 1.213.024		1.213.024	4,83
945.246	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund^	1.213.024	4,83
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.213.024	4,83
Anleihen			
Österreich - 544.746		544.746	2,17
200.000	Erste Group Bank AG FRN (Perpetual) 4.250% 15-Oct-2027	171.840	0,68
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	180.910	0,72
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN (Perpetual) 8.659% 15-Jun-2024	191.996	0,77
Bermudas - 127.449		127.449	0,51
123.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	127.449	0,51
Kanada - 329.475		329.475	1,31
475.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.625% 27-Oct-2081	329.475	1,31
Zypern - 355.300		355.300	1,42
345.000	Bank of Cyprus Plc 'EMTN' FRN 7.375% 25-Jul-2028	355.300	1,42
Dänemark - 370.766		370.766	1,48
230.000	Orsted AS 'EMTN' 2.250% 14-Jun-2028	221.288	0,88
170.000	Orsted AS FRN 1.750% 09-Dec-3019	149.478	0,60
Frankreich - 977.500		977.500	3,90
250.000	BPCE SA 'REGS' FRN 7.003% 19-Oct-2034	245.990	0,98
229.000	CNP Assurances SACA FRN (Perpetual) 2.650% 21-Mar-2024	185.375	0,74
300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	324.476	1,29
200.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	221.659	0,89
Deutschland - 9.101.639		9.101.639	36,28
20.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.625% 06-Nov-2030	18.582	0,08
50.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.875% 24-May-2030	47.362	0,19
80.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 2.750% 19-Mar-2029	80.387	0,32
30.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 3.250% 19-May-2033	31.000	0,12
269.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	253.284	1,01
2.500.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	2.496.425	9,95
2.500.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Feb-2024	2.487.612	9,92
2.500.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Mar-2024	2.480.962	9,89
460.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.750% 14-Sep-2029	369.110	1,47
300.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	313.092	1,25
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	312.057	1,24
200.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	211.766	0,84
Griechenland - 105.035		105.035	0,42
100.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	105.035	0,42
Irland - 301.313		301.313	1,20
285.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	301.313	1,20
Italien - 264.025		264.025	1,05
250.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	264.025	1,05
Niederlande - 567.172		567.172	2,26
434.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	388.322	1,55

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Niederlande Forts.			
200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN (Perpetual) 3.250% 29-Dec-2026	178.850	0,71
Polen - 316.575		316.575	1,26
300.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	316.575	1,26
Portugal - 222.044		222.044	0,88
200.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	222.044	0,88
Spanien - 1.359.567		1.359.567	5,42
200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	186.314	0,74
200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	210.104	0,84
200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 3.625% 21-Mar-2029	149.590	0,60
200.000	CaixaBank SA FRN (Perpetual) 3.625% 14-Sep-2028	154.750	0,62
400.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	351.838	1,40
300.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 3.375% 22-Nov-2032	306.971	1,22
Supranational - 623.329		623.329	2,48
260.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 13-Nov-2026	252.920	1,01
365.000	European Union 2.750% 04-Feb-2033	370.409	1,47
Schweiz - 385.503		385.503	1,54
410.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	385.503	1,54
Vereinigtes Königreich - 1.171.400		1.171.400	4,67
261.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 8.450% 31-Jan-2028	315.623	1,26
246.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 4.375% 15-Mar-2028	173.653	0,69
317.000	National Grid Plc 'EMTN' 0.750% 01-Sep-2033	243.355	0,97
200.000	Rothsay Life Plc FRN (Perpetual) 4.875% 13-Apr-2027	145.842	0,58
116.000	SW Finance I Plc 7.375% 12-Dec-2041	142.882	0,57
158.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	150.045	0,60
Vereinigte Staaten von Amerika - 5.972.173		5.972.173	23,80
100.000	3M Co 'MTN' 1.500% 02-Jun-2031	85.288	0,34
249.000	Capital One Financial Corp FRN 7.624% 30-Oct-2031	246.820	0,98
407.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	374.657	1,49
420.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	390.584	1,56
291.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.037% 28-Oct-2033	275.425	1,10
340.000	Ryder System Inc 6.600% 01-Dec-2033	341.232	1,36
114.000	Tapestry Inc 7.850% 27-Nov-2033	110.109	0,44
250.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	234.836	0,93
1.360.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Apr-2024	1.211.019	4,83
2.750.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-May-2024	2.438.130	9,72
283.000	US Bancorp FRN 5.850% 21-Oct-2033	264.073	1,05
Gesamtanlagen in Anleihen		23.095.011	92,05
Total Return Swaps			
Europa - 198.736		198.736	0,79
5.350.000	iBoxx EUR Corporates Index 20-Mar-2024	84.887	0,34
4.300.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	6.963	0,03
5.450.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	106.295	0,42
350.000	Markit iBoxx EUR Contingent Convertible Liquid Developed Markets AT1 Index 20-Mar-2024	591	0,00
Total Return Swaps insgesamt		198.736	0,79

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung			
	Offene Terminkontrakte - 5.951			
1	U.S.Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	112.959	5.951	0,02
Offene Terminkontrakte insgesamt			5.951	0,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 153.062 (siehe unten)			153.062	0,61
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			24.665.784	98,30
Bestände	Beschreibung		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Total Return Swaps				
	Europa - (64.378)		(64.378)	(0,26)
1.950.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024		(9.719)	(0,04)
2.350.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024		(54.659)	(0,22)
Total Return Swaps insgesamt			(64.378)	(0,26)
	Credit Default Swaps - (645.574)			
10.650.000	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(189.623)	(0,75)
8.350.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(162.222)	(0,65)
12.500.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(242.847)	(0,97)
3.350.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(50.882)	(0,20)
Credit Default Swaps insgesamt			(645.574)	(2,57)
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
	Offene Terminkontrakte - (226.228)			
(72)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(8.590.320)	(78.263)	(0,31)
(39)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(5.358.600)	(74.221)	(0,30)
(4)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(567.520)	(4.823)	(0,02)
(44)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.688.420)	(20.207)	(0,08)
(2)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(203.829)	(793)	(0,00)
(15)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.599.387)	(30.323)	(0,12)
(1)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(185.780)	(1.391)	(0,00)
(6)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(588.720)	(1.871)	(0,01)
(3)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(363.253)	(2.460)	(0,01)
(2)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(236.214)	(11.876)	(0,05)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(226.228)	(0,90)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (1.103) (siehe unten)			(1.103)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(937.283)	(3,73)
Nettoumlaufvermögen			1.361.632	5,43
Summe Nettovermögen			25.090.133	100,00

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

*Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Barclays Bank Plc, Goldman Sachs und JPMorgan Chase Bank.

Die Kontrahenten für Total Return Swaps sind Goldman Sachs und JPMorgan Chase Bank.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	93,31
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,02
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,35
Sonstiges Umlaufvermögen	5,32
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund

Euro	Pfund Sterling	457.952	394.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	4.791
Euro	US-Dollar	37.366	41.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	369
Euro	US-Dollar	527.250	576.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	7.478
Euro	US-Dollar	576.366	631.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	6.963
Euro	US-Dollar	4.946.063	5.401.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	72.300
Euro	US-Dollar	373.227	403.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	9.568
Euro	US-Dollar	2.116.917	2.289.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	51.366

EUR 152.835

US-Dollar	Euro	100.000	90.293	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(55)
US-Dollar	Euro	51.000	46.569	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(548)

EUR (603)

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	Euro	10.000	10.573	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	227

EUR 227**CHF 210**

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Euro	10.000	9.274	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(250)

EUR (250)**USD (277)**

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Euro	10.000	9.274	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(250)

EUR (250)**USD (277)**

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 6.126.086			
(31. Dezember 2022: 9.456.426)		6.126.086	9,08
60.940	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	6.126.086	9,08
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		6.126.086	9,08
Anleihen			
Frankreich - 26.896.495			
(31. Dezember 2022: 23.917.040)		26.896.495	39,86
39.000	Edenred SE (Zero Coupon) 0.000% 06-Sep-2024	2.369.786	3,51
750.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2024	749.925	1,11
2.400.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 10-Jan-2024	2.398.356	3,55
1.800.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	1.797.489	2,66
2.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Jan-2024	2.494.838	3,70
1.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	1.495.822	2,22
2.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	2.491.188	3,69
2.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 14-Feb-2024	2.489.312	3,69
500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Feb-2024	497.507	0,74
5.700.000	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Feb-2024	5.670.930	8,40
1.000.000	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Mar-2024	991.400	1,47
500.000	French Republic Government Bond OAT 2.250% 25-May-2024	497.100	0,74
18.000	Safran SA 0.875% 15-May-2027	2.952.842	4,38
Deutschland - 1.994.530			
(31. Dezember 2022: -)		1.994.530	2,96
2.000.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.750% 15-Feb-2024	1.994.530	2,96
Gesamtanlagen in Anleihen		28.891.025	42,82
Einlagenzertifikate			
Belgien - 1.494.827			
(31. Dezember 2022: 3.991.168)		1.494.827	2,21
1.500.000	KBC Bank NV (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024 CD	1.494.827	2,21
Japan - 5.965.360			
(31. Dezember 2022: -)		5.965.360	8,84
1.000.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corporation (Zero Coupon) 0.000% 01-Mar-2024 CD	993.174	1,47
1.000.000	MUFG Bank Ltd (Zero Coupon) 0.000% 08-Mar-2024 CD	992.362	1,47
2.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corporation (Zero Coupon) 0.000% 18-Mar-2024 CD	1.982.262	2,94
2.000.000	Sumitomo Trust and Banking (Zero Coupon) 0.000% 09-Jan-2024 CD	1.997.562	2,96
Niederlande - 996.307			
(31. Dezember 2022: -)		996.307	1,48
1.000.000	ABN AMRO Bank NV (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2024 CD	996.307	1,48
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.384.613			
(31. Dezember 2022: -)		2.384.613	3,53
1.000.000	Bank of America N.A. (Zero Coupon) 0.000% 16-Jan-2024 CD	998.046	1,48
1.400.000	Goldman Sachs International Bank (Zero Coupon) 0.000% 25-Mar-2024 CD	1.386.567	2,05
Gesamtanlagen in Einlagenzertifikaten		10.841.107	16,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Commercial Paper			
Österreich - 1.488.186			
(31. Dezember 2022: -)			
1.500.000	Oesterreichische Kontrollbank AG (Zero Coupon) 0.000% 11-Mar-2024 CP	1.488.186	2,21
Kanada - 1.182.250			
(31. Dezember 2022: 3.474.550)			
1.200.000	Toronto-Dominion Bank (Zero Coupon) 0.000% 17-May-2024 CP	1.182.250	1,75
Frankreich - 5.961.271			
(31. Dezember 2022: 3.992.942)			
2.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2024 CP	1.987.875	2,95
2.000.000	Credit Agricole Corporate & Investment Bank (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024 CP	1.992.830	2,95
2.000.000	La Banque Postale (Zero Coupon) 0.000% 28-Mar-2024 CP	1.980.566	2,93
Luxemburg - 1.492.909			
(31. Dezember 2022: 3.997.826)			
1.500.000	Clearstream Banking S.A. (Zero Coupon) 0.000% 12-Feb-2024 CP	1.492.909	2,21
Niederlande - 3.488.651			
(31. Dezember 2022: 7.979.591)			
1.500.000	Linde Finance BV (Zero Coupon) 0.000% 08-Jan-2024 CP	1.498.379	2,22
2.000.000	Toyota Motor Finance BV (Zero Coupon) 0.000% 12-Feb-2024 CP	1.990.272	2,95
Norwegen - 1.974.068			
(31. Dezember 2022: 3.992.993)			
1.000.000	DNB Bank ASA (Zero Coupon) 0.000% 22-Apr-2024 CP	987.843	1,47
1.000.000	DNB Bank ASA (Zero Coupon) 0.000% 08-May-2024 CP	986.225	1,46
Spanien - 1.498.865			
(31. Dezember 2022: 3.998.478)			
1.500.000	Santander Consumer Finance S.A. (Zero Coupon) 0.000% 05-Jan-2024 CP	1.498.865	2,22
Schweden - 1.974.397			
(31. Dezember 2022: -)			
500.000	Svenska Handelsbanken AB (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2024 CP	495.996	0,74
1.500.000	Svenska Handelsbanken AB (Zero Coupon) 0.000% 10-May-2024 CP	1.478.401	2,19
Gesamtanlagen in Commercial Paper		19.060.597	28,25
Aktien-Swaps			
Frankreich - 60.250			
(9.500)	Edenred SE 26-Jun-2024	40.077	0,06
(800)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 26-Jun-2024	17.834	0,03
(500)	Pernod Ricard SA 26-Jun-2024	2.339	0,00
Deutschland - 14.094			
(2.250)	Puma SE 26-Jun-2024	14.094	0,02
Italien - 21.951			
(765.000)	Saipem SpA 26-Jun-2024	21.951	0,04
Japan - 167.857			
(35.100)	ANA Holdings Inc 26-Jun-2024	18.120	0,03
(16.100)	Ferrotec Holdings Corp 26-Jun-2024	53.685	0,08
(41.600)	JFE Holdings Inc 26-Jun-2024	10.773	0,02
(4.100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd 26-Jun-2024	8.133	0,01
(205.000)	NTN Corp 26-Jun-2024	33.573	0,05
(51.700)	Takashimaya Co Ltd 26-Jun-2024	30.937	0,04
(27.500)	Tokyu Corp 26-Jun-2024	12.636	0,02
Niederlande - 8.253			
(3.000)	Heineken Holding NV 26-Jun-2024	8.253	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien-Swaps Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika - 33.453	33.453	0,05
	(2.500) Block Inc 26-Jun-2024	1.778	0,00
	(11.600) ON Semiconductor Corp 26-Jun-2024	26.079	0,04
	(17.650) Pebblebrook Hotel Trust 26-Jun-2024	5.596	0,01
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		305.858	0,46
Total Return Swaps			
	Belgien - 6.340 (31. Dezember 2022: 36.900)	6.340	0,01
	461.110 TRS Groupe Bruxelles Lambert SA 2.125% 26-Jun-2024	6.340	0,01
	Frankreich - 141.298 (31. Dezember 2022: 21.710)	141.298	0,21
	(16.750) TRS Schneider Electric SE 0.000% 26-Jun-2024	141.298	0,21
	Deutschland - 185.239 (31. Dezember 2022: -)	185.239	0,28
	(24.000) TRS Bechtle AG 2.000% 26-Jun-2024	67.125	0,10
	105.500 TRS Deutsche Post AG 0.000% 26-Jun-2024	53.379	0,08
	(108.372) TRS Rheinmetall 1.875% 26-Jun-2024	64.735	0,10
	Italien - 118.124 (31. Dezember 2022: 27.870)	118.124	0,17
	(17.550) TRS ENI S.p.A. 2.950% 26-Jun-2024	55.557	0,08
	(114.550) TRS Saipem S.p.A. 2.875% 26-Jun-2024	62.567	0,09
	Japan - 358.532 (31. Dezember 2022: 52.577)	358.532	0,53
	(8.229.600) TRS DMG Mori Co. Ltd 0.000% 26-Jun-2024	40.890	0,06
	(5.690.000) TRS Kobe Steel Ltd 0.000% 26-Jun-2024	16.984	0,02
	300.000 TRS Koei Tecmo Holdings Co. Ltd 0.000% 26-Jun-2024	964	0,00
	(66.677.400) TRS Nippon Steel Corporation 0.000% 26-Jun-2024	195.382	0,29
	(1.1.405.000) TRS Sanrio Co Ltd 0.000% 26-Jun-2024	12.611	0,02
	(11.541.000) TRS Taiyo Yuden Co Ltd 0.000% 26-Jun-2024	13.484	0,02
	(27.950.000) TRS Toho Holdings Co Ltd 0.000% 26-Jun-2024	78.217	0,12
	Niederlande - 540.580 (31. Dezember 2022: -)	540.580	0,80
	(1.630.400) TRS BE Semiconductor Industries N.V. 0.750% 26-Jun-2024	540.580	0,80
	Polen - 24.407 (31. Dezember 2022: -)	24.407	0,04
	138.500 TRS Selenia FM S.A. 0.000% 26-Jun-2024	24.407	0,04
	Vereinigte Staaten von Amerika - 6.207.890 (31. Dezember 2022: 1.405.279)	6.207.890	9,20
	(67.397) TRS Advanced Energy Industries Inc 2.500% 26-Jun-2024	69.163	0,10
	(245.342) TRS Axon Enterprise, Inc. 0.500% 26-Jun-2024	379.010	0,56
	70.323 TRS BiLL Holdings Inc 0.000% 26-Jun-2024	12.068	0,02
	22.414 TRS BioMarin Pharmaceutical Inc. 0.599% 26-Jun-2024	9.524	0,01
	19.025 TRS Block Inc. 0.125% 26-Jun-2024	838	0,00
	(1.154.255) TRS Booking Holdings Inc 0.750% 26-Jun-2024	564.650	0,84
	(50.201) TRS Camtek Ltd 0.000% 26-Jun-2024	488.970	0,72
	8.035 TRS CSG Systems International, Inc. 3.875% 26-Jun-2024	20.051	0,03
	(189.728) TRS Enovis Corporation 3.875% 26-Jun-2024	195.002	0,29
	(253.795) TRS Etsy Inc 0.125% 26-Jun-2024	119.983	0,18
	124.991 TRS Expedia Group Inc 0.000% 26-Jun-2024	23.544	0,03
	(65.797) TRS Fluor Corporation 1.125% 26-Jun-2024	138.777	0,21
	(278.559) TRS Granite Construction Inc. 3.750% 26-Jun-2024	224.585	0,33
	(338.729) TRS Integer Holdings Corporation 2.125% 26-Jun-2024	202.248	0,30
	(540.372) TRS Interdigital Inc 3.500% 26-Jun-2024	254.611	0,38
	(905.779) TRS Li Auto Inc 0.250% 26-Jun-2024	13.788	0,02
	(210.439) TRS M/A-COM Technology Solutions Holdings, Inc. 0.250% 26-Jun-2024	341.556	0,51
	(95.788) TRS Merit Medical Systems, Inc. 3.000% 26-Jun-2024	115.234	0,17
	169.676 TRS Nice Systems Ltd 0.000% 26-Jun-2024	64.927	0,10
	(79.920) TRS ON Semiconductor Corporation 0.500% 26-Jun-2024	49.894	0,07
	(34.660) TRS PG&E Corporation 4.250% 26-Jun-2024	88.627	0,13
	265.458 TRS Rapid7 Inc 0.250% 26-Jun-2024	64.956	0,10
	(1.495.559) TRS Royal Caribbean International 6.000% 26-Jun-2024	910.313	1,35
	(120.220) TRS Seagate HDD Cayman 3.500% 26-Jun-2024	274.270	0,41
	54.456 TRS Southwest Airlines Co. 1.250% 26-Jun-2024	68.690	0,10
	(115.192) TRS Sphere Entertainment Co. 3.500% 26-Jun-2024	37.781	0,06
	(188.797) TRS Spirit AeroSystems Holdings, Inc. 3.250% 26-Jun-2024	234.569	0,35
	(59.373) TRS Tetra Tech Inc 2.250% 26-Jun-2024	18.368	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
	26.745 TRS Uber Technologies Inc 0.000% 26-Jun-2024	44.027	0,06
	(49.956) TRS Uber Technologies Inc 0.875% 26-Jun-2024	122.328	0,18
	(463.396) TRS Varonis Systems Inc 1.250% 26-Jun-2024	303.097	0,45
	2.810 TRS Ventas Realty LP 3.750% 26-Jun-2024	103.093	0,15
	(129.214) TRS Welltower OP LLC 2.2.750% 26-Jun-2024	183.510	0,27
	(170.557) TRS Western Digital Corporation 3.000% 26-Jun-2024	397.022	0,59
	15.500 TRS Wynn Macau Ltd 4.500% 26-Jun-2024	47.176	0,07
	98.889 TRS Ziff Davis Inc 1.700% 26-Jun-2024	21.640	0,03
Total Return Swaps insgesamt		7.582.410	11,24
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 203.879 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 54.537)		203.879	0,30
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		73.010.962	108,21
Aktien-Swaps			
	China - (25.347)		
	(31. Dezember 2022: -)	(25.347)	(0,04)
	(57.500) Li Auto Inc 26-Jun-2024	(25.347)	(0,04)
	Frankreich - (183.742)		
	(31. Dezember 2022: (135.123))	(183.742)	(0,27)
	(282) Euroapi SA 26-Jun-2024	(1.615)	(0,00)
	(16.000) Safran SA 26-Jun-2024	(182.127)	(0,27)
	Deutschland - (89.631)		
	(31. Dezember 2022: (45.323))	(89.631)	(0,13)
	(14.500) Bechtle AG 26-Jun-2024	(38.148)	(0,06)
	(8.500) DHL Group 26-Jun-2024	(8.775)	(0,01)
	(2.500) Rheinmetall AG 26-Jun-2024	(42.708)	(0,06)
	Israel - (452.807)		
	(31. Dezember 2022: -)	(452.807)	(0,67)
	(23.800) Camtek Ltd/Israel 26-Jun-2024	(425.878)	(0,63)
	(1.900) Nice Ltd 26-Jun-2024	(26.929)	(0,04)
	Italien - (17.923)		
	(31. Dezember 2022: (34.295))	(17.923)	(0,03)
	(35.500) Eni SpA 26-Jun-2024	(17.923)	(0,03)
	Japan - (214.817)		
	(31. Dezember 2022: (155.570))	(214.817)	(0,32)
	(50.000) DMG Mori Co Ltd 26-Jun-2024	(52.641)	(0,08)
	(25.000) Kobe Steel Ltd 26-Jun-2024	(12.273)	(0,02)
	(108.500) Nippon Steel Corp 26-Jun-2024	(87.040)	(0,13)
	(8.100) Sanrio Co Ltd 26-Jun-2024	(10.839)	(0,02)
	(15.800) Taiyo Yuden Co Ltd 26-Jun-2024	(1.782)	(0,00)
	(52.500) Toho Holdings Co Ltd 26-Jun-2024	(50.242)	(0,07)
	Macau - (43.157)		
	(31. Dezember 2022: -)	(43.157)	(0,06)
	(551.600) Wynn Macau Ltd 26-Jun-2024	(43.157)	(0,06)
	Niederlande - (514.882)		
	(31. Dezember 2022: -)	(514.882)	(0,76)
	(23.700) BE Semiconductor Industries NV 26-Jun-2024	(514.882)	(0,76)
	Vereinigte Staaten von Amerika - (4.522.190)		
	(31. Dezember 2022: (1.168.963))	(4.522.190)	(6,71)
	(10.450) Advanced Energy Industries Inc 26-Jun-2024	(54.018)	(0,08)
	(8.250) Axon Enterprise Inc 26-Jun-2024	(391.078)	(0,58)
	(1.850) BiLL Holdings Inc 26-Jun-2024	(3.636)	(0,01)
	(1.200) BioMarin Pharmaceutical Inc 26-Jun-2024	(3.261)	(0,00)
	(920) Booking Holdings Inc 26-Jun-2024	(490.037)	(0,73)
	(12.000) CSG Systems International Inc 26-Jun-2024	(4.288)	(0,01)
	(23.250) Enovis Corp 26-Jun-2024	(146.785)	(0,22)
	(18.000) Etsy Inc 26-Jun-2024	(91.637)	(0,14)
	(2.050) Expedia Group Inc 26-Jun-2024	(3.155)	(0,00)
	(35.150) Fluor Corp 26-Jun-2024	(95.082)	(0,14)
	(26.200) Granite Construction Inc 26-Jun-2024	(155.995)	(0,23)
	(16.250) Integer Holdings Corp 26-Jun-2024	(173.567)	(0,26)
	(17.500) InterDigital Inc 26-Jun-2024	(238.083)	(0,35)
	(3.500) Lumentum Holdings Inc 26-Jun-2024	(6.942)	(0,01)
	(19.400) MACOM Technology Solutions Holdings Inc 26-Jun-2024	(285.480)	(0,42)
	(11.750) Merit Medical Systems Inc 26-Jun-2024	(75.406)	(0,11)
	(45.000) PG&E Corp 26-Jun-2024	(21.486)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Aktien-Swaps Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
(7.700)	Rapid7 Inc 26-Jun-2024	(51.322)	(0,08)	
(27.450)	Royal Caribbean Cruises Ltd 26-Jun-2024	(877.430)	(1,30)	
(3.500)	Schneider Electric SE 26-Jun-2024	(55.749)	(0,09)	
(14.150)	Seagate Technology Holdings PLC 26-Jun-2024	(210.458)	(0,31)	
(9.900)	Southwest Airlines Co 26-Jun-2024	(52.028)	(0,08)	
(22.800)	Sphere Entertainment Co 26-Jun-2024	(29.637)	(0,04)	
(39.100)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 26-Jun-2024	(211.494)	(0,31)	
(4.950)	Tetra Tech Inc 26-Jun-2024	(17.898)	(0,03)	
(18.650)	Uber Technologies Inc 26-Jun-2024	(94.668)	(0,14)	
(34.700)	Varonis Systems Inc 26-Jun-2024	(269.527)	(0,40)	
(11.900)	Ventas Inc 26-Jun-2024	(62.359)	(0,09)	
(18.200)	Welltower Inc 26-Jun-2024	(102.750)	(0,15)	
(30.050)	Western Digital Corp 26-Jun-2024	(239.854)	(0,36)	
(5.950)	Ziff Davis Inc 26-Jun-2024	(7.080)	(0,01)	
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		(6.064.496)	(8,99)	
Total Return Swaps				
Japan - (158.737) (31. Dezember 2022: (168.882))		(158.737)	(0,24)	
(22.885.000)	TRS ANA Holdings Inc 0.000% 26-Jun-2024	(24.638)	(0,04)	
(13.742.500)	TRS Ferrotec Corporation 0.000% 26-Jun-2024	(45.525)	(0,07)	
(16.005.000)	TRS JFE Holdings Inc 0.000% 26-Jun-2024	(14.185)	(0,02)	
(8.675.000)	TRS NTN Corporation 0.000% 26-Jun-2024	(29.552)	(0,04)	
(19.523.600)	TRS Takashimaya Co Ltd 0.000% 26-Jun-2024	(30.025)	(0,05)	
(5.643.100)	TRS Tokyu Corporation 0.000% 26-Jun-2024	(14.812)	(0,02)	
Mexiko - (50.889) (31. Dezember 2022: -)		(50.889)	(0,08)	
(52.548)	TRS Fomento Económico Mexicano, S.A.B. de C.V. 2.625% 26-Jun-2024	(50.889)	(0,08)	
Vereinigte Staaten von Amerika - (78.716) (31. Dezember 2022: (6.141.221))		(78.716)	(0,11)	
(79.300)	TRS JPMorgan Chase Bank 0.000% 26-Jun-2024	(41.650)	(0,06)	
(43.149)	TRS Lumentum Holdings Inc. 0.250% 26-Jun-2024	(27.672)	(0,04)	
94.029	TRS Pebblebrook Hotel Trust 1.750% 26-Jun-2024	(9.394)	(0,01)	
Total Return Swaps insgesamt		(288.342)	(0,43)	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (151.101)				
(31. Dezember 2022: 227.580)				
(15)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.789.200)	(25.887)	(0,04)
(7)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(6.597.648)	(67.047)	(0,10)
(5)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(511.303)	(15.160)	(0,02)
(15)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.797.872)	(26.984)	(0,04)
(7)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(689.718)	(16.023)	(0,02)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(151.101)	(0,22)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (447.135) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.909.441))			(447.135)	(0,66)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(6.951.074)	(10,30)	
Nettoumlaufvermögen		1.414.412	2,09	
Summe Nettovermögen		67.474.300	100,00	

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.
Der Kontrahent für Aktien-Swaps ist BNP Paribas.
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	46,28
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	
Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	39,52
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	10,69
Sonstiges Umlaufvermögen	3,51
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse CHF F (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	108	113	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	Euro	21.275	22.556	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	373
EUR						375
CHF						348

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse JPY E (Acc) (Hedged)

Euro	Japanischer Yen	13.201	2.039.757	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	81
Japanischer Yen	Euro	25.851.492	163.940	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.339
Japanischer Yen	Euro	3.959.777.291	25.269.688	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199.806
Japanischer Yen	Euro	5.693.391	36.619	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
EUR						202.228
JPY						31.478.198
Euro	Japanischer Yen	6.451	1.016.391	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(86)
EUR						(86)
JPY						(13.386)

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse Sterling F (Acc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	35.853	31.062	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	Pfund Sterling	70.105	60.537	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	233
Euro	Pfund Sterling	8.610	7.441	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22
Euro	Pfund Sterling	6.628	5.703	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	45
Euro	Pfund Sterling	17.950	15.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	101
Euro	Pfund Sterling	39.071	33.699	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	176
Euro	Pfund Sterling	8.145	7.004	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	61
Euro	Pfund Sterling	2.406	2.064	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23
Euro	Pfund Sterling	68.920	59.181	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	613
EUR						1.276
GBP						1.105
Euro	Pfund Sterling	24.303	21.093	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42)
Pfund Sterling	Euro	56.096	65.246	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(500)
Pfund Sterling	Euro	11.109.674	12.966.914	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(144.144)
EUR						(144.686)
GBP						(125.310)

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

Pfund Sterling	Euro	489	569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
Pfund Sterling	Euro	97.385	113.665	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.264)
EUR						(1.268)
GBP						(1.098)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	116.887	135.953	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.042)
Pfund Sterling	Euro	22.673.155	26.463.500	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(294.176)
EUR						(295.218)
GBP						(255.682)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse USD F (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	921	843	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	173.173	160.979	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4.179)
EUR						(4.187)
USD						(4.622)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Anteilklasse USD U (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	367	336	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	69.899	64.977	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.687)
EUR						(1.690)
USD						(1.866)

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 3.899.984			
(31. Dezember 2022: 2.107.710)		3.899.984	13,04
118.748	Dexus (REIT)	620.599	2,08
187.199	Insurance Australia Group Ltd	719.908	2,41
48.285	National Australia Bank Ltd	1.007.744	3,37
15.522	Sonic Healthcare Ltd	338.681	1,13
50.592	Transurban Group	471.866	1,58
16.897	Woodside Energy Group Ltd	356.962	1,19
18.139	Woodside Energy Group Ltd	384.224	1,28
China - 767.273			
(31. Dezember 2022: 1.276.241)		767.273	2,57
132.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	599.181	2,01
138.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	168.092	0,56
Hongkong - 3.853.980			
(31. Dezember 2022: 2.701.944)		3.853.980	12,89
112.200	AIA Group Ltd	977.779	3,27
31.500	ASMPT Ltd	300.519	1,01
104.000	CLP Holdings Ltd	857.059	2,87
17.041	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	584.205	1,95
202.320	Link REIT (Units) (REIT)	1.134.418	3,79
Indien - 3.162.746			
(31. Dezember 2022: 1.473.826)		3.162.746	10,58
35.217	Infosys Ltd ADR	653.804	2,19
164.244	ITC Ltd	912.124	3,05
132.720	ITC Ltd GDR	736.596	2,46
18.847	Tata Consultancy Services Ltd	860.222	2,88
Indonesien - 2.560.373			
(31. Dezember 2022: 1.082.218)		2.560.373	8,56
2.266.400	Bank Mandiri Persero Tbk PT	888.705	2,97
2.345.395	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	870.174	2,91
3.120.256	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	801.494	2,68
Neuseeland - 963.354			
(31. Dezember 2022: 644.845)		963.354	3,22
46.085	Mercury NZ Ltd	191.356	0,64
119.247	Meridian Energy Ltd	413.372	1,38
109.970	Spark New Zealand Ltd	358.626	1,20
Republik Korea - 3.252.510			
(31. Dezember 2022: 1.689.806)		3.252.510	10,88
51.808	Macquarie Korea Infrastructure Fund	500.219	1,67
44.215	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	2.137.110	7,15
15.830	SK Telecom Co Ltd	615.181	2,06
Singapur - 4.927.838			
(31. Dezember 2022: 3.623.455)		4.927.838	16,48
217.100	ComfortDelGro Corp Ltd	230.397	0,77
48.900	DBS Group Holdings Ltd	1.237.513	4,14
188.700	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	525.677	1,76
68.200	Singapore Exchange Ltd	507.416	1,70
333.000	Singapore Technologies Engineering Ltd	980.674	3,28
33.600	United Overseas Bank Ltd	724.748	2,42
69.900	Venture Corp Ltd	721.413	2,41
Südkorea - 599.838			
(31. Dezember 2022: 319.202)		599.838	2,01
22.441	KT Corp	599.838	2,01
Taiwan - 4.412.740			
(31. Dezember 2022: 2.105.939)		4.412.740	14,76
47.096	Advantech Co Ltd	570.468	1,91
41.000	Chroma ATE Inc	284.217	0,95
32.000	Elite Material Co Ltd	398.038	1,33
32.000	MediaTek Inc	1.055.701	3,53
109.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.104.316	7,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Thailand - 368.509			
(31. Dezember 2022: 401.069)		368.509	1,23
80.500	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	368.509	1,23
Vereinigtes Königreich - 557.568			
(31. Dezember 2022: 748.055)		557.568	1,86
16.227	BHP Group Ltd	557.568	1,86
Gesamtanlagen in Aktien		29.326.713	98,08
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		29.326.713	98,08
Nettoumlaufvermögen		573.830	1,92
Summe Nettovermögen		29.900.543	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,78	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,22	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON ASIAN OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 1.010.054			
(31. Dezember 2022: 2.088.289)		1.010.054	2,74
5.181	CSL Ltd	1.010.054	2,74
China - 8.587.419			
(31. Dezember 2022: 15.455.414)		8.587.419	23,28
10.000.000	Boshiwa International Holding Ltd^	-	-
143.447	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	767.476	2,08
327.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	476.795	1,29
260.214	NARI Technology Co Ltd 'A'	818.741	2,22
41.000	NetEase Inc	738.216	2,00
600	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	1.216	-
37.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	167.319	0,45
24.800	Proya Cosmetics Co Ltd 'A'	347.564	0,94
138.800	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1.235.994	3,35
57.000	Sungrow Power Supply Co Ltd	703.599	1,91
69.700	Sunresin New Materials Co Ltd	521.556	1,42
46.300	Tencent Holdings Ltd	1.739.006	4,72
25.303	Yum China Holdings Inc	1.069.937	2,90
Hongkong - 2.172.766			
(31. Dezember 2022: 2.675.176)		2.172.766	5,89
171.800	AIA Group Ltd	1.497.169	4,06
31.924	Prudential Plc	360.000	0,98
317.083	Vitasoy International Holdings Ltd	315.597	0,85
Indien - 11.804.934			
(31. Dezember 2022: 11.620.178)		11.804.934	32,00
102.480	HDFC Bank Ltd	2.104.188	5,70
94.141	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	730.971	1,98
36.815	Hindustan Unilever Ltd	1.176.226	3,19
58.320	ICICI Bank Ltd	699.234	1,89
19.691	Info Edge India Ltd	1.215.813	3,30
36.339	Infosys Ltd	673.492	1,83
133.400	Marico Ltd	878.219	2,38
4.802	PB Fintech Ltd	45.878	0,12
12.328	Pidilite Industries Ltd	401.486	1,09
98.095	Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	758.873	2,06
36.362	Tata Consultancy Services Ltd	1.659.649	4,50
21.402	Titan Co Ltd	947.872	2,57
345.190	Zomato Ltd	513.033	1,39
Indonesien - 1.994.485			
(31. Dezember 2022: 1.295.405)		1.994.485	5,41
2.931.300	Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.149.427	3,12
2.277.700	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	845.058	2,29
Jersey - 734.235			
(31. Dezember 2022: -)		734.235	1,99
96.228	Arcadium Lithium Plc CDI	734.235	1,99
Niederlande - 1.754.818			
(31. Dezember 2022: 1.359.499)		1.754.818	4,76
1.050	ASM International NV	549.645	1,49
1.586	ASML Holding NV	1.205.173	3,27
Neuseeland - 760.320			
(31. Dezember 2022: 534.965)		760.320	2,06
9.958	Xero Ltd	760.320	2,06
Philippinen - 11			
(31. Dezember 2022: 8)		11	-
1	GT Capital Holdings Inc	11	-
Republik Korea - 1.740.592			
(31. Dezember 2022: 2.721.737)		1.740.592	4,72
21.840	Samsung Electronics Co Ltd	1.330.343	3,61
1.120	Samsung SDI Co Ltd	410.249	1,11
Taiwan - 4.686.548			
(31. Dezember 2022: 4.071.090)		4.686.548	12,71
87.000	Chroma ATE Inc	603.094	1,64

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Taiwan Forts.			
51.000	Delta Electronics Inc	520.544	1,41
127.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.451.817	6,65
20.000	Voltronic Power Technology Corp	1.111.093	3,01
Vereinigte Staaten von Amerika - 432.676			
(31. Dezember 2022: -)		432.676	1,17
548	Lam Research Corp	432.676	1,17
Gesamtanlagen in Aktien		35.678.858	96,73
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		35.678.858	96,73
Nettoumlaufvermögen		1.204.438	3,27
Summe Nettovermögen		36.883.296	100,00
^ Die Gesellschaft unterliegt an der Hong Kong Stock Exchange einer Handelsaussetzung.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,54	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,46	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Frankreich - 2.308.389			
(31. Dezember 2022: 3.174.643)		2.308.389	6,41
3.600	Capgemini SE	750.333	2,08
1.838	Kering SA	809.696	2,25
924	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	748.360	2,08
Deutschland - 5.203.497			
(31. Dezember 2022: 5.553.526)		5.203.497	14,45
15.365	Daimler Truck Holding AG	578.750	1,61
18.857	Mercedes-Benz Group AG	1.302.115	3,62
1.661	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	690.007	1,92
8.987	SAP SE	1.384.801	3,84
13.340	Siemens AG ADR	1.247.824	3,46
Italien - 882.983			
(31. Dezember 2022: 956.762)		882.983	2,45
118.838	Enel SpA	882.983	2,45
Japan - 2.944.589			
(31. Dezember 2022: 2.436.985)		2.944.589	8,17
29.200	BayCurrent Consulting Inc	1.024.589	2,84
60.000	SBI Holdings Inc	1.350.213	3,75
6.000	Sony Group Corp	569.787	1,58
Niederlande - 2.286.146			
(31. Dezember 2022: 2.057.340)		2.286.146	6,35
65.810	Universal Music Group NV	1.874.395	5,21
2.902	Wolters Kluwer NV	411.751	1,14
Republik Korea - 634.243			
(31. Dezember 2022: 810.421)		634.243	1,76
3.502	HYBE Co Ltd	634.243	1,76
Singapur - 746.676			
(31. Dezember 2022: 828.374)		746.676	2,07
100.400	Singapore Exchange Ltd	746.676	2,07
Schweiz - 772.433			
(31. Dezember 2022: 1.479.628)		772.433	2,14
1.478	Zurich Insurance Group AG	772.433	2,14
Taiwan - 666.351			
(31. Dezember 2022: 792.903)		666.351	1,85
6.410	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	666.351	1,85
Vereinigte Staaten von Amerika - 18.602.878			
(31. Dezember 2022: 18.214.748)		18.602.878	51,64
4.261	Accenture Plc - Class A	1.496.080	4,15
5.258	Alphabet Inc - Class A	734.569	2,04
7.037	Archer-Daniels-Midland Co	508.106	1,41
28.518	Block Inc	2.205.725	6,12
18.217	Centene Corp	1.351.246	3,75
3.484	CyberArk Software Ltd	763.518	2,12
2.303	Globant SA	547.907	1,52
17.652	GXO Logistics Inc	1.079.508	3,00
6.944	JPMorgan Chase & Co	1.182.251	3,28
3.134	Mastercard Inc	1.336.917	3,71
4.577	Microsoft Corp	1.720.769	4,78
30.211	National Bank Holdings Corp	1.123.698	3,12
3.537	NVIDIA Corp	1.751.575	4,86
5.646	PayPal Holdings Inc	346.693	0,96
2.403	Salesforce Inc	632.554	1,76

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
262.691	WisdomTree Inc	1.821.762	5,06
Gesamtanlagen in Aktien		35.048.185	97,29
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 469.249 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 206.672)		469.249	1,31
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		35.517.434	98,60
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (6.437) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (13.091))		(6.437)	(0,02)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(6.437)	(0,02)
Nettoumlaufvermögen		511.632	1,42
Summe Nettovermögen		36.022.629	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,85	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,28	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,87	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	493	545	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	703	772	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	1.030	1.126	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	563	608	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	75.237	80.943	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.151
USD						2.180
EUR						1.975
Euro	US-Dollar	926	1.028	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	981	891	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
USD						(10)
EUR						(9)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	7.473	8.230	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
US-Dollar	Euro	7.046	6.368	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	8.581	9.456	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22
Euro	US-Dollar	7.431	8.183	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	24
Euro	US-Dollar	50	55	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	110.467	121.259	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	744
Euro	US-Dollar	21.304	23.285	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	243
Euro	US-Dollar	1.056	1.151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	165.340	180.787	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.819
Euro	US-Dollar	1.377	1.489	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	32
Euro	US-Dollar	89.644	96.871	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.134
Euro	US-Dollar	71.24	7.679	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	189
Euro	US-Dollar	38	40	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	12.154.166	13.075.889	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	347.488
Euro	US-Dollar	2.782	3.065	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	2.497	2.748	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
US-Dollar	Euro	22.361	20.202	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
USD						352.815
EUR						319.593
US-Dollar	Euro	3.064	2.782	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
Euro	US-Dollar	20.202	22.353	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(50)
Euro	US-Dollar	6.368	7.048	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
Euro	US-Dollar	78.138	86.309	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
Euro	US-Dollar	145.231	161.326	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(929)
US-Dollar	Euro	27.081	24.859	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(374)
US-Dollar	Euro	18.017	16.484	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(188)
US-Dollar	Euro	10.148	9.235	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(51)
US-Dollar	Euro	21.652	19.790	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(204)
US-Dollar	Euro	156.647	142.396	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(618)
US-Dollar	Euro	28.970	26.309	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(86)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	8.233	7.473	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	1.006	934	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Euro	6.681	6.198	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(165)
US-Dollar	Euro	11.491	10.628	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(248)
US-Dollar	Euro	127.538	116.939	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.613)
US-Dollar	Euro	12.057	10.956	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(44)
USD						(4.649)
EUR						(4.211)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	140	155	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	200	219	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	292	320	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	160	173	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	21.366	22.987	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	611
USD						619
EUR						561
Euro	US-Dollar	263	292	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	279	253	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(3)
EUR						(3)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	22.127	19.999	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
Euro	US-Dollar	80.241	87.791	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	829
Euro	US-Dollar	35.719	39.208	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	241
Euro	US-Dollar	51.990	56.826	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	593
Euro	US-Dollar	52.747	57.675	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	580
Euro	US-Dollar	28.966	31.301	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	690
Euro	US-Dollar	3.861.070	4.153.878	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	110.388
USD						113.370
EUR						102.695
Euro	US-Dollar	48.106	53.437	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(308)
Euro	US-Dollar	25.569	28.243	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
Euro	US-Dollar	19.999	22.135	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
US-Dollar	Euro	49.766	45.239	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(196)
US-Dollar	Euro	73.896	67.755	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(934)
US-Dollar	Euro	14.323	13.015	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Euro	9.775	8.973	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(135)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	4.500	4.162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(97)
						USD (1.774)
						EUR (1.607)

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)

Singapur-Dollar	US-Dollar	257	195	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Singapur-Dollar	US-Dollar	132	100	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Singapur-Dollar	US-Dollar	193	145	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Singapur-Dollar	US-Dollar	278	209	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.500	1.877	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18
Singapur-Dollar	US-Dollar	134	100	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Singapur-Dollar	US-Dollar	18.209	13.562	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	242
						USD 265
						SGD 350
US-Dollar	Singapur-Dollar	183	243	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
						USD (1)
						SGD (1)

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
	Grundstoffe - 6.750.844		
	(31. Dezember 2022: 6.892.609)	6.750.844	15,98
112.441	Gerdau SA - Preference	549.057	1,30
4.400	Gerdau SA ADR	21.516	0,05
314.700	Gerdau SA ADR	1.538.883	3,64
172.727	Suzano SA	1.978.453	4,68
154.936	Vale SA	2.462.658	5,83
12.600	Vale SA ADR - Class B	200.277	0,48
	Kommunikation - 2.828.583		
	(31. Dezember 2022: 2.710.877)	2.828.583	6,69
22.585	Telefonica Brasil SA	248.790	0,59
95.140	Telefonica Brasil SA ADR	1.042.259	2,46
416.085	TIM SA/Brazil	1.537.534	3,64
	Zyklische Konsumgüter - 4.234.358		
	(31. Dezember 2022: 4.761.374)	4.234.358	10,02
56.950	Almacenes Exito SA ADR	410.325	0,97
227.405	Almacenes Exito SA BDR	801.694	1,90
261.677	Atacadao SA	669.599	1,59
188.161	Cia Brasileira de Distribuicao	157.459	0,37
93.800	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	73.633	0,17
722.297	Sendas Distribuidora S/A	2.008.115	4,75
8.159	Sendas Distribuidora S/A ADR	113.533	0,27
	Nicht-zyklische Konsumgüter - 2.072.165		
	(31. Dezember 2022: 872.069)	2.072.165	4,90
674.605	BRF SA	1.917.880	4,54
54.808	BRF SA ADR	154.285	0,36
	Bildung - 1.185.078		
	(31. Dezember 2022: 597.432)	1.185.078	2,80
257.050	YDUQS Participacoes SA	1.185.078	2,80
	Energie - 2.462.993		
	(31. Dezember 2022: 1.474.060)	2.462.993	5,83
98.241	3R PETROLEUM OLEO E GAS SA	531.694	1,26
413.099	Vibra Energia SA	1.931.299	4,57
	Finanzwerte - 12.759.673		
	(31. Dezember 2022: 11.914.977)	12.759.673	30,20
180.909	Allos SA	988.601	2,34
429.956	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.288.292	3,05
35.102	Banco Bradesco SA - Preference	123.496	0,29
867.346	Banco Bradesco SA ADR	3.066.068	7,25
121.517	Banco BTG Pactual SA (Units)	940.971	2,23
179.894	BB Seguridade Participacoes SA	1.245.252	2,95
324.113	Bradespar SA - Preference	1.711.442	4,05
130.454	Itau Unibanco Holding SA - Preference	912.018	2,16
10.300	Itau Unibanco Holding SA ADR	71.946	0,17
1.129.111	Itausa SA - Preference	2.411.587	5,71
	Lebensmittelverarbeiter - 1.445.716		
	(31. Dezember 2022: 768.261)	1.445.716	3,42
725.112	Marfrig Global Foods SA	1.445.716	3,42
	Gesundheitswesen - 1.598.252		
	(31. Dezember 2022: 1.640.471)	1.598.252	3,78
748.063	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	685.293	1,62
154.173	Rede D'O'r Sao Luiz SA '144A'	912.959	2,16
	Industrie - 3.286.996		
	(31. Dezember 2022: 2.999.089)	3.286.996	7,78
12.117	Embraer SA	55.925	0,13
79.780	Embraer SA ADR	1.480.717	3,51
907.904	Santos Brasil Participacoes SA	1.750.354	4,14
	Versorger - 3.642.074		
	(31. Dezember 2022: 3.102.563)	3.642.074	8,62
402.237	AES Brasil Energia SA	1.019.338	2,41
133.009	Centrais Eletricas Brasileiras SA	1.160.981	2,75
72.864	Cia Paranaense de Energia ADR	617.887	1,46

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Versorger Forts.		
7.448	Companhia Paranaense de Energia	14.558	0,03
21.100	Companhia Paranaense de Energia - Preference	45.001	0,11
45.758	CPFL Energia SA	362.289	0,86
45.334	Engie Brasil Energia SA	422.020	1,00
Gesamtanlagen in Aktien		42.266.732	100,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 85.682 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 26.041)		85.682	0,20
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		42.352.414	100,22
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (3.388) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.058))		(3.388)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(3.388)	(0,01)
Kurzfristige Nettoverbindlichkeiten		(88.826)	(0,21)
Summe Nettovermögen		42.260.200	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,94
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,19
Sonstiges Umlaufvermögen	3,87
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	127	139	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	7.021	7.755	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	4.038	4.433	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Euro	US-Dollar	8.026	8.821	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	63
Euro	US-Dollar	6.094	6.664	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	82
Euro	US-Dollar	24.851	27.350	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	159
Euro	US-Dollar	1.794	1.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	32
Euro	US-Dollar	11.421	12.347	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	295
Euro	US-Dollar	700.484	753.606	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21.793
USD						22.479
EUR						20.316
Euro	US-Dollar	8.064	8.957	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(31)
Euro	US-Dollar	3.815	4.238	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Euro	139	127	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	13.589	12.353	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(85)
US-Dollar	Euro	17.269	15.784	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(203)
US-Dollar	Euro	53.502	48.688	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(394)
US-Dollar	Euro	27.108	24.801	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(346)
US-Dollar	Euro	11.397	10.418	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(135)
US-Dollar	Euro	23.307	21.559	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(557)
US-Dollar	Euro	8.591	7.950	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(210)
USD						(1.978)
EUR						(1.788)
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	23.222	25.651	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	55
Euro	US-Dollar	12.150	13.337	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	113
Euro	US-Dollar	23.342	25.655	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	183
Euro	US-Dollar	17.650	19.298	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	239
Euro	US-Dollar	71.991	79.230	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	460
Euro	US-Dollar	1.997.728	2.149.228	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	62.153
USD						63.203
EUR						57.122
Euro	US-Dollar	26.900	29.881	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(104)
Euro	US-Dollar	12.649	14.054	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Euro	43.663	39.691	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(272)
US-Dollar	Euro	32.845	30.024	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(389)
US-Dollar	Euro	24.265	22.456	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(593)
USD						(1.410)
EUR						(1.274)

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen			
Vereinigte Staaten von Amerika - 23.740.707 (31. Dezember 2022: 20.968.150)		23.740.707	91,37
2.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2024	1.999.419	7,70
2.300.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2024	2.289.903	8,81
5.068.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2024~	5.030.361	19,36
2.300.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Feb-2024	2.280.512	8,78
2.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Mar-2024	1.981.218	7,63
2.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	1.977.236	7,61
2.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Mar-2024	1.975.195	7,60
2.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Apr-2024	1.973.159	7,59
4.300.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	4.233.704	16,29
Gesamtanlagen in Anleihen		23.740.707	91,37
Aktien-Swaps			
Vereinigte Staaten von Amerika - 166.243 (31. Dezember 2022: 119.577)		166.243	0,64
45.070	Goldman Sachs Commodity Strategy 26-Jun-2026	60.849	0,23
(194.741)	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSCA Index 20-Nov-2024	105.394	0,41
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		166.243	0,64
Credit Default Swaps			
Credit Default Swaps - 216.043 (31. Dezember 2022: 15.440)			
(990.000)	CDX North American High Yield Index Series 41 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	57.750	0,22
(1.800.000)	iTraxx Europe Crossover Index Series 40 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	158.293	0,61
Credit Default Swaps insgesamt		216.043	0,83
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 431.727 (31. Dezember 2022: 553.131)			
(1)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Apr-2024	(16.951)	1.646 0,01
(5)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Feb-2024	(76.477)	6.170 0,02
(16)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Jan-2024	(224.819)	26.579 0,10
(2)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(32.534)	4.071 0,02
2	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	204.770	14.356 0,06
1	E-mini S&P MidCap 400 Long Futures Contracts Exp Mar-2024	280.950	13.968 0,05
13	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.709.964	24.028 0,09
6	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	938.711	6.287 0,02
8	Euro-OAT Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.161.444	8.846 0,03
5	FTSE 100 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	494.341	10.537 0,04
24	FTSE-Xinhua China A50 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2024	275.880	6.953 0,03
1	Hang Seng China Enterprises Index Long Futures Contracts Exp Jan-2024	37.113	1.281 0,00
11	Japanese 10 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	11.445.461	127.115 0,49
6	KOSPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	422.432	27.549 0,11
3	S&P TSX 60 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	575.254	17.312 0,07

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
39	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	3.100.572	35.896	0,14
1	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	72.817	659	0,00
9	SGX FTSE Taiwan Index Long Futures Contracts Exp Jan-2024	558.180	3.397	0,01
10	South Korea Ten Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	896.809	11.977	0,05
18	South Korea Three Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.473.375	6.045	0,02
9	SPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.162.980	11.786	0,05
6	TOPIX Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.006.808	8.666	0,03
9	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.124.437	35.798	0,14
5	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	667.969	5.054	0,02
4	UK Long Gilt Long Futures Contracts Exp Mar-2024	523.372	15.751	0,06
Offene Terminkontrakte insgesamt			431.727	1,66
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 175.806 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 202.904)			175.806	0,68
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			24.730.526	95,18
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien-Swaps				
Vereinigte Staaten von Amerika - (400.853)		(400.853)	(1,54)	
46.284	Bank of America Shore 2D Index 29-Jan-2024	(59.244)	(0,23)	
246.756	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSL Index 20-Nov-2024	(341.609)	(1,31)	
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		(400.853)	(1,54)	
Credit Default Swaps				
Credit Default Swaps - (151.510) (31. Dezember 2022: (47.527))				
3.500.000	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(67.890)	(0,26)	
3.900.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(83.620)	(0,32)	
Credit Default Swaps insgesamt		(151.510)	(0,58)	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (475.439) (31. Dezember 2022: (1.080.618))				
(9)	BOVESPA Index Short Futures Contracts Exp Feb-2024	(251.587)	(12.506)	(0,05)
4	CAC 40 10 Euro Index Long Futures Contracts Exp Jan-2024	333.614	(1.179)	(0,01)
(22)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.061.779)	(99.164)	(0,38)
(1)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp May-2024	(17.358)	(311)	(0,00)
(19)	CME Three-Month Secured Overnight Financing Rate ("SOFR") Short Futures Contracts Exp Dec-2024	(4.555.488)	(7.888)	(0,03)
6	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	300.915	(2.148)	(0,01)
(69)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(9.085.863)	(98.753)	(0,38)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(5)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(757.420)	(14.523)	(0,06)
(8)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(940.963)	(2.438)	(0,01)
3	FTSE MIB Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	505.405	(656)	(0,00)
(8)	FTSE/JSE Africa Top 40 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(312.215)	(8.682)	(0,03)
9	IBEX 35 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2024	1.002.119	(5.003)	(0,02)
(25)	ME Three-Month Canadian Overnight Repo Rate Average ("CORRA") Short Futures Contracts Exp Dec-2024	(4.530.961)	(2.407)	(0,01)
(2)	OMX Stockholm 30 Index Short Futures Contracts Exp Jan-2024	(47.615)	(1.148)	(0,00)
(14)	SGX MSCI Singapore Index Short Futures Contracts Exp Jan-2024	(305.194)	(8.810)	(0,03)
(17)	SGX Nifty 50 Short Futures Contracts Exp Jan-2024	(742.849)	(4.408)	(0,02)
(17)	Three Month EURIBOR Short Futures Contracts Exp Dec-2024	(4.583.877)	(10.117)	(0,04)
(8)	Three Month SONIA Index Short Futures Contracts Exp Dec-2024	(2.447.585)	(7.880)	(0,03)
(17)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.919.141)	(60.329)	(0,23)
(7)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.441.399)	(14.122)	(0,05)
(48)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(5.221.125)	(112.967)	(0,44)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(475.439)	(1,83)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (166.325) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (201.075))			(166.325)	(0,64)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.194.127)	(4,59)
Nettoumlaufvermögen			2.446.462	9,41
Summe Nettovermögen			25.982.861	100,00
–Wird von Goldman Sachs als Sicherheit in Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Terminkontrakten gehalten. 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				83,69
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				1,52
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				1,97
Sonstiges Umlaufvermögen				12,82
Gesamtvermögen			100,00	

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund							
Australischer Dollar	US-Dollar	500.000	337.033	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	4.499	
Australischer Dollar	US-Dollar	1.000.000	671.018	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	12.045	
Brasilianischer Real	US-Dollar	3.600.000	728.391	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	7.239	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.400.000	1.044.164	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	13.533	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	800.000	599.145	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	5.254	
Euro	US-Dollar	600.000	657.540	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	6.922	
Euro	US-Dollar	100.000	110.081	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	662	
Indische Rupie	US-Dollar	169.000.000	2.021.507	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	1.987	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	40.100.000	2.286.492	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	44.944	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.300.000	807.577	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	14.381	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	500.000	311.103	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	5.035	
Norwegische Krone	US-Dollar	1.700.000	162.175	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	5.441	
Norwegische Krone	US-Dollar	2.800.000	267.934	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	8.140	
Pfund Sterling	US-Dollar	900.000	1.147.405	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	223	
Pfund Sterling	US-Dollar	400.000	508.295	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.762	
Schwedische Krone	US-Dollar	3.700.000	362.011	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	5.970	
Schweizer Franken	US-Dollar	700.000	815.431	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	23.633	
Schweizer Franken	US-Dollar	200.000	238.478	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	1.254	
US-Dollar	Tschechische Krone	292.518	6.500.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	2.468	
US-Dollar	Koreanischer Won	1.786.489	2.298.300.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	3.615	
US-Dollar	Polnischer Zloty	76.306	300.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	144	
Japanischer Yen	US-Dollar	30.700.000	218.241	21. Mrz. 24	Goldman Sachs International	2.218	
Japanischer Yen	US-Dollar	118.600.000	849.208	21. Mrz. 24	Goldman Sachs International	2.468	
USD						173.837	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	400.000	303.712	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.513)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	417.500.000	480.465	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(8.671)	
Euro	US-Dollar	200.000	222.809	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.322)	
Ungarischer Forint	US-Dollar	732.400.000	2.100.303	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(7.457)	
Schweizer Franken	US-Dollar	200.000	241.053	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.321)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	206.272	3.190.200.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(909)	
US-Dollar	Israelischer Schekel	2.404.119	8.800.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(32.239)	
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	2.305.786	10.700.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(41.222)	
US-Dollar	Philippinischer Peso	1.305.793	72.700.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(7.321)	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	161.866	3.000.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.014)	
US-Dollar	Schwedische Krone	225.964	2.300.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.781)	
US-Dollar	Schweizer Franken	1.864.852	1.600.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(53.008)	
Japanischer Yen	US-Dollar	35.300.000	253.580	21. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(88)	
US-Dollar	Japanischer Yen	2.227.306	311.200.000	21. Mrz. 24	Morgan Stanley	(7.445)	
USD						(166.311)	
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)							
Schweizer Franken	US-Dollar	112	128	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5	
Schweizer Franken	US-Dollar	9.639	10.997	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	476	
USD						481	
CHF						405	
US-Dollar	Schweizer Franken	178	154	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Schweizer Franken	103	89	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
					USD	(8)
					CHF	(7)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	118	128	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	10.163	10.934	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	290
US-Dollar	Euro	101	92	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	—
					USD	293
					EUR	265
US-Dollar	Euro	173	158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(2)
					EUR	(2)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	117	127	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	10.111	10.878	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	289
US-Dollar	Euro	101	92	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	—
					USD	292
					EUR	265
US-Dollar	Euro	172	158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(2)
					EUR	(2)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	119	129	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	10.234	11.010	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	293
US-Dollar	Euro	102	92	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	—
					USD	296
					EUR	268
US-Dollar	Euro	174	160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(2)
					EUR	(2)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	122	152	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	10.456	13.129	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
US-Dollar	Pfund Sterling	206	162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	—

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	120	94	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						202
GBP						158
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	121	151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	10.401	13.060	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	198
US-Dollar	Pfund Sterling	205	161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	119	93	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						201
GBP						158
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	123	154	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	10.527	13.218	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	201
US-Dollar	Pfund Sterling	207	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	120	94	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						204
GBP						160

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Staatsanleihen - 17.817.573			
(31. Dezember 2022: 49.486.621)			
500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2024	499.855	0,21
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2024	2.489.024	1,06
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2024	2.481.433	1,05
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Feb-2024	2.478.817	1,05
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	2.471.545	1,05
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Mar-2024	2.468.994	1,05
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Apr-2024	2.466.449	1,05
2.500.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	2.461.456	1,04
Gesamtanlagen in Anleihen		17.817.573	7,56
Aktien			
Grundstoffe - 3.974.688			
(31. Dezember 2022: 10.346.086)			
1.109	Air Products and Chemicals Inc	303.755	0,13
586	Albemarle Corp	84.651	0,04
491	Celanese Corp - Class A	76.328	0,03
954	CF Industries Holdings Inc	75.848	0,03
3.503	Dow Inc	192.087	0,08
2.148	DuPont de Nemours Inc	165.299	0,07
630	Eastman Chemical Co	56.599	0,02
1.267	Ecolab Inc	251.303	0,11
666	FMC Corp	41.981	0,02
7161	Freeport-McMoRan Inc	304.665	0,13
1.254	International Flavors & Fragrances Inc	101.555	0,04
1.688	International Paper Co	61.021	0,03
2.421	Linde Plc	994.535	0,42
1.280	LyondellBasell Industries NV	121.677	0,05
1.610	Mosaic Co/The	57.517	0,02
5.755	Newmont Corp	238.171	0,10
1.228	Nucor Corp	213.764	0,09
1.178	PPG Industries Inc	176.164	0,08
1.176	Sherwin-Williams Co/The	366.930	0,16
769	Steel Dynamics Inc	90.838	0,04
Kommunikation - 28.158.690			
(31. Dezember 2022: 50.502.670)			
2.171	Airbnb Inc	295.668	0,13
24.873	Alphabet Inc	3.505.974	1,49
29.554	Alphabet Inc - Class A	4.128.842	1,75
45.414	Amazon.com Inc	6.900.430	2,93
1.258	Arista Networks Inc	296.190	0,13
35.706	AT&T Inc	600.039	0,25
174	Booking Holdings Inc	616.880	0,26
669	CDW Corp/DE	152.117	0,06
502	Charter Communications Inc	195.147	0,08
20.228	Cisco Systems Inc	1.022.020	0,43
20.054	Comcast Corp	879.869	0,37
3.835	Corning Inc	116.757	0,05
2.603	eBay Inc	113.582	0,05
579	Etsy Inc	46.937	0,02
673	Expedia Group Inc	102.192	0,04
317	F5 Inc	56.753	0,02
190	FactSet Research Systems Inc	90.564	0,04
771	Fox Corp	21.322	0,01
1.160	Fox Corp	34.417	0,01
2.738	Gen Digital Inc	62.467	0,03
1.864	Interpublic Group of Cos Inc/The	60.832	0,03
1.515	Juniper Networks Inc	44.655	0,02
1.304	Match Group Inc	47.596	0,02
11.084	Meta Platforms Inc - Class A	3.923.736	1,67
829	Motorola Solutions Inc	259.510	0,11
2.186	Netflix Inc	1.064.451	0,45
598	News Corp	15.384	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Kommunikation Forts.			
2.022	News Corp	49.670	0,02
971	Omnicom Group Inc	84.016	0,04
1.552	Palo Alto Networks Inc	457.568	0,19
2.614	Paramount Global - Class B	38.661	0,02
2.541	T-Mobile US Inc	407.462	0,17
10.277	Uber Technologies Inc	632.806	0,27
444	VeriSign Inc	91.420	0,04
20.995	Verizon Communications Inc	791.407	0,34
9.138	Walt Disney Co/The	825.070	0,35
11.082	Warner Bros Discovery Inc	126.279	0,05
Zyklische Konsumgüter - 18.201.419			
(31. Dezember 2022: 42.044.896)			
3.438	American Airlines Group Inc	47.221	0,02
1.413	Aptiv Plc	126.781	0,05
88	AutoZone Inc	227.287	0,10
1.080	Bath & Body Works Inc	46.597	0,02
953	Best Buy Co Inc	74.563	0,03
1.255	BorgWarner Inc	44.998	0,02
1.144	Caesars Entertainment Inc	53.636	0,02
830	CarMax Inc	63.674	0,03
4.950	Carnival Corp	91.847	0,04
137	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	313.122	0,13
4.364	Copart Inc	213.858	0,09
2.211	Costco Wholesale Corp	1.459.846	0,62
708	Cummins Inc	169.619	0,07
601	Darden Restaurants Inc	98.723	0,04
3.213	Delta Air Lines Inc	129.307	0,05
1.096	Dollar General Corp	148.974	0,06
1.044	Dollar Tree Inc	148.305	0,06
174	Domino's Pizza Inc	71.725	0,03
1.505	DR Horton Inc	228.722	0,10
2.854	Fastenal Co	184.825	0,08
19.637	Ford Motor Co	239.277	0,10
6.839	General Motors Co	245.623	0,10
690	Genuine Parts Co	95.500	0,04
698	Hasbro Inc	35.640	0,01
1.281	Hilton Worldwide Holdings Inc	233.168	0,10
4.994	Home Depot Inc/The	1.730.446	0,73
1.877	Las Vegas Sands Corp	92.358	0,04
1.249	Lennar Corp	186.107	0,08
686	Live Nation Entertainment Inc	64.220	0,03
1.296	LKQ Corp	61.942	0,03
2.882	Lowe's Cos Inc	641.173	0,27
575	Lululemon Athletica Inc	294.038	0,12
1.232	Marriott International Inc/MD	277.859	0,12
3.622	McDonald's Corp	1.073.615	0,46
1.349	MGM Resorts International	60.267	0,03
6.113	NIKE Inc	663.383	0,28
2.270	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	45.480	0,02
16	NVR Inc	112.197	0,05
295	O'Reilly Automotive Inc	280.346	0,12
2.612	PACCAR Inc	255.088	0,11
193	Pool Corp	76.977	0,03
1.081	PulteGroup Inc	111.586	0,05
189	Ralph Lauren Corp - Class A	27.251	0,01
1.691	Ross Stores Inc	234.026	0,10
1.177	Royal Caribbean Cruises Ltd	152.380	0,06
2.927	Southwest Airlines Co	84.517	0,04
5.706	Starbucks Corp	547.862	0,23
1.235	Tapestry Inc -	45.454	0,02
2.305	Target Corp	328.267	0,14
13.811	Tesla Inc	3.431.826	1,46
5.713	TJX Cos Inc/The	535.908	0,23
540	Tractor Supply Co	116.132	0,05
246	Ulta Beauty Inc	120.530	0,05
1.601	United Airlines Holdings Inc	66.065	0,03
1.674	VF Corp	31.471	0,01
3.581	Walgreens Boots Alliance Inc	93.554	0,04
7.124	Walmart Inc	1.123.063	0,48
295	Whirlpool Corp	35.909	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Zyklische Konsumgüter Forts.		
221	WW Grainger Inc	183.318	0,08
451	Wynn Resorts Ltd	41.091	0,02
1.400	Yum! Brands Inc	182.875	0,08
	Nicht-zyklische Konsumgüter - 37.711.106		
	(31. Dezember 2022: 109.319.531)	37.711.106	16,00
8.666	Abbott Laboratories	954.083	0,41
3.358	AbbVie Inc	520.507	0,22
5.459	AbbVie Inc	846.172	0,36
356	Align Technology Inc	97.572	0,04
8.832	Altria Group Inc	356.239	0,15
833	AmerisourceBergen Corp	171.052	0,07
2.673	Amgen Inc	769.984	0,33
2.664	Archer-Daniels-Midland Co	192.354	0,08
2.054	Automatic Data Processing Inc	478.582	0,20
396	Avery Dennison Corp	80.057	0,03
2.488	Baxter International Inc	96.174	0,04
1.449	Becton Dickinson & Co	353.397	0,15
724	Biogen Inc	187.397	0,08
111	Bio-Rad Laboratories Inc	35.867	0,02
825	Bio-Techne Corp	63.673	0,03
7.312	Boston Scientific Corp	422.780	0,18
10.161	Bristol-Myers Squibb Co	521.208	0,22
876	Brown-Forman Corp	50.002	0,02
745	Bunge Global SA	75.200	0,03
1.058	Campbell Soup Co	45.732	0,02
1.231	Cardinal Health Inc	124.066	0,05
959	Catalent Inc	43.093	0,02
2.668	Centene Corp	197.899	0,08
270	Charles River Laboratories International Inc	63.832	0,03
1.230	Church & Dwight Co Inc	116.340	0,05
1.461	Cigna Corp	437.591	0,19
432	Cintas Corp	260.390	0,11
608	Clorox Co/The	86.676	0,04
19.432	Coca-Cola Co/The	1.145.031	0,49
4.112	Colgate-Palmolive Co	327.788	0,14
2.342	Conagra Brands Inc	67.133	0,03
807	Constellation Brands Inc - Class A	195.225	0,08
247	Cooper Cos Inc/The	93.504	0,04
3.519	Corteva Inc	168.648	0,07
2.039	CoStar Group Inc	178.229	0,08
6.414	CVS Health Corp	506.417	0,22
3.284	Danaher Corp	760.000	0,32
269	DaVita Inc	28.178	0,01
1.131	DENTSPLY SIRONA Inc	40.241	0,02
1.930	Dexcom Inc	239.561	0,10
3.029	Edwards Lifesciences Corp	231.037	0,10
1.173	Elevance Health Inc	553.363	0,23
3.982	Eli Lilly & Co	2.322.880	0,99
615	Equifax Inc	152.194	0,06
1.160	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	169.737	0,07
364	FleetCor Technologies Inc	102.872	0,04
392	Gartner Inc	176.833	0,08
1.922	GE HealthCare Technologies Inc	148.638	0,06
2.903	General Mills Inc	189.058	0,08
6.223	Gilead Sciences Inc	504.187	0,21
1.300	Global Payments Inc	165.093	0,07
989	HCA Healthcare Inc	267.737	0,11
690	Henry Schein Inc	52.250	0,02
749	Hershey Co/The	139.640	0,06
1.223	Hologic Inc	87.377	0,04
1.544	Hormel Foods Corp	49.586	0,02
615	Humana Inc	281.449	0,12
415	IDEXX Laboratories Inc	230.398	0,10
778	Illumina Inc	108.336	0,05
982	Incyte Corp	61.665	0,03
341	Insulet Corp	73.982	0,03
1.758	Intuitive Surgical Inc	593.114	0,25
914	IQVIA Holdings Inc	211.495	0,09
512	J M Smucker Co/The	64.681	0,03
12.022	Johnson & Johnson	1.884.448	0,80

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.		
1.294	Kellogg Co	72.335	0,03
8.607	Kenvue Inc	185.266	0,08
5.028	Keurig Dr Pepper Inc	167.558	0,07
1.688	Kimberly-Clark Corp	205.084	0,09
3.981	Kraft Heinz Co/The	147.237	0,06
3.378	Kroger Co/The	154.425	0,07
430	Laboratory Corp of America Holdings	97.711	0,04
724	Lamb Weston Holdings Inc	78.290	0,03
197	MarketAxess Holdings Inc	57.705	0,02
1.234	McCormick & Co Inc/MD	84.412	0,04
664	McKesson Corp	307.402	0,13
6.645	Medtronic Plc	547.648	0,23
12.655	Merck & Co Inc	1.379.775	0,59
1.657	Moderna Inc	164.822	0,07
291	Molina Healthcare Inc	105.170	0,04
895	Molson Coors Beverage Co - Class B	54.770	0,02
6.794	Mondelez International Inc	492.123	0,21
3.689	Monster Beverage Corp	212.579	0,09
786	Moody's Corp	306.976	0,13
5.384	PayPal Holdings Inc	330.605	0,14
6.866	PepsiCo Inc	1.166.190	0,49
596	PerkinElmer Inc	65.164	0,03
28.198	Pfizer Inc	811.679	0,34
7.753	Philip Morris International Inc	729.519	0,31
11.770	Procter & Gamble Co/The	1.725.070	0,73
726	Quanta Services Inc	156.718	0,07
551	Quest Diagnostics Inc	75.958	0,03
535	Regeneron Pharmaceuticals Inc	469.941	0,20
735	ResMed Inc	126.435	0,05
503	Robert Half International Inc	44.231	0,02
1.355	Rollins Inc	59.180	0,03
730	S&P Global Inc	321.704	0,14
888	S&P Global Inc	391.333	0,17
485	STERIS Plc	106.615	0,05
1.688	Stryker Corp	505.902	0,21
2.518	Sysco Corp	184.116	0,08
248	Teleflex Inc	61.845	0,03
1.930	Thermo Fisher Scientific Inc	1.025.303	0,44
1.398	Tyson Foods Inc - Class A	75.136	0,03
338	United Rentals Inc	193.873	0,08
4.619	UnitedHealth Group Inc	2.433.012	1,03
300	Universal Health Services Inc	45.732	0,02
724	Verisk Analytics Inc - Class A	172.993	0,07
1.287	Vertex Pharmaceuticals Inc	523.854	0,22
3.081	Viatis Inc	33.444	0,01
2.685	Viatis Inc	29.146	0,01
290	Waters Corp	95.451	0,04
369	West Pharmaceutical Services Inc	129.989	0,06
1.044	Zimmer Biomet Holdings Inc	127.060	0,05
2.293	Zoetis Inc	452.696	0,19
	Energie - 7.950.680		
	(31. Dezember 2022: 25.314.129)	7.950.680	3,37
1.478	APA Corp	53.023	0,02
5.025	Baker Hughes Co - Class A	171.780	0,07
8.767	Chevron Corp	1.307.554	0,56
5.930	ConocoPhillips	688.265	0,29
3.722	Coterra Energy Inc	94.967	0,04
3.200	Devon Energy Corp	144.976	0,06
894	Diamondback Energy Inc	138.664	0,06
669	Enphase Energy Inc	88.412	0,04
2.912	EOG Resources Inc	352.192	0,15
2.054	EQT Corp	79.418	0,03
20.004	Exxon Mobil Corp	2.000.100	0,85
534	First Solar Inc	92.032	0,04
4.470	Halliburton Co	161.568	0,07
1.381	Hess Corp	199.140	0,09
9.657	Kinder Morgan Inc	170.301	0,07
2.985	Marathon Oil Corp	72.073	0,03
1.896	Marathon Petroleum Corp	281.243	0,12
3.297	Occidental Petroleum Corp	196.847	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Energie Forts.			
2.909	ONEOK Inc	204.226	0,09
2.197	Phillips 66	292.476	0,12
1.165	Pioneer Natural Resources Co	262.142	0,11
7.134	Schlumberger Ltd	371.218	0,16
1.099	Targa Resources Corp	95.465	0,04
1.700	Valero Energy Corp	220.975	0,09
6.075	Williams Cos Inc/The	211.623	0,09
Finanzwerte - 28.175.104			
(31. Dezember 2022: 73.027.040)			
2.656	Aflac Inc	219.133	0,09
765	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	97.010	0,04
1.307	Allstate Corp/The	183.045	0,08
2.875	American Express Co	538.617	0,23
3.506	American International Group Inc	237.514	0,10
2.328	American Tower Corp (REIT)	502.976	0,21
505	Ameriprise Financial Inc	191.885	0,08
1.000	Aon Plc	290.965	0,12
1.864	Arch Capital Group Ltd	138.458	0,06
1.078	Arthur J Gallagher & Co	242.469	0,10
258	Assurant Inc	43.476	0,02
709	AvalonBay Communities Inc (REIT)	132.728	0,06
34.383	Bank of America Corp	1.157.676	0,49
3.841	Bank of New York Mellon Corp/The	199.886	0,08
9.086	Berkshire Hathaway Inc - Class B	3.243.611	1,38
698	BlackRock Inc	567.122	0,24
3.548	Blackstone Inc	464.557	0,20
752	Boston Properties Inc (REIT)	52.768	0,02
1.157	Brown & Brown Inc	82.292	0,04
569	Camden Property Trust (REIT)	56.507	0,02
1.902	Capital One Financial Corp	249.371	0,11
527	Cboe Global Markets Inc	94.093	0,04
1.522	CBRE Group Inc - Class A	141.736	0,06
7.432	Charles Schwab Corp/The	511.730	0,22
2.037	Chubb Ltd	460.474	0,20
784	Cincinnati Financial Corp	81.117	0,03
9.558	Citigroup Inc	491.855	0,21
2.328	Citizens Financial Group Inc	77.162	0,03
1.798	CME Group Inc	378.758	0,16
658	Comerica Inc	36.720	0,02
2.167	Crown Castle Inc (REIT)	249.584	0,11
1.512	Digital Realty Trust Inc (REIT)	203.583	0,09
1.249	Discover Financial Services	140.381	0,06
469	Equinix Inc (REIT)	377.815	0,16
1.726	Equity Residential (REIT)	105.571	0,04
314	Essex Property Trust Inc (REIT)	77.864	0,03
217	Everest Re Group Ltd	76.728	0,03
1.055	Extra Space Storage Inc (REIT)	169.259	0,07
383	Federal Realty Investment Trust (REIT)	39.478	0,02
3.401	Fifth Third Bancorp	117.317	0,05
1.320	Franklin Resources Inc	39.316	0,02
417	Globe Life Inc	50.784	0,02
1.629	Goldman Sachs Group Inc/The	628.436	0,27
1.505	Hartford Financial Services Group Inc/The	120.949	0,05
2.891	Healthpeak Properties Inc (REIT)	57.227	0,02
3.462	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	67.457	0,03
71.14	Huntington Bancshares Inc/OH	90.526	0,04
2.858	Intercontinental Exchange Inc	367.053	0,16
2.407	Invesco Ltd	42.929	0,02
2.826	Invitation Homes Inc (REIT)	96.352	0,04
1.434	Iron Mountain Inc (REIT)	100.373	0,04
14.437	JPMorgan Chase & Co	2.457.971	1,04
4.523	KeyCorp	65.154	0,03
3.046	KRC Interim Corp (REIT)	64.865	0,03
903	Loews Corp	62.831	0,03
859	M&T Bank Corp	117.722	0,05
2.462	Marsh & McLennan Cos Inc	466.487	0,20
4.135	Mastercard Inc	1.763.929	0,75
3.105	MetLife Inc	205.365	0,09
573	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	77.051	0,03
6.311	Morgan Stanley	588.722	0,25

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Finanzwerte Forts.			
1.773	Nasdaq Inc	103.091	0,04
1.017	Northern Trust Corp	85.789	0,04
1.989	PNC Financial Services Group Inc/The	308.086	0,13
1.097	Principal Financial Group Inc	86.317	0,04
2.922	Progressive Corp/The	465.635	0,20
4.614	Prologis Inc (REIT)	615.115	0,26
1.803	Prudential Financial Inc	186.980	0,08
790	Public Storage (REIT)	241.065	0,10
924	Raymond James Financial Inc	103.035	0,04
3.615	Realty Income Corp (REIT)	207.628	0,09
784	Regency Centers Corp (REIT)	52.532	0,02
4.645	Regions Financial Corp	89.950	0,04
539	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	136.760	0,06
1.629	Simon Property Group Inc (REIT)	232.361	0,10
1.544	State Street Corp	119.606	0,05
2.066	Synchrony Financial	78.890	0,03
1.116	T Rowe Price Group Inc	120.188	0,05
1.141	Travelers Cos Inc/The	217.366	0,09
6.660	Truist Financial Corp	245.954	0,10
1.443	UDR Inc (REIT)	55.245	0,02
7.776	US Bancorp	336.584	0,14
1.977	Ventas Inc (REIT)	98.553	0,04
5.171	VICI Properties Inc (REIT)	164.851	0,07
7.960	Visa Inc - Class A	2.074.018	0,88
1.000	W R Berkley Corp	70.725	0,03
18.136	Wells Fargo & Co	892.745	0,38
2.764	Welltower Inc (REIT)	249.244	0,11
3.646	Weyerhaeuser Co (REIT)	126.790	0,05
517	Willis Towers Watson Plc	124.721	0,05
695	Zions Bancorp NA	30.490	0,01
Industrie - 15.606.306			
(31. Dezember 2022: 39.387.869)			
2.758	3M Co	301.477	0,13
588	A O Smith Corp	48.478	0,02
1.461	Agilent Technologies Inc	203.101	0,09
466	Allegion plc	59.035	0,03
7.256	Amcor Plc	69.984	0,03
1.153	AMETEK Inc	190.164	0,08
2.988	Amphenol Corp - Class A	296.305	0,13
345	Axon Enterprise Inc	89.133	0,04
1.575	Ball Corp	90.602	0,04
2.840	Boeing Co/The	740.629	0,31
616	Builders FirstSource Inc	102.909	0,04
4.190	Carrier Global Corp	240.757	0,10
2.548	Caterpillar Inc	753.609	0,32
620	CH Robinson Worldwide Inc	53.568	0,02
9.869	CSX Corp	342.208	0,15
1.338	Deere & Co	535.160	0,23
687	Dover Corp	105.650	0,05
1.994	Eaton Corp Plc	480.504	0,20
2.847	Emerson Electric Co	277.113	0,12
729	Expeditors International of Washington Inc	92.725	0,04
1.155	FedEx Corp	292.209	0,12
1.755	Fortive Corp	129.247	0,06
753	Garmin Ltd	96.817	0,04
333	Generac Holdings Inc	43.049	0,02
1.131	General Dynamics Corp	293.647	0,12
5.435	General Electric Co	693.696	0,29
3.292	Honeywell International Inc	690.415	0,29
1.924	Howmet Aerospace Inc	104.185	0,04
264	Hubbell Inc - Class B	86.892	0,04
212	Huntington Ingalls Industries Inc	55.070	0,02
371	IDEX Corp	80.566	0,03
1.367	Illinois Tool Works Inc	358.216	0,15
2.022	Ingersoll Rand Inc	156.422	0,07
639	Jabil Inc	81.425	0,03
619	Jacobs Solutions Inc	80.331	0,03
401	JB Hunt Transport Services Inc	80.112	0,03
3.397	Johnson Controls International plc	195.786	0,08
887	Keysight Technologies Inc	141.144	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Industrie Forts.		
947	L3Harris Technologies Inc	199.509	0,09
1.103	Lockheed Martin Corp	500.006	0,21
309	Martin Marietta Materials Inc	154.193	0,07
1.103	Masco Corp	73.884	0,03
108	Mettler-Toledo International Inc	131.194	0,06
285	Mohawk Industries Inc	29.499	0,01
264	Nordson Corp	69.745	0,03
1.129	Norfolk Southern Corp	267.025	0,11
708	Northrop Grumman Corp	331.744	0,14
447	Old Dominion Freight Line Inc	181.129	0,08
2.044	Otis Worldwide Corp	182.969	0,08
442	Packaging Corp of America	72.070	0,03
642	Parker-Hannifin Corp	295.885	0,13
874	Pentair Plc	63.535	0,03
7181	Raytheon Technologies Corp	604.245	0,26
1.021	Republic Services Inc - Class A	168.363	0,07
573	Rockwell Automation Inc	177.845	0,08
264	Snap-on Inc	76.285	0,03
752	Stanley Black & Decker Inc	73.767	0,03
1.552	TE Connectivity Ltd	218.141	0,09
246	Teledyne Technologies Inc	109.914	0,05
979	Textron Inc	78.756	0,03
1.141	Trane Technologies Plc	278.387	0,12
276	TransDigm Group Inc	279.338	0,12
1.199	Trimble Inc	63.793	0,03
3.044	Union Pacific Corp	747.835	0,32
3.612	United Parcel Service Inc - Class B	568.059	0,24
1.095	Veralto Corp	90.069	0,04
664	Vulcan Materials Co	150.695	0,06
1.830	Waste Management Inc	328.018	0,14
895	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	113.589	0,05
1.368	Westrock Co	56.772	0,02
1.204	Xylem Inc/NY	137.708	0,06
	Technologie - 55.521.222		
	(31. Dezember 2022: 100.949.706)	55.521.222	23,55
3.134	Accenture Plc - Class A	1.100.379	0,47
2.274	Adobe Inc	1.356.975	0,58
8.069	Advanced Micro Devices Inc	1.189.572	0,50
753	Akamai Technologies Inc	89.129	0,04
2.489	Analog Devices Inc	494.241	0,21
433	ANSYS Inc	157.144	0,07
73.009	Apple Inc	14.055.328	5,96
4.178	Applied Materials Inc	677.149	0,29
1.068	Autodesk Inc	260.058	0,11
2.192	Broadcom Inc	2.447.861	1,04
588	Broadridge Financial Solutions Inc	121.025	0,05
1.359	Cadence Design Systems Inc	370.185	0,16
746	Ceridian HCM Holding Inc	50.090	0,02
2.504	Cognizant Technology Solutions Corp	189.152	0,08
1.222	Electronic Arts Inc	167.157	0,07
288	EPAM Systems Inc	85.692	0,04
123	Fair Isaac Corp	143.403	0,06
2.959	Fidelity National Information Services Inc	177.732	0,07
2.997	Fiserv Inc	398.137	0,17
3.183	Fortinet Inc	186.317	0,08
6.407	Hewlett Packard Enterprise Co	108.759	0,05
4.343	HP Inc	130.703	0,06
21.054	Intel Corp	1.058.069	0,45
4.560	International Business Machines Corp	745.948	0,32
1.400	Intuit Inc	875.371	0,37
352	Jack Henry & Associates Inc	57.503	0,02
679	KLA Corp	394.794	0,17
658	Lam Research Corp	515.408	0,22
675	Leidos Holdings Inc	73.086	0,03
2.702	Microchip Technology Inc	243.680	0,10
5.483	Micron Technology Inc	467.947	0,20
371.16	Microsoft Corp	13.954.131	5,92
239	Monolithic Power Systems Inc	150.797	0,06
395	MSCI Inc - Class A	223.262	0,09
1.043	NetApp Inc	91.941	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Technologie Forts.		
12.335	NVIDIA Corp	6.108.477	2,59
1.287	NXP Semiconductors NV	295.630	0,12
2.151	ON Semiconductor Corp	179.716	0,08
7.935	Oracle Corp	836.389	0,35
1.606	Paychex Inc	191.283	0,08
259	Paycom Software Inc	53.513	0,02
619	PTC Inc	108.306	0,05
478	Qorvo Inc	53.820	0,02
5.558	QUALCOMM Inc	803.881	0,34
533	Roper Technologies Inc	290.632	0,12
4.859	Salesforce Inc	1.279.059	0,54
948	Seagate Technology Holdings Plc	80.959	0,03
1.024	ServiceNow Inc	724.014	0,31
796	Skyworks Solutions Inc	89.470	0,04
759	Synopsys Inc	390.680	0,17
790	Take-Two Interactive Software Inc	127.174	0,05
763	Teradyne Inc	82.831	0,03
4.535	Texas Instruments Inc	773.059	0,33
210	Tyler Technologies Inc	87.820	0,04
1.686	Western Digital Corp	88.304	0,04
249	Zebra Technologies Corp	68.080	0,03
	Versorger - 4.671.492		
	(31. Dezember 2022: 14.816.553)	4.671.492	1,98
3.233	AES Corp/The	62.251	0,03
1.232	Alliant Energy Corp	63.202	0,03
1.374	Ameren Corp	99.375	0,04
2.626	American Electric Power Co Inc	213.257	0,09
972	American Water Works Co Inc	128.299	0,05
729	Atmos Energy Corp	84.495	0,04
3.152	CenterPoint Energy Inc	90.037	0,04
1.433	CMS Energy Corp	83.200	0,03
1.724	Consolidated Edison Inc	156.824	0,07
1.595	Constellation Energy Corp	186.455	0,08
4.179	Dominion Energy Inc	196.413	0,08
1.030	DTE Energy Co	113.563	0,05
3.849	Duke Energy Corp	373.642	0,16
1.914	Edison International	136.813	0,06
1.056	Entergy Corp	106.830	0,05
1.111	Evergy Inc	58.005	0,02
1.744	Eversource Energy	107.622	0,05
4.971	Exelon Corp	178.484	0,08
2.536	FirstEnergy Corp	92.982	0,04
10.246	NextEra Energy Inc	622.240	0,26
1.978	NiSource Inc	52.506	0,02
1.100	NRG Energy Inc	56.865	0,02
10.655	PG&E Corp	192.163	0,08
611	Pinnacle West Capital Corp	43.888	0,02
3.681	PPL Corp	99.774	0,04
2.489	Public Service Enterprise Group Inc	152.165	0,06
3.143	Sempra Energy	234.986	0,10
5.446	Southern Co/The (Units)	381.955	0,16
1.575	WEC Energy Group Inc	132.591	0,06
2.756	Xcel Energy Inc	170.610	0,07
	Gesamtanlagen in Aktien	199.970.707	84,84
	Indexoptionen - 940.950		
	(31. Dezember 2022: 603.500)		
51	CME E-Mini S&P 500 Index Call 15-Mar-2024 4,850.000	218.663	0,09
51	CME E-Mini S&P W3 Index Call 16-Feb-2024 4,700.000	408.637	0,18
51	CME E-Mini S&P W3 Index Call 16-Feb-2024 4,750.000	313.650	0,13
	Indexoptionen insgesamt	940.950	0,40

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 457.572				
(31. Dezember 2022: (595.325))				
85	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	20.485.000	457.572	0,19
Offene Terminkontrakte insgesamt			457.572	0,19
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 1.687 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 812)			1.687	0,00
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			219.188.489	92,99
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (6) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (33))			(6)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(6)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen			16.525.292	7,01
Summe Nettovermögen			235.713.775	100,00
Der Kontrahent für Indexoptionen ist Citigroup Global Markets Limited. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.				
Portfolioanalyse			% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			92,09	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente			0,59	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,00	
Sonstiges Umlaufvermögen			7,32	
Gesamtvermögen			100,00	

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	616	681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	359	394	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	418	460	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	796	876	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	498	539	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	58.330	62.754	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.668
USD						1.687
EUR						1.528
Euro	US-Dollar	429	477	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	988	898	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
USD						(6)
EUR						(5)

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Euro - 44.176.974			
(31. Dezember 2022: 38.124.719)		44.176.974	20,20
100.000	888 Acquisitions Ltd 'REGS' 7.558% 15-Jul-2027	105.880	0,05
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV FRN (Perpetual) 2.625% 26-Jan-2027	100.933	0,05
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV FRN (Perpetual) 3.248% 24-Nov-2025	106.253	0,05
100.000	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA 'EMTN' 1.375% 17-Jun-2025	106.742	0,05
100.000	Adevinta ASA 'REGS' 3.000% 15-Nov-2027	110.127	0,05
100.000	Adler Financing Sarl 12.500% 30-Jun-2025	116.550	0,05
100.000	ADLER Group SA 5.000% 14-Jan-2029	36.654	0,02
100.000	Aedas Homes Opco SLU 'REGS' 4.000% 15-Aug-2026	104.461	0,05
100.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy 'REGS' 3.625% 04-Feb-2028	100.091	0,05
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031	105.981	0,05
100.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026	110.729	0,05
100.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 'REGS' 3.625% 01-Jun-2028	97.118	0,04
100.000	Allwyn International AS 'REGS' 3.875% 15-Feb-2027	106.586	0,05
100.000	Alpha Bank SA 'EMTN' FRN 6.875% 27-Jun-2029	117.642	0,05
100.000	Alpha Bank SA FRN 2.500% 23-Mar-2028	102.686	0,05
100.000	Alpha Services and Holdings SA 'EMTN' FRN 4.250% 13-Feb-2030	108.116	0,05
100.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	107.556	0,05
100.000	Altice Financing SA 'REGS' 3.000% 15-Jan-2028	98.918	0,04
200.000	Altice Financing SA 'REGS' 4.250% 15-Aug-2029	195.948	0,09
100.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	91.914	0,04
100.000	Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027	63.166	0,03
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028	87.919	0,04
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	88.357	0,04
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.250% 15-Oct-2029	88.062	0,04
300.000	Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027	295.722	0,13
100.000	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	55.456	0,02
100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029	89.275	0,04
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	98.415	0,04
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	98.718	0,04
100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl 'REGS' 1.875% 01-Feb-2028	98.819	0,04
100.000	Atlantia SpA 1.875% 12-Feb-2028	101.695	0,05
200.000	Atlantia SpA 'EMTN' 1.875% 13-Jul-2027	206.819	0,09
200.000	Atos SE 1.000% 12-Nov-2029	120.085	0,05
100.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	108.371	0,05
100.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	108.500	0,05
100.000	Avis Budget Finance Plc 'REGS' 4.750% 30-Jan-2026	110.513	0,05
150.000	Avis Budget Finance Plc 'REGS' 7.250% 31-Jul-2030	177.625	0,08
100.000	Azelis Finance NV 'REGS' 5.750% 15-Mar-2028	114.321	0,05
100.000	Banca IFIS SpA 'EMTN' 6.875% 13-Sep-2028	116.061	0,05
100.000	Banca Popolare di Sondrio SPA 'EMTN' FRN 1.250% 13-Jul-2027	103.255	0,05
100.000	Banca Transilvania SA 'EMTN' FRN 8.875% 27-Apr-2027	116.450	0,05
150.000	Banco BPM SpA 'EMTN' FRN 6.000% 21-Jan-2028	173.760	0,08
200.000	Banco BPM SpA 'EMTN' FRN 6.000% 14-Jun-2028	231.655	0,11
100.000	Banco BPM SpA FRN 5.000% 14-Sep-2030	112.154	0,05
100.000	Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 3.871% 27-Mar-2030	107.414	0,05
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 1.750% 09-Mar-2028	97.483	0,04
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	102.540	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	115.972	0,05
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 5.625% 06-May-2026	113.273	0,05
200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	216.528	0,10
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 6.000% 16-Aug-2033	112.147	0,05
100.000	Banco de Sabadell SA FRN 2.000% 17-Jan-2030	106.542	0,05
100.000	Banff Merger Sub Inc 'REGS' 8.375% 01-Sep-2026	109.891	0,05
100.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	110.548	0,05
100.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	108.438	0,05
100.000	Bank of Cyprus Plc 'EMTN' FRN 2.500% 24-Jun-2027	101.817	0,05
100.000	Bayer AG FRN 3.125% 12-Nov-2079	99.951	0,05
100.000	Bayer AG FRN 4.500% 25-Mar-2082	105.332	0,05
100.000	Bayer AG FRN 5.375% 25-Mar-2082	105.110	0,05
100.000	Bayer AG FRN 6.625% 25-Sep-2083	113.017	0,05
100.000	Bayer AG FRN 7.000% 25-Sep-2083	114.241	0,05
100.000	BCP V Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	102.626	0,05
100.000	BCP V Modular Services Finance Plc 'REGS' 6.750% 30-Nov-2029	90.704	0,04
100.000	Belden Inc 'REGS' 3.375% 15-Jul-2031	97.608	0,04
100.000	Belden Inc 'REGS' 3.875% 15-Mar-2028	107.198	0,05
100.000	Benteler International AG 'REGS' 9.375% 15-May-2028	117.902	0,05
100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 3.500% 23-Apr-2075	105.590	0,05
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl 'REGS' 5.250% 30-Apr-2029	110.164	0,05
100.000	Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025	110.933	0,05
200.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 1.375% 31-Mar-2027	210.537	0,10
100.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 3.625% 30-Nov-2030	108.665	0,05
200.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 8.625% 20-Jan-2033	241.518	0,11
200.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	197.970	0,09
100.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029	93.697	0,04
100.000	British Telecommunications Plc FRN 1.874% 18-Aug-2080	105.540	0,05
200.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	197.346	0,09
100.000	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA FRN 10.000% 30-Oct-2026	115.900	0,05
100.000	Canary Wharf Group Investment Holdings Plc 'REGS' 1.750% 07-Apr-2026	89.904	0,04
100.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027	101.509	0,05
100.000	Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026	112.647	0,05
100.000	Carnival Plc 1.000% 28-Oct-2029	80.054	0,04
100.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 3.580% 07-Feb-2025	899	0,00
100.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.048% 05-Aug-2026	899	0,00
200.000	Castellum AB FRN (Perpetual) 3.125% 02-Dec-2026	168.087	0,08
100.000	Castor SpA 'REGS' 6.000% 15-Feb-2029	100.712	0,05
100.000	Catalent Pharma Solutions Inc 'REGS' 2.375% 01-Mar-2028	96.394	0,04
300.000	CECONOMY AG 1.750% 24-Jun-2026	288.842	0,13
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 0.750% 15-Nov-2026	102.416	0,05
300.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.500% 08-Jun-2028	304.025	0,14
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Sep-2032	94.714	0,04
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033	94.022	0,04
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2026	107.357	0,05
100.000	Cellnex Telecom SA 1.000% 20-Apr-2027	102.005	0,05
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	97.091	0,04
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 2.875% 18-Apr-2025	109.645	0,05
100.000	Centurion Bidco SpA 'REGS' 5.875% 30-Sep-2026	108.462	0,05
100.000	CGG SA 'REGS' 7.750% 01-Apr-2027	101.959	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Chemours Co/The 4.000% 15-May-2026	108.867	0,05
100.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028	108.006	0,05
100.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	92.599	0,04
100.000	Chrome Holdco SASU 'REGS' 5.000% 31-May-2029	77.052	0,03
100.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 5.000% 01-Apr-2028	106.653	0,05
100.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.500% 15-Mar-2027	106.551	0,05
100.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 10.375% 30-Nov-2027	120.632	0,05
100.000	Citycon Oyj FRN (Perpetual) 4.496% 24-Nov-2024	87.046	0,04
100.000	Citycon Treasury BV 'EMTN' 1.625% 12-Mar-2028	88.764	0,04
100.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	109.607	0,05
120.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 23-Mar-2026	133.186	0,06
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 30-Mar-2027	16.844	0,01
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030	108.628	0,05
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 6.500% 06-Dec-2032	116.812	0,05
100.000	Consolidated Energy Finance SA 'REGS' 5.000% 15-Oct-2028	90.245	0,04
100.000	Constellium SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029	101.728	0,05
100.000	ContourGlobal Power Holdings SA 'REGS' 2.750% 01-Jan-2026	105.985	0,05
150.000	Coty Inc 'REGS' 3.875% 15-Apr-2026	165.675	0,08
100.000	CPI Property Group SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Aug-2026	33.216	0,01
100.000	Credito Emiliano Holding SpA FRN 3.500% 16-Dec-2030	104.277	0,05
100.000	Crown European Holdings SA 'REGS' 3.375% 15-May-2025	109.683	0,05
100.000	Crown European Holdings SA 'REGS' 5.000% 15-May-2028	114.684	0,05
100.000	CT Investment GmbH 'REGS' 5.500% 15-Apr-2026	109.905	0,05
100.000	Ctec II GmbH 'REGS' 5.250% 15-Feb-2030	98.579	0,04
100.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	86.194	0,04
100.000	Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029	97.812	0,04
100.000	Darling Global Finance BV 'REGS' 3.625% 15-May-2026	109.524	0,05
100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.875% 11-Feb-2025	108.706	0,05
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 2.875% 16-May-2027	106.558	0,05
200.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.000% 29-May-2026	215.445	0,10
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.500% 14-Jul-2029	107.828	0,05
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.750% 11-Feb-2028	109.206	0,05
100.000	DIC Asset AG 2.250% 22-Sep-2026	36.472	0,02
100.000	Dometic Group AB 'EMTN' 3.000% 08-May-2026	108.793	0,05
100.000	Douglas GmbH 'REGS' 6.000% 08-Apr-2026	109.628	0,05
100.000	doValue SpA 'REGS' 5.000% 04-Aug-2025	108.103	0,05
100.000	Dufry One BV 2.000% 15-Feb-2027	103.558	0,05
100.000	Dufry One BV 3.375% 15-Apr-2028	105.640	0,05
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN' FRN 5.943% 23-Apr-2083	114.723	0,05
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.500% 14-Mar-2082	99.527	0,05
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.700% 20-Jul-2080	105.851	0,05
200.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.875% 02-Aug-2081	205.916	0,09
100.000	eDreams ODIGEO SA 'REGS' 5.500% 15-Jul-2027	110.326	0,05
100.000	eircom Finance DAC 3.500% 15-May-2026	107.698	0,05
100.000	Elis SA 'EMTN' 1.625% 03-Apr-2028	101.856	0,05
100.000	Emeria SASU 'REGS' 3.375% 31-Mar-2028	95.223	0,04
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.875% 15-Oct-2025	110.465	0,05
100.000	Energia Group Roi Financeco DAC 'REGS' 6.875% 31-Jul-2028	114.535	0,05
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029	95.641	0,04
100.000	Engineering - Ingegneria Informatica - SpA 11.125% 15-May-2028	118.267	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Eolo SpA 'REGS' 4.875% 21-Oct-2028	85.257	0,04
100.000	Eramet SA 7.000% 22-May-2028	112.987	0,05
100.000	Esselunga SpA 1.875% 25-Oct-2027	103.980	0,05
100.000	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA FRN 10.000% 06-Dec-2032	124.031	0,06
100.000	Eurobank SA 'EMTN' FRN 2.250% 14-Mar-2028	103.026	0,05
100.000	Eurobank SA 'EMTN' FRN 7.000% 26-Jan-2029	119.428	0,05
100.000	Eurofins Scientific SE FRN (Perpetual) 6.750% 14-Apr-2028	114.961	0,05
200.000	Eutelsat SA 2.000% 02-Oct-2025	208.600	0,10
100.000	Evonik Industries AG FRN 1.375% 02-Sep-2081	98.257	0,04
100.000	Explorer II AS 3.375% 24-Feb-2025	101.332	0,05
100.000	Faurecia SE 2.375% 15-Jun-2027	104.581	0,05
200.000	Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027	211.784	0,10
100.000	Faurecia SE 3.750% 15-Jun-2028	108.395	0,05
100.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	117.302	0,05
100.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 'REGS' 5.625% 01-Aug-2027	103.109	0,05
100.000	Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029	81.564	0,04
100.000	Fnac Darty SA 2.625% 30-May-2026	106.390	0,05
100.000	Forvia SE 2.375% 15-Jun-2029	101.054	0,05
100.000	Forvia SE 3.125% 15-Jun-2026	108.455	0,05
100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025	87.937	0,04
100.000	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	108.889	0,05
100.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	109.689	0,05
100.000	Grifols Escrow Issuer SA 'REGS' 3.875% 15-Oct-2028	101.324	0,05
100.000	Grifols SA 'REGS' 2.250% 15-Nov-2027	104.454	0,05
100.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	108.257	0,05
100.000	Gruenthal GmbH 'REGS' 3.625% 15-Nov-2026	109.255	0,05
100.000	Gruenthal GmbH 'REGS' 4.125% 15-May-2028	109.608	0,05
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA 'REGS' 3.500% 30-Apr-2028	84.330	0,04
100.000	Guala Closures SpA 'REGS' 3.250% 15-Jun-2028	104.119	0,05
200.000	Heimstaden AB 4.375% 06-Mar-2027	93.349	0,04
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	38.687	0,02
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.000% 29-Oct-2027	38.914	0,02
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.248% 19-Nov-2024	56.922	0,03
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jan-2026	47.035	0,02
100.000	Hellenic Bank PCL 'EMTN' FRN 10.250% 14-Jun-2033	121.491	0,06
100.000	Herens Midco Sarl 'REGS' 5.250% 15-May-2029	67.082	0,03
100.000	House of HR Group BV 'REGS' 9.000% 03-Nov-2029	114.673	0,05
100.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	106.043	0,05
100.000	Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 6.375% 20-Sep-2027	116.644	0,05
100.000	Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 6.875% 20-Jan-2028	119.502	0,05
100.000	Iccrea Banca SpA FRN 2.125% 17-Jan-2027	106.392	0,05
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	108.348	0,05
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 8.750% 15-May-2028	120.883	0,05
100.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	110.292	0,05
100.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	111.189	0,05
100.000	iliad SA 1.875% 11-Feb-2028	101.654	0,05
100.000	iliad SA 2.375% 17-Jun-2026	105.823	0,05
100.000	iliad SA 5.375% 14-Jun-2027	113.572	0,05
100.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 'REGS' 3.750% 15-Jan-2028	103.247	0,05
100.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.125% 15-Nov-2025	107.083	0,05
100.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 6.625% 15-May-2028	113.465	0,05
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	108.160	0,05
100.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 'GMTN' 1.625% 21-Oct-2028	102.553	0,05
100.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 'GMTN' 1.875% 08-Jul-2026	106.231	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Inter Media and Communication SpA 'REGS' 6.750% 09-Feb-2027	106.642	0,05
100.000	International Consolidated Airlines Group SA 3.750% 25-Mar-2029	107.420	0,05
100.000	International Game Technology Plc 'REGS' 2.375% 15-Apr-2028	102.866	0,05
100.000	International Personal Finance Plc 9.750% 12-Nov-2025	108.325	0,05
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 2.925% 14-Oct-2030	101.021	0,05
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 3.928% 15-Sep-2026	332.822	0,15
250.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030	222.149	0,10
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.000% 15-Sep-2027	84.078	0,04
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.500% 15-Jul-2026	94.070	0,04
200.000	Intrum AB 'REGS' 4.875% 15-Aug-2025	207.173	0,09
100.000	IPD 3 BV 'REGS' 8.000% 15-Jun-2028	118.221	0,05
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 1.750% 15-Mar-2026	106.434	0,05
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.250% 15-Jan-2028	103.992	0,05
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.250% 15-Mar-2029	101.486	0,05
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	105.543	0,05
100.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' 10.000% 06-Feb-2028	114.024	0,05
100.000	Itelyum Regeneration Spa 'REGS' 4.625% 01-Oct-2026	104.716	0,05
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 4.500% 15-Jan-2026	110.864	0,05
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2028	108.196	0,05
200.000	James Hardie International Finance DAC 'REGS' 3.625% 01-Oct-2026	218.091	0,10
100.000	Kapla Holding SAS 'REGS' 3.375% 15-Dec-2026	107.157	0,05
104.500	Kirk Beauty SUN GmbH 'REGS' 8.250% 01-Oct-2026	112.399	0,05
100.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	91.577	0,04
100.000	Koninklijke KPN NV FRN (Perpetual) 2.000% 08-Nov-2024	107.376	0,05
100.000	Loarre Investments Sarl 'REGS' 6.500% 15-May-2029	109.041	0,05
200.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	215.980	0,10
100.000	Lottomatica SpA/Roma 'REGS' 9.750% 30-Sep-2027	119.797	0,05
100.000	Loxam SAS 3.750% 15-Jul-2026	109.533	0,05
100.000	Loxam SAS 5.750% 15-Jul-2027	108.792	0,05
100.000	Loxam SAS 'EMTN' 6.375% 15-May-2028	115.181	0,05
100.000	Loxam SAS 'REGS' 4.500% 15-Feb-2027	110.518	0,05
100.000	Mahle GmbH 'EMTN' 2.375% 14-May-2028	94.750	0,04
100.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 3.125% 15-Sep-2026	107.278	0,05
100.000	mBank SA 'EMTN' FRN 0.966% 21-Sep-2027	96.176	0,04
100.000	Motion Bondco DAC 'REGS' 4.500% 15-Nov-2027	100.087	0,05
100.000	Motion Finco Sarl 'REGS' 7.375% 15-Jun-2030	113.040	0,05
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026	83.613	0,04
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24-Mar-2025	100.323	0,05
100.000	Mytilineos SA 2.250% 30-Oct-2026	105.758	0,05
100.000	National Bank of Greece SA 'EMTN' FRN 7.250% 22-Nov-2027	119.408	0,05
100.000	National Bank of Greece SA FRN 2.750% 08-Oct-2026	108.082	0,05
100.000	Naturgy Finance BV FRN (Perpetual) 2.374% 23-Nov-2026	100.939	0,05
100.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 2.250% 20-Jul-2028	98.178	0,04
100.000	Nexi SpA 2.125% 30-Apr-2029	97.689	0,04
68.206	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 7.250% 30-Sep-2025	75.070	0,03
100.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 7.500% 21-Aug-2026	114.203	0,05
100.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	97.246	0,04
100.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	106.514	0,05
100.000	Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028	103.845	0,05
100.000	Nova Ljubljanska Banka dd FRN 10.750% 28-Nov-2032	120.258	0,05
100.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	122.563	0,06
30.000	Novo Banco SA/Luxembourg 3.500% 23-Jan-2043	24.549	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	OI European Group BV 'REGS' 2.875% 15-Feb-2025	109.351	0,05
100.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028	101.506	0,05
100.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 5.375% 01-Oct-2029	94.605	0,04
100.000	Ontex Group NV 3.500% 15-Jul-2026	106.650	0,05
100.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028	101.680	0,05
100.000	Paprec Holding SA 'REGS' 3.500% 01-Jul-2028	106.623	0,05
100.000	Parts Europe SA 'REGS' 6.500% 16-Jul-2025	110.752	0,05
100.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	80.864	0,04
100.000	Peach Property Finance GmbH 'REGS' 4.375% 15-Nov-2025	87.436	0,04
100.000	PeopleCert Wisdom Issuer Plc 'REGS' 5.750% 15-Sep-2026	109.888	0,05
100.000	PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026	100.804	0,05
100.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	108.086	0,05
100.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 3.875% 03-Nov-2027	106.206	0,05
100.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 7.250% 13-Jul-2028	115.895	0,05
100.000	Playtech Plc 4.250% 07-Mar-2026	108.360	0,05
100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 2.125% 31-Jan-2025	108.235	0,05
100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 3.250% 29-Sep-2027	107.665	0,05
90.000	Preem Holdings AB 'REGS' 12.000% 30-Jun-2027	107.370	0,05
100.000	Pro-Gest SpA 'REGS' 3.250% 15-Dec-2024	58.509	0,03
100.000	ProGroup AG 'REGS' 3.000% 31-Mar-2026	107.696	0,05
100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	102.569	0,05
100.000	RCI Banque SA FRN 2.625% 18-Feb-2030	107.278	0,05
100.000	Rekeep SpA 'REGS' 7.250% 01-Feb-2026	99.241	0,05
100.000	Renault SA 'EMTN' 1.250% 24-Jun-2025	106.282	0,05
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.000% 28-Sep-2026	105.607	0,05
200.000	Renault SA 'EMTN' 2.375% 25-May-2026	214.162	0,10
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.500% 01-Apr-2028	106.124	0,05
100.000	Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025	110.064	0,05
100.000	Rexel SA 2.125% 15-Dec-2028	103.120	0,05
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 4.625% 16-Feb-2026	112.615	0,05
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.750% 14-Jan-2025	96.271	0,04
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 2.250% 12-Aug-2027	74.452	0,03
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 2.375% 04-Sep-2026	80.328	0,04
100.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.624% 30-Jan-2025	18.408	0,01
100.000	Samsonite Finco Sarl 'REGS' 3.500% 15-May-2026	108.866	0,05
100.000	Sani/kos Financial Holdings 1 Sarl 'REGS' 5.625% 15-Dec-2026	104.617	0,05
100.000	Sarens Finance Co NV 5.750% 21-Feb-2027	102.724	0,05
100.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 0.750% 14-Dec-2028	65.870	0,03
100.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2.875% 26-Mar-2027	109.001	0,05
100.000	Schaeffler AG 'EMTN' 3.375% 12-Oct-2028	107.199	0,05
200.000	Seche Environnement SACA 2.250% 15-Nov-2028	199.348	0,09
161.280	Selecta Group BV 'REGS' 8.000% 01-Apr-2026	170.141	0,08
100.000	SES SA FRN (Perpetual) 2.875% 27-May-2026	100.620	0,05
100.000	Sherwood Financing Plc 'REGS' 4.500% 15-Nov-2026	101.798	0,05
100.000	SIG Plc 'REGS' 5.250% 30-Nov-2026	100.080	0,05
100.000	Sigma Holdco BV 'REGS' 5.750% 15-May-2026	99.045	0,04
100.000	Silgan Holdings Inc 3.250% 15-Mar-2025	109.806	0,05
100.000	SNF Group SACA 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029	101.798	0,05
100.000	SoftBank Group Corp 2.875% 06-Jan-2027	103.378	0,05
100.000	SoftBank Group Corp 3.375% 06-Jul-2029	99.172	0,04
100.000	SoftBank Group Corp 3.875% 06-Jul-2032	94.871	0,04
100.000	SoftBank Group Corp 5.000% 15-Apr-2028	109.625	0,05
100.000	SoftBank Group Corp 5.250% 30-Jul-2027	110.313	0,05
100.000	SPCM SA 'REGS' 2.000% 01-Feb-2026	106.946	0,05
100.000	Standard Industries Inc/NJ 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	104.608	0,05
90.105	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	89.186	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
200.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	211.986	0,10
126.870	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	139.550	0,06
100.000	Synthomer Plc 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025	109.452	0,05
100.000	Synthos SA 'REGS' 2.500% 07-Jun-2028	94.533	0,04
100.000	TeamSystem SpA 'REGS' 3.500% 15-Feb-2028	102.498	0,05
100.000	Techern Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	108.332	0,05
100.000	Tele Columbus AG 'REGS' 3.875% 02-May-2025	71.370	0,03
180.000	Telecom Italia Finance SA 'EMTN' 7.750% 24-Jan-2033	232.224	0,11
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 6.875% 15-Feb-2028	117.585	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 1.625% 18-Jan-2029	95.807	0,04
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.375% 12-Oct-2027	103.441	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.750% 15-Apr-2025	107.878	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.875% 28-Jan-2026	107.150	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.000% 30-Sep-2025	108.106	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.625% 25-May-2026	108.876	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 5.250% 17-Mar-2055	101.993	0,05
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	96.197	0,04
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.502% 05-Feb-2027	102.146	0,05
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.880% 24-Feb-2028	100.748	0,05
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.875% 22-Jun-2026	107.158	0,05
200.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	219.693	0,10
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 6.135% 03-Feb-2030	113.824	0,05
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 6.750% 07-Jun-2031	117.946	0,05
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 7.125% 23-Aug-2028	119.605	0,05
100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 'REGS' 3.500% 01-Mar-2028	105.645	0,05
100.000	Tereos Finance Groupe I SA 'REGS' 4.750% 30-Apr-2027	111.505	0,05
100.000	Tereos Finance Groupe I SA 'REGS' 7.500% 30-Oct-2025	112.886	0,05
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN (Perpetual) 2.375% 09-Nov-2027	99.138	0,04
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.625% 15-Oct-2028	94.491	0,04
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.875% 31-Mar-2027	100.759	0,05
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.750% 09-May-2027	106.823	0,05
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	104.032	0,05
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.375% 15-Sep-2029	121.485	0,06
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.875% 15-Sep-2031	125.417	0,06
50.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 2.500% 25-Feb-2025	54.439	0,02
100.000	TI Automotive Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Apr-2029	101.432	0,05
90.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	92.059	0,04
100.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	106.810	0,05
100.000	TMNL Holding BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	105.149	0,05
100.000	Triodos Bank NV FRN 2.250% 05-Feb-2032	84.786	0,04
100.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	107.283	0,05
100.000	TUI Cruises GmbH 'REGS' 6.500% 15-May-2026	109.291	0,05
100.000	UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029	94.297	0,04
100.000	Unicaja Banco SA FRN 3.125% 19-Jul-2032	98.723	0,04
200.000	UniCredit SpA FRN 2.731% 15-Jan-2032	207.760	0,09

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.000% 18-Mar-2025	109.221	0,05
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.250% 23-Sep-2030	108.574	0,05
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' 3.875% 01-Mar-2028	109.225	0,05
200.000	United Group BV 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	209.457	0,10
100.000	United Group BV 'REGS' 5.250% 01-Feb-2030	104.781	0,05
100.000	UPC Holding BV 'REGS' 3.875% 15-Jun-2029	102.504	0,05
100.000	Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028	96.910	0,04
200.000	Valeo 'EMTN' 1.500% 18-Jun-2025	213.664	0,10
100.000	Vallourec SA 'REGS' 8.500% 30-Jun-2026	110.947	0,05
200.000	Var Energi ASA FRN 7.862% 15-Nov-2083	235.784	0,11
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.000% 15-Nov-2027	99.042	0,04
200.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	209.235	0,10
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.500% 20-Jan-2029	99.017	0,04
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027	106.276	0,05
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	108.755	0,05
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 7.125% 01-Feb-2028	116.593	0,05
200.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029	211.404	0,10
100.000	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA 'REGS' 5.250% 01-Apr-2026	106.077	0,05
100.000	Victoria Plc 3.625% 24-Aug-2026	88.851	0,04
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 3.250% 31-Jan-2031	101.886	0,05
100.000	Vodafone Group Plc FRN 2.625% 27-Aug-2080	105.164	0,05
100.000	Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080	99.015	0,04
100.000	Vodafone Group Plc FRN 4.200% 03-Oct-2078	108.116	0,05
100.000	Volvo Car AB 'EMTN' 2.500% 07-Oct-2027	104.795	0,05
100.000	VZ Secured Financing BV 'REGS' 3.500% 15-Jan-2032	97.742	0,04
100.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	97.114	0,04
100.000	Webuild SpA 3.875% 28-Jul-2026	108.638	0,05
100.000	Webuild SpA 5.875% 15-Dec-2025	112.801	0,05
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 2.499% 20-Apr-2026	100.683	0,05
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	96.803	0,04
100.000	WMG Acquisition Corp 'REGS' 2.250% 15-Aug-2031	97.071	0,04
100.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV 'REGS' 5.500% 15-Jan-2030	101.091	0,05
100.000	ZF Europe Finance BV 2.000% 23-Feb-2026	105.576	0,05
100.000	ZF Europe Finance BV 2.500% 23-Oct-2027	103.551	0,05
200.000	ZF Europe Finance BV 3.000% 23-Oct-2029	203.570	0,09
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.750% 25-May-2027	105.254	0,05
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.000% 21-Sep-2025	108.181	0,05
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.750% 21-Sep-2028	106.805	0,05
100.000	Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3.375% 28-Feb-2030	93.575	0,04
Pfund Sterling - 4.998.907			
(31. Dezember 2022: 4.095.977)		4.998.907	2,28
100.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 'REGS' 4.875% 01-Jun-2028	107.867	0,05
100.000	B&M European Value Retail SA 4.000% 15-Nov-2028	118.476	0,05
300.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	355.100	0,16
100.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	120.616	0,05
100.000	Bracken MidCo1 Plc 'REGS' 6.750% 01-Nov-2027	114.839	0,05
100.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8.375% 20-Dec-2083	135.272	0,06
100.000	Canary Wharf Group Investment Holdings Plc 'REGS' 3.375% 23-Apr-2028	86.611	0,04
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 8.625% 28-Feb-2033	135.735	0,06
100.000	Constellation Automotive Financing Plc 'REGS' 4.875% 15-Jul-2027	104.806	0,05
100.000	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd Step-Up Coupon 7.500% 08-Jul-2026	125.744	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Pfund Sterling Forts.				
50.000	Co-Operative Group Ltd 11.000% 22-Dec-2025	67.515	0,03	
100.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	123.218	0,06	
100.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	123.816	0,06	
100.000	Daily Mail & General Trust Plc 6.375% 21-Jun-2027	122.165	0,06	
100.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	119.353	0,05	
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.250% 01-Jun-2028	109.357	0,05	
100.000	Heathrow Finance Plc 5.750% 03-Mar-2025	126.651	0,06	
200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 8.505% 20-Sep-2032	279.215	0,13	
100.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	123.179	0,06	
100.000	Kane Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 15-Feb-2027	119.052	0,05	
100.000	Market Bidco Finco Plc 'REGS' 5.500% 04-Nov-2027	112.876	0,05	
100.000	Marks & Spencer Plc 4.500% 10-Jul-2027	123.394	0,06	
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.375% 24-Apr-2030	76.862	0,03	
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028	86.414	0,04	
100.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	112.830	0,05	
100.000	NGG Finance Plc FRN 5.625% 18-Jun-2073	125.846	0,06	
100.000	Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026	110.178	0,05	
100.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.250% 30-Sep-2025	124.147	0,06	
100.000	Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026	118.643	0,05	
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 5.750% 15-Oct-2027	128.088	0,06	
100.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' 8.250% 31-Jul-2025	124.995	0,06	
100.000	TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025	99.362	0,05	
100.000	Thames Water Kemble Finance Plc 'REGS' 4.625% 19-May-2026	65.591	0,03	
100.000	Very Group Funding Plc/The 'REGS' 6.500% 01-Aug-2026	111.160	0,05	
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.125% 15-Aug-2030	109.786	0,05	
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	112.020	0,05	
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	117.915	0,05	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	113.280	0,05	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	110.020	0,05	
100.000	Voyage Care BondCo Plc 'REGS' 5.875% 15-Feb-2027	93.368	0,04	
100.000	Zenith Finco Plc 'REGS' 6.500% 30-Jun-2027	103.545	0,05	
US-Dollar - 159.624.583				
(31. Dezember 2022: 133.552.171)		159.624.583	72,98	
70.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	64.340	0,03	
200.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	189.039	0,09	
300.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	269.346	0,12	
165.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	157.855	0,07	
60.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025	59.839	0,03	
10.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	9.018	0,00	
35.000	99 Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	11.855	0,01	
10.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	10.162	0,00	
14.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	13.762	0,01	
60.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	57.830	0,03	
10.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	9.885	0,00	
200.000	Access Bank Plc 'REGS' 6.125% 21-Sep-2026	180.530	0,08	
10.000	ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	9.032	0,00	
11.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2026	10.939	0,01	
60.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	54.238	0,03	
55.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	50.035	0,02	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
122.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	121.788	0,06	
40.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	41.838	0,02	
25.000	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL '144A' 5.000% 01-May-2028	20.524	0,01	
14.000	Acushnet Co '144A' 7.375% 15-Oct-2028	14.700	0,01	
250.000	Adams Homes Inc '144A' 9.250% 15-Oct-2028	253.848	0,12	
40.000	AdaptHealth LLC '144A' 4.625% 01-Aug-2029	30.912	0,01	
85.000	AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030	66.455	0,03	
35.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	30.246	0,01	
100.000	Adecoagro SA 'REGS' 6.000% 21-Sep-2027	96.817	0,04	
25.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	24.469	0,01	
80.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 8.250% 15-Apr-2031	84.763	0,04	
65.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	59.857	0,03	
10.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	9.260	0,00	
34.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	32.740	0,02	
30.000	Advance Auto Parts Inc 1.750% 01-Oct-2027	25.793	0,01	
10.000	Advance Auto Parts Inc 3.500% 15-Mar-2032	8.305	0,00	
13.000	Advance Auto Parts Inc 3.900% 15-Apr-2030	11.685	0,01	
25.000	Advance Auto Parts Inc 5.900% 09-Mar-2026	24.922	0,01	
10.000	Advance Auto Parts Inc 5.950% 09-Mar-2028	9.964	0,00	
20.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	19.320	0,01	
160.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2030	161.301	0,07	
128.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	118.093	0,05	
11.000	Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027	11.176	0,01	
188.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	186.745	0,09	
160.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045	160.430	0,07	
270.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	271.625	0,12	
130.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	115.952	0,05	
45.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	44.780	0,02	
55.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC '144A' 8.625% 30-Sep-2027	57.882	0,03	
30.000	Ahead DB Holdings LLC '144A' 6.625% 01-May-2028	26.168	0,01	
25.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	21.950	0,01	
10.000	AHP Health Partners Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	8.711	0,00	
150.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033	116.466	0,05	
90.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	86.032	0,04	
100.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	108.000	0,05	
200.000	Akbank TAS 'REGS' 6.800% 06-Feb-2026	201.231	0,09	
180.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	169.900	0,08	
145.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	131.895	0,06	
112.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	108.978	0,05	
161.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	154.443	0,07	
80.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	80.178	0,04	
90.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2028	90.983	0,04	
30.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 7.500% 15-Mar-2026	30.569	0,01	
43.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	42.645	0,02	
100.000	Albion Financing 2SARL '144A' 8.750% 15-Apr-2027	99.000	0,05	
85.000	Algonquin Power & Utilities Corp FRN 4.750% 18-Jan-2082	71.921	0,03	
40.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	40.539	0,02	
90.000	Allegiant Travel Co '144A' 7.250% 15-Aug-2027	88.165	0,04	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
75.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	40.184	0,02
43.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	42.973	0,02
90.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	86.573	0,04
80.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Nov-2029	75.899	0,03
145.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	143.897	0,07
150.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Apr-2028	153.549	0,07
90.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	73.449	0,03
315.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	313.646	0,14
210.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	206.016	0,09
45.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	41.180	0,02
125.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	113.497	0,05
352.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	311.428	0,14
50.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	48.338	0,02
50.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	49.875	0,02
80.000	Allwyn Entertainment Financing UK Plc 'REGS' 7.875% 30-Apr-2029	81.800	0,04
202.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	201.595	0,09
68.000	Ally Financial Inc 6.700% 14-Feb-2033	68.166	0,03
165.000	Alteryx Inc '144A' 8.750% 15-Mar-2028	175.764	0,08
105.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	95.203	0,04
270.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	240.196	0,11
125.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	60.172	0,03
200.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	129.728	0,06
70.000	Altice France SA / France '144A' 5.125 % 15-Jan-2029	54.495	0,03
345.000	Altice France SA / France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	268.387	0,12
135.000	Altice France SA / France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	111.290	0,05
244.000	Altice France SA / France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	191.533	0,09
195.000	Altice France SA / France '144A' 8.125% 01-Feb-2027	179.899	0,08
100.000	Amaggi Luxembourg International Sarl 'REGS' 5.250% 28-Jan-2028	96.061	0,04
100.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2029	69.549	0,03
99.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Jun-2026	85.936	0,04
135.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	103.477	0,05
60.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	58.462	0,03
230.406	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	220.922	0,10
43.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	41.981	0,02
111.000	American Airlines Inc '144A' 7.250% 15-Feb-2028	112.177	0,05
108.000	American Airlines Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	114.102	0,05
320.833	American Airlines Inc / AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	318.761	0,15
355.000	American Airlines Inc / AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	346.341	0,16
10.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	8.844	0,00
6.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.250% 15-Mar-2026	5.968	0,00
40.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.500% 01-Apr-2027	40.192	0,02
10.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.875% 01-Jul-2028	9.836	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
120.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	107.104	0,05
83.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	78.659	0,04
61.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	60.966	0,03
140.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.500% 20-May-2025	138.168	0,06
92.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.750% 20-May-2027	89.501	0,04
103.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.875% 20-Aug-2026	102.004	0,05
20.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	20.268	0,01
110.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	99.335	0,05
34.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	32.205	0,02
31.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	28.413	0,01
45.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	44.884	0,02
90.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	82.190	0,04
200.000	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028	171.519	0,08
45.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	38.062	0,02
20.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 6.500% 15-Apr-2040	19.616	0,01
75.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	72.265	0,03
10.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	9.930	0,00
13.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	12.881	0,01
90.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	92.414	0,04
55.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	52.777	0,02
50.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	51.356	0,02
160.000	Anywhere Real Estate Group LLC / Anywhere Co-Issuer Corp '144A' 7.000% 15-Apr-2030	147.950	0,07
40.000	API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029	36.674	0,02
40.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	33.684	0,02
40.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	37.859	0,02
100.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	93.383	0,04
20.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	19.978	0,01
200.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd 'REGS' 5.625% 07-Oct-2026	183.579	0,08
147.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	142.686	0,07
135.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	122.411	0,06
45.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	38.975	0,02
177.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	174.527	0,08
10.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	10.035	0,00
54.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	50.352	0,02
120.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	56.194	0,03
78.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	68.332	0,03
137.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	116.245	0,05
70.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	69.780	0,03
124.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	113.255	0,05
165.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	160.602	0,07
139.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	108.037	0,05
95.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	73.838	0,03
45.000	Aretex Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2029	40.620	0,02
5.000	Aretex Group Inc '144A' 10.000% 15-Aug-2030	5.319	0,00
20.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	17.274	0,01
85.000	Armor Holdco Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2029	77.188	0,04
200.000	Arrow Bidco LLC '144A' 10.750% 15-Jun-2025	208.000	0,10

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
93.000	Arsenal AIC Parent LLC '144A' 8.000% 01-Oct-2030	97.149	0,04
119.453	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	113.332	0,05
50.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	47.530	0,02
105.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	98.195	0,05
99.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	91.775	0,04
70.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032	63.737	0,03
30.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	27.894	0,01
99.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	99.844	0,05
100.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 8.250% 31-Dec-2028	100.668	0,05
66.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	62.742	0,03
100.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	98.374	0,05
110.000	Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031	95.013	0,04
50.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029	44.522	0,02
35.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	31.269	0,01
10.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	9.754	0,00
90.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 5.250% 30-Sep-2028	65.106	0,03
45.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 7.500% 30-Sep-2029	22.951	0,01
60.000	Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048	60.618	0,03
130.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	121.486	0,06
40.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	40.099	0,02
225.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	227.340	0,10
80.000	At Home Group Inc '144A' 4.875 % 15-Jul-2028	29.700	0,01
15.000	Athabasca Oil Corp '144A' 9.750% 01-Nov-2026	15.854	0,01
285.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	259.110	0,12
30.000	ATI Inc 4.875% 01-Oct-2029	27.935	0,01
110.000	ATI Inc 5.875 % 01-Dec-2027	108.645	0,05
50.000	Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031	44.684	0,02
60.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028	56.285	0,03
50.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	1.000	0,00
70.000	Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029	63.626	0,03
251.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	242.699	0,11
30.754	Avation Capital SA '144A' 8.250% 31-Oct-2026	26.099	0,01
140.000	Avianca Midco 2 Plc 'REGS' 9.000% 01-Dec-2028	123.109	0,06
45.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	45.046	0,02
175.000	Avient Corp '144A' 7.125% 01-Aug-2030	182.264	0,08
10.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 4.750% 01-Apr-2028	9.218	0,00
30.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.375% 01-Mar-2029	27.788	0,01
10.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	9.593	0,00
25.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	24.259	0,01
50.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	48.637	0,02
50.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	44.960	0,02
10.000	Axos Financial Inc FRN 4.875% 01-Oct-2030	8.516	0,00
200.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	182.848	0,08
200.000	Azul Secured Finance LLP 'REGS' 11.930% 28-Aug-2028	207.039	0,09
24.000	B&G Foods Inc 5.250% 01-Apr-2025	23.652	0,01
11.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	9.996	0,00
79.000	B&G Foods Inc '144A' 8.000% 15-Sep-2028	83.054	0,04
100.000	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao 'REGS' 4.125% 20-Sep-2031	87.495	0,04
10.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	9.372	0,00
85.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	73.043	0,03
15.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	12.961	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
100.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	99.697	0,05
70.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	69.977	0,03
110.000	Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	112.470	0,05
85.000	Ball Corp 6.875% 15-Mar-2028	88.422	0,04
170.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS' 3.200% 27-Jan-2025	165.282	0,08
75.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS' 4.375% 18-Mar-2027	72.942	0,03
45.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 2.750% 11-Jan-2026	42.532	0,02
140.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 4.500% 10-Jan-2025	137.641	0,06
100.000	Banco de Bogota SA 'REGS' 6.250% 12-May-2026	98.813	0,05
120.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.733% 25-Sep-2034	106.659	0,05
10.000	Banijay Entertainment SASU '144A' 8.125% 01-May-2029	10.319	0,00
200.000	Bank Muscat SAOG 'EMTN' 4.750% 17-Mar-2026	196.242	0,09
11.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	10.892	0,01
25.000	Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027	25.574	0,01
26.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	26.235	0,01
267.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	270.764	0,12
11.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	11.006	0,01
70.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	72.997	0,03
50.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	51.064	0,02
110.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	112.588	0,05
30.000	Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025	31.706	0,01
160.000	Bausch & Lomb Escrow Corp '144A' 8.375% 01-Oct-2028	168.990	0,08
75.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	41.742	0,02
86.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	78.792	0,04
194.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	117.149	0,05
50.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 30-Jan-2028	22.802	0,01
55.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2029	24.127	0,01
95.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	43.893	0,02
155.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	67.690	0,03
80.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025	73.256	0,03
55.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	35.536	0,02
120.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 01-Feb-2027	81.127	0,04
95.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	42.149	0,02
20.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.000% 15-Jan-2028	8.741	0,00
15.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029	6.872	0,00
56.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9.000% 15-Dec-2025	52.387	0,02
215.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 11.000% 30-Sep-2028	156.838	0,07
37.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 14.000% 15-Oct-2030	20.507	0,01
160.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.500 % 30-Apr-2030	165.680	0,08
90.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	93.184	0,04
65.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	62.790	0,03
65.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	60.700	0,03
115.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2026	112.158	0,05
35.000	Beasley Mezzanine Holdings LLC '144A' 8.625% 01-Feb-2026	23.144	0,01
11.000	Beazer Homes USA Inc 5.875 % 15-Oct-2027	10.758	0,01
20.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	20.204	0,01
10.000	BellRing Brands Inc '144A' 7.000% 15-Mar-2030	10.374	0,01
95.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	96.425	0,04
15.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	15.250	0,01
70.000	Benteler International AG '144A' 10.500% 15-May-2028	73.796	0,03
18.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	17.537	0,01
30.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	29.807	0,01
67.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	68.392	0,03
335.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	317.831	0,15

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	Blackstone Mortgage Trust Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2027	35.621	0,02
10.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	8.801	0,00
80.000	Block Inc 2.750% 01-Jun-2026	75.499	0,03
10.000	Block Inc 3.500% 01-Jun-2031	8.898	0,00
35.000	Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029	32.171	0,01
110.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	109.438	0,05
80.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	81.124	0,04
30.000	BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	27.799	0,01
25.000	Boise Cascade Co '144A' 4.875% 01-Jul-2030	23.500	0,01
110.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	107.283	0,05
117.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	116.576	0,05
41.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	46.843	0,02
14.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Feb-2029	14.237	0,01
114.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	114.133	0,05
76.000	Bombardier Inc '144A' 8.750% 15-Nov-2030	81.032	0,04
200.000	Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2026	184.015	0,08
46.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	46.296	0,02
20.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 9.125% 01-Mar-2026	20.094	0,01
104.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	100.240	0,05
125.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	114.948	0,05
29.000	Boyne USA Inc '144A' 4.750% 15-May-2029	27.302	0,01
183.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 10.375% 01-Aug-2030	193.757	0,09
60.000	Brandywine Operating Partnership LP 3.950% 15-Nov-2027	53.716	0,02
26.000	Brandywine Operating Partnership LP 4.550% 01-Oct-2029	22.785	0,01
100.000	Bread Financial Holdings Inc '144A' 9.750% 15-Mar-2029	103.354	0,05
180.000	BRF SA 'REGS' 5.750% 21-Sep-2050	134.617	0,06
140.000	Brightsphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	134.376	0,06
176.000	Brinker International Inc '144A' 8.250% 15-Jul-2030	184.284	0,08
45.000	Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027	42.973	0,02
105.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	104.585	0,05
40.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	38.448	0,02
110.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081	101.661	0,05
140.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.875% 23-Nov-2081	120.264	0,06
45.000	BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029	42.045	0,02
60.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	54.074	0,02
83.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 5.750% 15-May-2026	80.574	0,04
110.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	96.869	0,04
9.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 5.000% 15-Jun-2029	8.039	0,00
10.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	9.702	0,00
20.000	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2026	20.015	0,01
156.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	147.552	0,07
10.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	9.509	0,00
20.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	19.619	0,01
15.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	11.573	0,01
10.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	8.117	0,00
11.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	10.773	0,01
66.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	64.437	0,03
31.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	29.361	0,01
40.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	36.137	0,02
95.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	91.847	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
25.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2032	25.562	0,01
40.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	38.657	0,02
42.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 9.250% 01-Jul-2031	44.690	0,02
40.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	37.132	0,02
35.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	31.975	0,01
15.000	C&S Group Enterprises LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2028	12.084	0,01
200.000	C&W Senior Financing DAC '144A' 6.875% 15-Sep-2027	186.538	0,09
100.000	CA Magnum Holdings 'REGS' 5.375% 31-Oct-2026	93.250	0,04
120.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	97.306	0,04
25.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027	21.978	0,01
39.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028	30.778	0,01
236.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	236.838	0,11
227.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2030	232.829	0,11
124.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	127.232	0,06
20.000	Calderys Financing LLC '144A' 11.250% 01-Jun-2028	20.973	0,01
11.000	Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026	10.979	0,01
11.000	Callon Petroleum Co '144A' 7.500% 15-Jun-2030	11.107	0,01
45.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	46.048	0,02
173.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	164.528	0,08
75.000	Calpine Corp '144A' 4.625% 01-Feb-2029	69.651	0,03
101.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	92.736	0,04
163.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	156.394	0,07
85.000	Calpine Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2026	83.859	0,04
12.700	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 8.125% 15-Jan-2027	12.490	0,01
13.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 9.750 % 15-Jul-2028	13.013	0,01
205.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	200.417	0,09
225.000	Camelot Return Merger Sub Inc '144A' 8.750% 01-Aug-2028	228.673	0,10
55.000	Canacol Energy Ltd 'REGS' 5.750% 24-Nov-2028	40.163	0,02
65.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	4.989	0,00
50.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	45.818	0,02
90.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	86.334	0,04
170.000	Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028	158.125	0,07
335.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	327.378	0,15
235.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	226.227	0,10
21.000	Carnival Corp '144A' 7.000 % 15-Aug-2029	21.950	0,01
60.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	61.125	0,03
10.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	10.507	0,01
30.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	32.836	0,02
125.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	136.094	0,06
31.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	32.473	0,02
38.000	Carpenter Technology Corp 6.375% 15-Jul-2028	38.206	0,02
45.000	Carpenter Technology Corp 7.625% 15-Mar-2030	46.413	0,02
25.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	20.489	0,01
35.000	Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029	31.125	0,01
12.000	Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029	10.612	0,01
20.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	19.254	0,01
207.000	Carvana Co '144A' 12.000% 01-Dec-2028	175.888	0,08
162.000	Carvana Co '144A' 13.000% 01-Jun-2030	136.435	0,06
192.000	Carvana Co '144A' 14.000% 01-Jun-2031	164.189	0,08
225.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	220.046	0,10
25.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	24.220	0,01
40.000	Castle US Holding Corp '144A' 9.500% 15-Feb-2028	20.839	0,01
50.000	Castlelake Aviation Finance DAC '144A' 5.000% 15-Apr-2027	47.031	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
103.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	89.759	0,04
41.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	39.789	0,02
20.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	19.546	0,01
364.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	312.093	0,14
565.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	495.787	0,23
230.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	187.282	0,09
350.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	316.006	0,14
350.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	296.740	0,14
275.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	251.633	0,12
180.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750 % 01-Feb-2032	158.958	0,07
436.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	417.651	0,19
300.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	289.693	0,13
167.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	157.698	0,07
14.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	13.916	0,01
169.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 6.375% 01-Sep-2029	166.914	0,08
40.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 7.375 % 01-Mar-2031	41.053	0,02
85.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	84.183	0,04
255.000	CDI Escrow Issuer Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2030	248.920	0,11
50.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	48.850	0,02
30.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	28.347	0,01
45.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	44.106	0,02
130.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 6.500% 01-Oct-2028	129.426	0,06
60.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	59.734	0,03
14.000	CellInex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041	10.857	0,01
200.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	179.065	0,08
180.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 5.450% 19-Nov-2029	177.649	0,08
80.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual) 5.125% 08-Jun-2026	75.950	0,03
100.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual) 9.125% 14-Mar-2028	106.604	0,05
90.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	84.718	0,04
65.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	59.192	0,03
135.000	Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028	131.864	0,06
45.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	39.824	0,02
130.000	Central Parent Inc / CDK Global Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2029	132.949	0,06
13.000	Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc '144A' 8.000% 15-Jun-2029	13.579	0,01
10.000	Century Aluminum Co '144A' 7.500% 01-Apr-2028	9.701	0,00
45.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	45.586	0,02
45.000	Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029	40.784	0,02
50.000	Cerdia Finanz GmbH '144A' 10.500% 15-Feb-2027	51.006	0,02
45.000	CGG SA '144A' 8.750% 01-Apr-2027	41.035	0,02
165.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	151.281	0,07
45.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031	40.668	0,02
40.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	38.070	0,02
130.000	Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	136.188	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Chart Industries Inc '144A' 9.500% 01-Jan-2031	10.871	0,01
55.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	53.783	0,02
50.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	43.945	0,02
203.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	193.631	0,09
75.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	71.055	0,03
40.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	39.703	0,02
105.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	103.028	0,05
145.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	146.531	0,07
70.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2028	65.520	0,03
155.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	154.358	0,07
10.000	Chord Energy Corp '144A' 6.375% 01-Jun-2026	10.010	0,00
85.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031	67.207	0,03
130.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	109.197	0,05
185.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	172.150	0,08
35.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029	31.544	0,01
155.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	100.552	0,05
75.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 01-Apr-2028	46.176	0,02
145.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	95.171	0,04
185.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	184.558	0,08
80.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027	77.284	0,04
272.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 10.875 % 15-Jan-2032	285.239	0,13
65.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	62.369	0,03
11.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	10.893	0,01
140.000	Churchill Downs Inc '144A' 6.750% 01-May-2031	142.266	0,07
100.000	Cia de Minas Buenaventura SAA 'REGS' 5.500% 23-Jul-2026	95.567	0,04
45.000	Ciena Corp '144A' 4.000% 31-Jan-2030	41.033	0,02
10.000	Cimpress Plc 7.000% 15-Jun-2026	9.782	0,00
10.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	9.176	0,00
30.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	29.357	0,01
75.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	72.799	0,03
165.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.375% 01-Jul-2028	172.469	0,08
51.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.625% 01-Nov-2030	54.127	0,03
255.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.750% 01-Jul-2031	271.860	0,12
125.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026	125.229	0,06
50.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.750 % 15-May-2028	51.043	0,02
250.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	251.333	0,12
85.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028	80.227	0,04
76.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029	71.396	0,03
90.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	88.297	0,04
20.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	19.233	0,01
148.000	Clean Harbors Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2031	150.650	0,07
10.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	10.056	0,00
145.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	138.512	0,06
45.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	37.441	0,02
125.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	107.840	0,05
46.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 9.000% 15-Sep-2028	48.033	0,02
10.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	9.315	0,00
115.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Feb-2031	101.347	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
15.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Jan-2032	13.082	0,01
235.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4.750% 15-Mar-2028	226.467	0,10
25.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	24.943	0,01
10.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	8.978	0,00
20.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029	18.611	0,01
40.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2031	36.212	0,02
130.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	130.431	0,06
70.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	71.113	0,03
534.000	Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	509.247	0,23
462.000	Cloud Software Group Inc '144A' 9.000% 30-Sep-2029	440.475	0,20
10.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 6.625% 15-Apr-2029	9.843	0,00
150.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Apr-2030	140.037	0,06
114.000	CMG Media Corp '144A' 8.875% 15-Dec-2027	90.523	0,04
30.000	CNX Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Apr-2030	27.005	0,01
105.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	100.776	0,05
70.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	70.764	0,03
112.000	CNX Resources Corp '144A' 7.375 % 15-Jan-2031	112.924	0,05
60.000	Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029	46.317	0,02
20.000	Coeur Mining Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2029	18.447	0,01
90.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	90.534	0,04
50.000	Coherent Corp '144A' 5.000% 15-Dec-2029	47.540	0,02
150.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	126.839	0,06
5.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.625% 01-Oct-2031	3.873	0,00
35.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	34.169	0,02
10.000	Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031	8.865	0,00
35.000	Commercial Metals Co 4.125% 15-Jan-2030	32.267	0,02
75.000	Commercial Metals Co 4.375% 15-Mar-2032	67.426	0,03
145.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	97.490	0,04
222.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	198.068	0,09
40.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	19.039	0,01
100.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	53.000	0,02
110.000	CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027	45.890	0,02
78.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	63.643	0,03
75.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Jan-2032	68.068	0,03
234.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	221.296	0,10
77.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	76.330	0,04
150.000	Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030	130.234	0,06
13.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	11.908	0,01
250.000	Condor Merger Sub Inc '144A' 7.375% 15-Feb-2030	228.740	0,10
32.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029	28.852	0,01
300.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	298.508	0,14
10.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	9.518	0,00
65.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028	59.026	0,03
10.000	Consolidated Communications Inc '144A' 5.000 % 01-Oct-2028	8.211	0,00
111.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	95.971	0,04
50.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	42.398	0,02
25.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 6.500% 15-May-2026	22.849	0,01
45.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	40.090	0,02
11.000	Constellium SE '144A' 3.750% 15-Apr-2029	9.994	0,00
20.000	Constellium SE '144A' 5.625% 15-Jun-2028	19.541	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Constellium SE '144A' 5.875% 15-Feb-2026	9.947	0,00
28.000	Conuma Resources Ltd '144A' 13.125% 01-May-2028	26.975	0,01
52.879	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 5.625% 15-May-2027	39.770	0,02
30.000	CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027	27.723	0,01
105.000	CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026	106.922	0,05
80.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	70.159	0,03
40.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029	32.841	0,02
52.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 10.250% 01-Sep-2027	44.005	0,02
10.000	Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026	10.466	0,01
110.000	Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029	104.828	0,05
63.000	Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026	62.017	0,03
135.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	128.882	0,06
6.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	5.120	0,00
150.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	131.232	0,06
95.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	82.819	0,04
40.000	CPI CG Inc '144A' 8.625% 15-Mar-2026	38.863	0,02
140.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	132.835	0,06
80.000	Crane Holdings Co 4.200% 15-Mar-2048	60.176	0,03
40.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	39.965	0,02
60.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026	60.407	0,03
65.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 9.250% 15-Feb-2028	67.492	0,03
64.000	Crocs Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2031	54.136	0,03
35.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	31.684	0,01
75.000	Crown Americas LLC 5.250% 01-Apr-2030	73.943	0,03
40.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	38.839	0,02
11.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	10.903	0,01
15.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	15.765	0,01
60.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	58.569	0,03
149.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	148.895	0,07
50.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	36.549	0,02
91.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	69.335	0,03
120.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	90.875	0,04
180.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	108.666	0,05
155.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.000 % 15-Nov-2031	93.949	0,04
89.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	78.640	0,04
114.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	105.506	0,05
161.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	100.390	0,05
169.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	149.294	0,07
104.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	77.901	0,04
187.000	CSC Holdings LLC '144A' 11.250% 15-May-2028	192.809	0,09
300.000	CSN Inova Ventures 'REGS' 6.750% 28-Jan-2028	293.234	0,13
50.000	CSN Resources SA 'REGS' 4.625% 10-Jun-2031	40.955	0,02
50.000	CSN Resources SA 'REGS' 5.875% 08-Apr-2032	43.552	0,02
190.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	166.229	0,08
10.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028	9.145	0,00
37.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	24.917	0,01
65.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	12.675	0,01
74.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	24.975	0,01
190.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	189.243	0,09
120.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 8.875% 01-Sep-2031	127.263	0,06
50.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	46.177	0,02
400.000	CVR Energy Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2029	399.346	0,18
70.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028	65.387	0,03
25.000	Dana Financing Luxembourg Sarl '144A' 5.750% 15-Apr-2025	24.961	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
35.000	Dana Inc 4.250% 01-Sep-2030	31.066	0,01
90.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	78.408	0,04
65.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	64.610	0,03
155.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	152.959	0,07
200.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 6.750% 15-Feb-2025	199.456	0,09
200.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 'EMTN' 8.000% 25-Feb-2029	205.520	0,09
35.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	34.516	0,02
160.000	Darling Ingredients Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2030	160.212	0,07
40.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	40.542	0,02
280.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	230.371	0,11
421.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	367.815	0,17
35.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	34.691	0,02
10.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	9.949	0,00
55.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	51.868	0,02
50.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS' 6.125% 31-Oct-2026	49.125	0,02
50.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS' 6.450% 04-Jun-2029	49.069	0,02
25.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	24.354	0,01
274.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	251.049	0,12
35.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	33.889	0,02
75.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	77.581	0,04
18.000	Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029	15.944	0,01
60.000	Diamond Foreign Asset Co / Diamond Finance LLC '144A' 8.500% 01-Oct-2030	61.341	0,03
520.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	489.341	0,22
120.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	61.971	0,03
134.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	125.765	0,06
130.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	77.838	0,04
252.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	175.780	0,08
204.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	175.159	0,08
240.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	191.874	0,09
256.000	DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	268.225	0,12
50.000	Diversified Healthcare Trust 4.375% 01-Mar-2031	37.587	0,02
146.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	112.308	0,05
34.000	Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025	33.406	0,02
65.000	Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028	58.839	0,03
80.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	72.226	0,03
25.000	DPL Inc 4.125% 01-Jul-2025	24.395	0,01
23.000	DPL Inc 4.350% 15-Apr-2029	21.366	0,01
60.000	Drax Finco Plc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	59.090	0,03
196.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	217.315	0,10
170.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	156.608	0,07
252.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	227.517	0,10
35.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 5.000% 15-Dec-2029	32.687	0,02
10.000	Dycorn Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	9.291	0,00
140.000	Eagle Intermediate Global Holding BV/Eagle US Finance LLC 'REGS' 7.500% 01-May-2025	92.578	0,04
10.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	10.012	0,00
11.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029	10.024	0,00
165.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	162.088	0,07
140.000	Edison International FRN 8.125% 15-Jun-2053	143.267	0,07
11.000	Elanco Animal Health Inc 6.650% 28-Aug-2028	11.426	0,01
45.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	41.369	0,02
11.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	10.139	0,00
160.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	98.996	0,05
85.000	Embecta Corp '144A' 5.000% 15-Feb-2030	72.213	0,03
20.000	Embecta Corp '144A' 6.750% 15-Feb-2030	17.426	0,01
100.000	Embraer Netherlands Finance BV 'REGS' 7.000% 28-Jul-2030	104.991	0,05
310.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	317.012	0,15

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	Emergent BioSolutions Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2028	16.409	0,01
60.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	59.311	0,03
35.000	Empire Resorts Inc '144A' 7.750% 01-Nov-2026	30.265	0,01
106.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	104.523	0,05
71.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	68.010	0,03
88.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	81.084	0,04
11.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	10.378	0,01
105.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	105.165	0,05
100.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	92.688	0,04
150.000	Endurance International Group Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	113.480	0,05
70.000	Enerflex Ltd '144A' 9.000% 15-Oct-2027	68.105	0,03
70.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 4.875% 30-Mar-2026	64.697	0,03
192.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.375% 30-Mar-2028	169.208	0,08
300.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	254.017	0,12
115.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	103.517	0,05
10.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	9.317	0,00
10.000	Energizer Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Dec-2027	10.010	0,00
16.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	16.671	0,01
10.000	EnerSys '144A' 4.375% 15-Dec-2027	9.506	0,00
75.000	EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA '144A' 5.375% 30-Dec-2030	58.590	0,03
60.000	EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029	58.786	0,03
40.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	39.597	0,02
120.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	122.616	0,06
10.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	9.784	0,00
25.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	24.523	0,01
20.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	16.581	0,01
10.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	8.748	0,00
11.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	9.583	0,00
100.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd 'REGS' 3.375% 12-May-2026	93.846	0,04
46.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	45.243	0,02
320.000	Enova International Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2028	329.920	0,15
11.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	10.899	0,01
35.000	EnQuest Plc '144A' 11.625% 01-Nov-2027	33.414	0,02
210.000	Entegris Escrow Corp '144A' 5.950% 15-Jun-2030	208.775	0,10
95.000	Entegris Inc '144A' 3.625% 01-May-2029	86.231	0,04
60.000	Entegris Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2028	57.151	0,03
90.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2026	44.425	0,02
79.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	76.390	0,04
65.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	64.433	0,03
11.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	11.261	0,01
51.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	48.246	0,02
10.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	9.320	0,00
29.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	29.011	0,01
30.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	30.561	0,01
208.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2027	214.093	0,10
35.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2030	37.668	0,02
50.000	EquipmentShare.com Inc '144A' 9.000% 15-May-2028	51.630	0,02
44.000	Evergreen Acqco 1 LP / TVI Inc '144A' 9.750% 26-Apr-2028	46.895	0,02
35.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	31.896	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
150.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	141.976	0,07
45.000	Fair Isaac Corp '144A' 5.250% 15-May-2026	44.719	0,02
35.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026	34.475	0,02
135.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	132.313	0,06
128.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	121.072	0,06
208.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 4.625% 15-Jan-2029	188.917	0,09
72.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	63.386	0,03
40.000	Finance of America Funding LLC '144A' 7.875% 15-Nov-2025	32.198	0,01
100.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 01-Mar-2026	90.024	0,04
200.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 15-Oct-2027	170.250	0,08
200.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 7.500% 01-Apr-2025	191.265	0,09
100.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 8.625% 01-Jun-2031	84.913	0,04
15.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	13.022	0,01
92.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	85.977	0,04
170.000	FirstCash Inc '144A' 5.625% 01-Jan-2030	162.994	0,07
10.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	9.308	0,00
135.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	113.880	0,05
95.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	82.183	0,04
258.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	182.263	0,08
109.000	FirstEnergy Corp 4.150 % 15-Jul-2027	104.922	0,05
11.000	FirstEnergy Corp 5.100 % 15-Jul-2047	10.084	0,00
10.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	11.809	0,01
10.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	9.550	0,00
180.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	165.074	0,08
65.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	62.531	0,03
40.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.875 % 15-Apr-2030	39.843	0,02
150.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125 % 15-Apr-2032	151.357	0,07
10.000	Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029	8.288	0,00
40.000	FORESEA Holding SA '144A' 7.500% 15-Jun-2030	37.080	0,02
50.000	Forestar Group Inc '144A' 3.850% 15-May-2026	47.593	0,02
30.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	29.045	0,01
195.000	Fortrea Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jul-2030	200.597	0,09
70.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028	67.415	0,03
93.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	92.788	0,04
32.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	33.311	0,02
200.000	Fortune Star BVI Ltd 5.000% 18-May-2026	146.710	0,07
45.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	40.507	0,02
40.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027	38.157	0,02
40.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026	39.569	0,02
95.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 12.000% 01-Oct-2028	103.906	0,05
91.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 12.250% 01-Oct-2030	99.833	0,05
60.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	50.912	0,02
177.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	163.681	0,08
220.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	212.698	0,10
235.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	200.840	0,09
15.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	13.431	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
160.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750 % 15-May-2030	164.721	0,08
50.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	47.755	0,02
115.000	FTAI Infra Escrow Holdings LLC '144A' 10.500% 01-Jun-2027	119.530	0,05
50.000	Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028	47.046	0,02
133.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250 % 15-Nov-2026	118.704	0,05
50.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250 % 15-Nov-2026	44.875	0,02
35.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	31.001	0,01
169.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	144.691	0,07
65.000	Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031	53.565	0,02
115.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	110.787	0,05
130.000	Garda World Security Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	116.734	0,05
44.000	Garda World Security Corp '144A' 7.750 % 15-Feb-2028	45.568	0,02
11.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	11.102	0,01
105.000	Garden Spinco Corp '144A' 8.625% 20-Jul-2030	112.490	0,05
20.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	18.518	0,01
200.000	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 'REGS' 7.125% 31-Jul-2026	197.028	0,09
135.000	Gen Digital Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025	133.771	0,06
109.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	110.918	0,05
110.000	Gen Digital Inc '144A' 7.125% 30-Sep-2030	115.078	0,05
10.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	10.000	0,00
97.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	97.437	0,04
125.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	127.268	0,06
50.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.875% 15-Apr-2030	51.737	0,02
11.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	10.029	0,00
35.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	32.049	0,01
70.000	GEO Group Inc/The 10.500% 30-Jun-2028	71.112	0,03
95.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	95.833	0,04
150.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	138.768	0,06
61.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	59.603	0,03
45.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	41.630	0,02
115.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	113.374	0,05
96.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2029	88.762	0,04
50.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029	47.142	0,02
40.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	39.603	0,02
140.000	GGAM Finance Ltd '144A' 7.750% 15-May-2026	142.249	0,07
52.000	GGAM Finance Ltd '144A' 8.000% 15-Feb-2027	53.233	0,02
10.000	GGAM Finance Ltd '144A' 8.000% 15-Jun-2028	10.357	0,01
20.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	20.023	0,01
53.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	37.328	0,02
85.000	Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051	72.915	0,03
32.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029	29.261	0,01
11.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2032	10.162	0,00
100.000	Global Marine Inc 7.000% 01-Jun-2028	87.020	0,04
71.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	56.474	0,03
10.000	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027	8.371	0,00
35.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	33.933	0,02
13.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	12.722	0,01
50.000	Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4.875% 22-Jan-2030	43.215	0,02
79.000	GN Bondco LLC '144A' 9.500% 15-Oct-2031	77.233	0,04
70.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	63.730	0,03
10.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	9.808	0,00
10.000	goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	9.639	0,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
64.000	goeasy Ltd '144A' 9.250% 01-Dec-2028	68.407	0,03
17.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	17.058	0,01
70.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	67.827	0,03
10.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026	9.855	0,00
10.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 15-Jul-2029	9.463	0,00
70.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250 % 30-Apr-2031	64.144	0,03
60.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250% 15-Jul-2031	54.513	0,03
30.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033	26.935	0,01
20.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000 % 15-Mar-2028	20.350	0,01
64.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	64.982	0,03
60.000	GoTo Group Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	29.080	0,01
154.000	GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026	142.997	0,07
70.000	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2028	51.164	0,02
95.000	GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028	63.093	0,03
100.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	99.331	0,05
50.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	45.060	0,02
70.000	Grand Canyon University 4.125% 01-Oct-2024	66.235	0,03
50.000	Grand Canyon University 5.125% 01-Oct-2028	44.833	0,02
155.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	144.592	0,07
40.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	36.136	0,02
40.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030	36.054	0,02
50.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	37.932	0,02
110.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	82.959	0,04
50.000	Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026	48.798	0,02
51.000	Gray Television Inc '144A' 7.000% 15-May-2027	48.524	0,02
60.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029	51.074	0,02
40.000	Greenfire Resources Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2028	39.771	0,02
66.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	64.930	0,03
85.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	77.180	0,04
99.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	91.854	0,04
57.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	47.977	0,02
65.000	Grupo Aeromexico SAB de CV 'REGS' 8.500% 17-Mar-2027	62.789	0,03
150.000	Grupo Aval Ltd 'REGS' 4.375% 04-Feb-2030	127.530	0,06
45.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA 'REGS' 5.500% 29-Apr-2026	44.214	0,02
60.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	60.691	0,03
285.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC '144A' 7.500% 15-Jan-2031	301.351	0,14
10.000	Guitar Center Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2026	8.761	0,00
60.000	Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026	60.716	0,03
120.000	H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028	109.142	0,05
11.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	10.891	0,01
145.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	139.947	0,06
160.000	Hanesbrands Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2031	156.953	0,07
45.000	Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026	44.030	0,02
64.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	59.748	0,03
30.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	29.867	0,01
145.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	136.371	0,06
75.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.750% 15-Sep-2030	63.239	0,03
75.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025	74.866	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
58.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 8.000% 15-Jun-2027	60.467	0,03
32.267	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	29.847	0,01
135.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	127.197	0,06
10.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	9.600	0,00
35.000	HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028	32.766	0,02
40.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	37.209	0,02
10.000	Heartland Dental LLC / Heartland Dental Finance Corp '144A' 10.500% 30-Apr-2028	10.388	0,01
60.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	60.480	0,03
45.000	Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl '144A' 4.625% 01-May-2028	41.359	0,02
276.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	272.882	0,13
90.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	88.911	0,04
19.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	15.608	0,01
90.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	80.772	0,04
165.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000 % 01-Dec-2029	135.591	0,06
205.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030	188.836	0,09
45.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	43.458	0,02
45.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.500% 15-Oct-2030	43.602	0,02
63.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	62.594	0,03
75.000	HF Sinclair Corp '144A' 6.375% 15-Apr-2027	75.668	0,03
20.000	H-Food Holdings LLC / Hearthsides Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	2.100	0,00
55.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	50.012	0,02
50.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	48.382	0,02
180.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 15-Apr-2030	174.889	0,08
80.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	77.465	0,04
55.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	54.843	0,03
45.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 15-Apr-2032	43.340	0,02
25.000	Hillenbrand Inc 3.750% 01-Mar-2031	21.610	0,01
35.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	34.634	0,02
10.000	Hillenbrand Inc 5.750% 15-Jun-2025	9.998	0,00
166.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	161.120	0,07
235.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	205.445	0,09
110.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	102.120	0,05
256.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	234.821	0,11
10.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025	9.998	0,00
99.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	99.131	0,05
75.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 4.875% 01-Jul-2031	66.460	0,03
68.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	62.815	0,03
10.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	9.856	0,00
2.000	Historic TW Inc Step-Up Coupon 8.300% 15-Jan-2036	2.344	0,00
21.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	16.511	0,01
260.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	235.970	0,11
50.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	48.035	0,02
70.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	68.494	0,03
49.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	43.747	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
75.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	65.178	0,03
65.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	62.562	0,03
35.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	34.694	0,02
40.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 8.875% 15-Jul-2028	42.026	0,02
10.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	9.139	0,00
24.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	24.000	0,01
85.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	87.282	0,04
36.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	37.633	0,02
30.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	31.616	0,01
270.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	274.065	0,13
10.000	HUB International Ltd '144A' 5.625% 01-Dec-2029	9.569	0,00
170.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	170.854	0,08
245.000	HUB International Ltd '144A' 7.250% 15-Jun-2030	258.942	0,12
40.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500 % 01-Apr-2026	38.796	0,02
70.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	68.690	0,03
160.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	140.958	0,06
104.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	82.093	0,04
200.000	Hunt Cos Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2029	178.622	0,08
10.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	9.981	0,00
85.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	71.081	0,03
90.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	89.506	0,04
125.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	112.612	0,05
144.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	137.502	0,06
65.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	63.871	0,03
321.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jan-2029	327.885	0,15
170.000	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	145.118	0,07
117.000	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	76.050	0,04
10.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	7.702	0,00
70.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	55.688	0,03
10.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4.750% 15-Sep-2026	9.590	0,00
10.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.000% 15-May-2027	9.754	0,00
40.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	39.300	0,02
200.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	178.792	0,08
165.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	164.795	0,08
150.000	Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028	149.372	0,07
40.000	Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028	38.296	0,02
210.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	199.850	0,09
45.000	Indika Energy Capital IV Pte Ltd 'REGS' 8.250% 22-Oct-2025	45.216	0,02
70.000	INEOS Finance Plc '144A' 6.750% 15-May-2028	68.968	0,03
10.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	8.966	0,00
45.000	Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031	39.762	0,02
125.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	113.653	0,05
30.000	INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026	23.250	0,01
11.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	10.731	0,01
115.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028	107.418	0,05
363.000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	346.732	0,16
20.000	Interface Inc '144A' 5.500% 01-Dec-2028	18.514	0,01
70.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	68.078	0,03
10.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	9.810	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
170.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	172.621	0,08
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	199.188	0,09
80.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.198% 01-Jun-2032	66.202	0,03
100.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	71.378	0,03
100.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029	94.558	0,04
55.000	ION Trading Technologies Sarl '144A' 5.750% 15-May-2028	48.574	0,02
239.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	236.908	0,11
216.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	212.134	0,10
50.000	IQVIA Inc '144A' 6.500 % 15-May-2030	51.454	0,02
10.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	10.008	0,00
40.000	Iris Holding Inc '144A' 10.000% 15-Dec-2028	35.000	0,02
20.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	16.999	0,01
264.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	241.189	0,11
99.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	96.682	0,04
119.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	112.837	0,05
50.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	48.110	0,02
50.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	48.640	0,02
277.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	265.028	0,12
11.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	10.445	0,01
10.000	Iron Mountain Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2029	10.285	0,00
225.000	Iron Mountain Information Management Services Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2032	206.102	0,09
11.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026	10.893	0,01
138.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	122.222	0,06
152.000	Jacobs Entertainment Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2029	143.021	0,07
50.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4.500% 01-Oct-2027	47.225	0,02
85.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	82.916	0,04
50.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	49.388	0,02
70.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	70.850	0,03
40.000	James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028	38.740	0,02
51.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	47.615	0,02
193.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	179.902	0,08
163.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 8.750% 15-Dec-2031	166.415	0,08
235.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	210.828	0,10
10.000	Jefferson Capital Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Aug-2026	9.582	0,00
11.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2025	10.654	0,01
10.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.875% 15-Dec-2027	9.460	0,00
200.000	JGSH Philippines Ltd 4.125% 09-Jul-2030	187.575	0,09
145.000	Jones Deslauriers Insurance Management Inc '144A' 8.500% 15-Mar-2030	152.452	0,07
35.000	Jones Deslauriers Insurance Management Inc '144A' 10.500% 15-Dec-2030	36.945	0,02
161.000	JSW Hydro Energy Ltd 'REGS' 4.125% 18-May-2031	140.454	0,06
90.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031	77.729	0,04
80.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028	74.088	0,03
40.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	39.469	0,02
200.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN 3.343% 02-Oct-2031	184.072	0,08
120.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	107.572	0,05
55.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	52.644	0,02
30.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	31.221	0,01
80.000	KB Home 7.250% 15-Jul-2030	82.888	0,04
30.000	KBR Inc '144A' 4.750% 30-Sep-2028	27.927	0,01
166.000	KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025	168.800	0,08
90.000	Kedrion SpA '144A' 6.500% 01-Sep-2029	82.350	0,04
8.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	8.036	0,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	9.505	0,00
145.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	121.221	0,06
100.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	81.182	0,04
11.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	8.750	0,00
150.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 4.750% 01-Jun-2027	147.858	0,07
200.000	KFH Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.600% 30-Jun-2026	182.532	0,08
130.000	Kinetik Holdings LP '144A' 5.875% 15-Jun-2030	127.735	0,06
157.000	Kinetik Holdings LP '144A' 6.625% 15-Dec-2028	160.073	0,07
200.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 3.200% 12-Jan-2031	167.681	0,08
260.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 5.750% 03-Apr-2029	263.677	0,12
35.000	KLX Energy Services Holdings Inc '144A' 11.500% 01-Nov-2025	34.539	0,02
59.000	Knife River Corp '144A' 7.750% 01-May-2031	62.909	0,03
10.500	Kobe US Midco 2 Inc '144A' 9.250% 01-Nov-2026	7.836	0,00
54.000	Kohl's Corp 4.250% 17-Jul-2025	52.746	0,02
100.000	Kohl's Corp 4.625% 01-May-2031	78.833	0,04
136.000	Kohl's Corp 5.550% 17-Jul-2045	91.135	0,04
45.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	40.735	0,02
10.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	9.670	0,00
170.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.125% 04-Apr-2026	162.232	0,07
65.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	63.434	0,03
80.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027	76.487	0,04
200.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd 4.229% 29-Oct-2026	178.007	0,08
170.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	154.594	0,07
20.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	19.471	0,01
75.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	63.328	0,03
130.000	LABL Inc '144A' 9.500% 01-Nov-2028	131.462	0,06
85.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	81.637	0,04
70.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027	66.019	0,03
70.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	63.201	0,03
10.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	9.874	0,00
10.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	8.895	0,00
50.000	Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028	47.158	0,02
55.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	50.573	0,02
110.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	106.778	0,05
174.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030	160.739	0,07
144.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032	131.582	0,06
70.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	68.535	0,03
25.000	Land O'Lakes Capital Trust I '144A' 7.450% 15-Mar-2028	23.948	0,01
45.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	45.047	0,02
11.000	Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-Jan-2028	11.312	0,01
83.000	Laredo Petroleum Inc '144A' 7.750% 31-Jul-2029	79.439	0,04
87.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	83.659	0,04
60.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	57.242	0,03
86.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	79.347	0,04
100.000	Latam Airlines Group SA 'REGS' 13.375% 15-Oct-2029	114.575	0,05
105.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	93.867	0,04
135.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	125.551	0,06
54.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	47.107	0,02
163.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	159.816	0,07
52.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	44.388	0,02
125.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025	116.011	0,05
35.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC '144A' 4.250% 01-Jul-2029	30.534	0,01
5.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	4.996	0,00
160.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	148.942	0,07

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
90.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	37.884	0,02
95.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	40.463	0,02
5.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	4.181	0,00
120.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	59.521	0,03
140.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	84.130	0,04
85.000	Level 3 Financing Inc '144A' 10.500% 15-May-2030	82.504	0,04
10.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	8.665	0,00
281.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.125% 30-Jun-2025	273.160	0,13
95.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.500% 30-Jun-2027	89.602	0,04
40.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	36.622	0,02
35.000	LFS Topco LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2026	32.223	0,02
10.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	8.637	0,00
63.000	LGI Homes Inc '144A' 8.750% 15-Dec-2028	67.056	0,03
65.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	27.558	0,01
30.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	13.229	0,01
55.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	36.241	0,02
75.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	74.948	0,03
80.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051	67.213	0,03
210.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	208.583	0,10
40.000	Life Time Inc '144A' 8.000% 15-Apr-2026	40.405	0,02
50.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	37.106	0,02
192.000	LifePoint Health Inc '144A' 9.875% 15-Aug-2030	194.233	0,09
10.000	Light & Wonder International Inc '144A' 7.500% 01-Sep-2031	10.435	0,01
225.000	Likewise Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	228.316	0,10
11.000	Lindblad Expeditions Holdings Inc '144A' 9.000% 15-May-2028	11.412	0,01
102.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	76.406	0,04
100.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	91.000	0,04
95.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2031	86.436	0,04
40.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2027	38.500	0,02
5.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	4.675	0,00
74.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	71.018	0,03
40.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	39.675	0,02
25.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	24.794	0,01
300.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	305.434	0,14
45.000	Louisiana-Pacific Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	40.361	0,02
35.000	LSB Industries Inc '144A' 6.250% 15-Oct-2028	33.252	0,02
45.000	LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029	38.103	0,02
95.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	91.242	0,04
30.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	8.538	0,00
80.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	22.880	0,01
130.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	84.020	0,04
90.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	27.084	0,01
40.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	25.400	0,01
35.000	M/I Homes Inc 3.950 % 15-Feb-2030	31.185	0,01
51.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	49.125	0,02
10.000	Macquarie Airfinance Holdings Ltd '144A' 8.375% 01-May-2028	10.482	0,01
80.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	58.510	0,03
10.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	8.114	0,00
25.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	19.536	0,01
16.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	14.142	0,01
11.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	10.568	0,01
83.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Mar-2030	78.969	0,04
40.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.125% 15-Mar-2032	37.899	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.700% 15-Jul-2034	8.494	0,00
100.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	91.072	0,04
100.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	88.259	0,04
200.000	MAF Global Securities Ltd FRN (Perpetual) 7.875% 30-Jun-2027	204.531	0,09
10.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	9.760	0,00
60.000	MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6.375% 01-Jun-2029	51.811	0,02
300.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 14.750% 14-Nov-2028	323.664	0,15
30.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	30.223	0,01
200.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	162.635	0,07
11.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	11.130	0,01
35.000	Marriott Ownership Resorts Inc 4.750% 15-Jan-2028	32.181	0,01
45.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 4.500% 15-Jun-2029	39.706	0,02
30.000	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 15-Feb-2028	30.929	0,01
35.000	Masonite International Corp '144A' 3.500% 15-Feb-2030	30.381	0,01
70.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	67.295	0,03
40.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	39.735	0,02
46.000	Matador Resources Co '144A' 6.875% 15-Apr-2028	46.735	0,02
10.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	8.650	0,00
40.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028	38.333	0,02
40.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	39.112	0,02
262.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	254.689	0,12
85.000	Mativ Holdings Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	81.631	0,04
75.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	69.588	0,03
25.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	24.311	0,01
35.000	Matthews International Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2025	34.136	0,02
390.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.875% 15-Aug-2026	397.213	0,18
180.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 9.250% 15-Apr-2027	176.869	0,08
40.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A' 11.500% 01-Sep-2028	41.500	0,02
193.250	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS' 7.250% 30-Jun-2031	151.690	0,07
125.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028	120.659	0,06
60.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	55.858	0,03
100.000	Medco Bell Pte Ltd 'REGS' 6.375% 30-Jan-2027	95.281	0,04
100.000	Medco Oak Tree Pte Ltd 'REGS' 7.375% 14-May-2026	99.416	0,05
520.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	470.710	0,22
290.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	273.677	0,13
50.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	48.638	0,02
50.000	MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027	50.830	0,02
110.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 04-Dec-2029	97.335	0,04
100.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.750% 21-Jul-2028	92.236	0,04
200.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	194.164	0,09
103.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	99.380	0,05
55.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.625% 17-Jul-2027	51.059	0,02
50.000	MercadoLibre Inc 3.125% 14-Jan-2031	42.820	0,02
130.000	Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029	111.839	0,05
10.000	Mercer International Inc 5.500% 15-Jan-2026	9.584	0,00
125.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	123.846	0,06
10.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	9.844	0,00
80.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	78.245	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
70.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	67.425	0,03
30.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	26.230	0,01
80.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	72.434	0,03
49.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	47.745	0,02
10.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	9.521	0,00
95.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.250% 18-Jun-2025	93.375	0,04
105.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	102.719	0,05
40.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	39.066	0,02
100.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	95.339	0,04
35.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	34.744	0,02
150.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	149.524	0,07
55.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	55.210	0,03
100.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	80.114	0,04
160.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	100.905	0,05
10.000	MicroStrategy Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2028	9.712	0,00
45.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 5.625% 15-Jan-2030	39.150	0,02
115.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	107.971	0,05
10.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5.375% 15-Aug-2027	9.756	0,00
10.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	9.311	0,00
85.000	Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026	60.432	0,03
100.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	83.174	0,04
72.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	68.311	0,03
100.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.000% 01-Nov-2027	102.663	0,05
60.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	61.133	0,03
25.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.500% 01-May-2030	26.094	0,01
35.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	33.692	0,02
100.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	82.539	0,04
50.000	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2030	44.308	0,02
18.000	Mobius Merger Sub Inc '144A' 9.000% 01-Jun-2030	17.483	0,01
140.000	MovivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	114.696	0,05
55.000	MovivCare Inc '144A' 5.875% 15-Nov-2025	54.374	0,03
325.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 8.000% 01-Feb-2026	306.998	0,14
81.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 13.250% 15-Dec-2027	86.316	0,04
11.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	9.897	0,00
60.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032	52.516	0,02
70.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	66.301	0,03
41.503	Mong Duong Finance Holdings BV 'REGS' 5.125% 07-May-2029	38.649	0,02
42.000	Moog Inc '144A' 4.250% 15-Dec-2027	39.700	0,02
70.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	69.886	0,03
65.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	66.738	0,03
45.000	Motion Bondco DAC '144A' 6.625% 15-Nov-2027	41.850	0,02
110.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	98.621	0,05
135.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	111.011	0,05
50.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.500% 15-Mar-2031	31.312	0,01
12.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	8.640	0,00
120.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027	98.127	0,05
10.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.250% 01-Aug-2026	8.948	0,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS' 6.500% 13-Oct-2026	202.196	0,09
65.000	Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	59.287	0,03
90.000	Murphy Oil Corp 5.875 % 01-Dec-2027	89.647	0,04
10.000	Murphy Oil Corp 5.875 % 01-Dec-2042	8.826	0,00
24.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	24.157	0,01
100.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	94.860	0,04
111.000	Murphy Oil USA Inc 5.625% 01-May-2027	110.212	0,05
80.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	69.699	0,03
161.272	MV24 Capital BV 'REGS' 6.748% 01-Jun-2034	151.082	0,07
125.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	125.036	0,06
83.000	Nabors Industries Inc '144A' 7.375% 15-May-2027	81.402	0,04
107.000	Nabors Industries Inc '144A' 9.125% 31-Jan-2030	107.527	0,05
70.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026	67.355	0,03
60.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.500% 15-Jan-2028	52.187	0,02
78.637	NAC Aviation 29 DAC 4.750% 30-Jun-2026	72.444	0,03
70.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030	63.558	0,03
125.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	120.587	0,06
75.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031	70.044	0,03
10.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	9.935	0,00
30.000	Navient Corp 4.875% 15-Mar-2028	27.906	0,01
10.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	9.663	0,00
65.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	60.009	0,03
142.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	142.059	0,07
40.000	Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025	40.515	0,02
85.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	86.341	0,04
20.000	Navient Corp 9.375% 25-Jul-2030	20.974	0,01
75.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	61.485	0,03
50.000	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc 'REGS' 10.750% 01-Jul-2025	49.431	0,02
100.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026	101.190	0,05
60.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	58.388	0,03
75.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	73.273	0,03
50.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875 % 15-Feb-2027	49.606	0,02
40.000	NCL Corp Ltd '144A' 7.750 % 15-Feb-2029	40.226	0,02
179.000	NCL Corp Ltd '144A' 8.125% 15-Jan-2029	187.032	0,09
80.000	NCL Corp Ltd '144A' 8.375 % 01-Feb-2028	84.824	0,04
90.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	86.043	0,04
195.000	NCR Atleos Corp '144A' 9.500% 01-Apr-2029	207.357	0,10
26.000	NCR Corp '144A' 5.000% 01-Oct-2028	24.615	0,01
170.000	NCR Corp '144A' 5.125% 15-Apr-2029	161.775	0,07
172.000	NCR Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2030	158.135	0,07
60.000	Necessity Retail REIT Inc/The / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	50.591	0,02
80.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 3.625% 28-Jun-2031	66.518	0,03
380.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	354.570	0,16
180.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025	178.522	0,08
130.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	120.327	0,06
80.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.975% 03-Mar-2026	74.600	0,03
10.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	9.552	0,00
10.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	10.042	0,00
415.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	398.865	0,18
354.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	351.298	0,16
5.000	New Gold Inc '144A' 7.500% 15-Jul-2027	5.051	0,00
200.000	New Home Co Inc/The '144A' 8.250% 15-Oct-2027	186.780	0,09
20.000	Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024	19.631	0,01
40.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	39.374	0,02
300.000	Newell Brands Inc 5.200 % 01-Apr-2026	296.166	0,14
31.000	Newell Brands Inc 6.375% 15-Sep-2027	30.925	0,01
25.000	Newell Brands Inc 6.375 % 01-Apr-2036	22.904	0,01
42.000	Newell Brands Inc 6.500 % 01-Apr-2046	35.019	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
70.000	Newell Brands Inc 6.625% 15-Sep-2029	69.863	0,03
185.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	170.368	0,08
61.000	News Corp '144A' 5.125% 15-Feb-2032	57.994	0,03
160.000	Nexa Resources SA 'REGS' 5.375% 04-May-2027	156.320	0,07
45.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	41.505	0,02
261.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	252.567	0,12
76.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	72.484	0,03
11.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.500% 15-Sep-2027	10.596	0,01
114.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 7.250% 15-Jan-2029	119.301	0,05
175.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	173.357	0,08
128.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	130.189	0,06
60.000	NFP Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2030	63.860	0,03
45.000	NFP Corp '144A' 8.500% 01-Oct-2031	48.745	0,02
215.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	217.329	0,10
70.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025	69.914	0,03
10.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026	9.953	0,00
40.000	Nine Energy Service Inc 13.000% 01-Feb-2028	35.489	0,02
110.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	105.856	0,05
35.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	35.098	0,02
10.000	Noble Finance II LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2030	10.444	0,01
120.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	111.910	0,05
55.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	47.915	0,02
35.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	25.018	0,01
5.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	5.080	0,00
205.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	207.776	0,10
20.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.750% 15-Jun-2031	20.833	0,01
10.000	Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	9.708	0,00
45.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027	43.011	0,02
95.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	87.926	0,04
10.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	10.107	0,00
55.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	51.808	0,02
89.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	78.558	0,04
125.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	117.760	0,05
150.000	NRG Energy Inc 5.750% 15-Jan-2028	149.535	0,07
23.000	NRG Energy Inc 6.625% 15-Jan-2027	23.062	0,01
25.000	NRG Energy Inc '144A' 3.375 % 15-Feb-2029	22.123	0,01
220.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625 % 15-Feb-2031	189.298	0,09
11.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875 % 15-Feb-2032	9.429	0,00
12.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	11.632	0,01
15.000	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A' 5.000% 27-Jan-2030	13.929	0,01
25.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	24.916	0,01
45.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	44.703	0,02
42.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	41.964	0,02
40.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	40.128	0,02
50.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	48.520	0,02
131.000	Oceaneering International Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2028	129.035	0,06
20.000	Odeon Finco Plc '144A' 12.750% 01-Nov-2027	20.327	0,01
43.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	24.151	0,01
35.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	21.751	0,01
84.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	41.962	0,02
41.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 6.800% 24-Jan-2030	38.954	0,02
80.000	Oi European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	74.907	0,03
25.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	23.870	0,01
75.000	Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027	73.264	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
11.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	10.836	0,01
200.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	180.162	0,08
14.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250 % 01-Oct-2029	12.446	0,01
212.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 9.750% 15-Nov-2028	225.156	0,10
65.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3.875% 01-Sep-2028	60.346	0,03
50.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	46.308	0,02
40.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	35.428	0,02
120.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	102.841	0,05
115.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	107.975	0,05
10.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	10.104	0,00
147.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	148.923	0,07
185.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	188.624	0,09
108.000	OneMain Finance Corp 7.875% 15-Mar-2030	111.281	0,05
80.000	OneMain Finance Corp 9.000% 15-Jan-2029	84.692	0,04
5.000	Ontario Gaming GTA LP '144A' 8.000% 01-Aug-2030	5.160	0,00
285.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 15-Feb-2028	265.152	0,12
160.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 01-Dec-2029	143.618	0,07
115.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 15-Feb-2030	104.201	0,05
98.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2031	86.845	0,04
55.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	49.778	0,02
260.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	239.626	0,11
245.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	209.871	0,10
60.000	Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026	17.850	0,01
16.000	Oscar AcquisitionCo LLC / Oscar Finance Inc '144A' 9.500% 15-Apr-2030	15.619	0,01
40.000	OT Merger Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2029	24.003	0,01
35.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2029	31.617	0,01
60.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030	53.594	0,02
12.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	11.620	0,01
65.000	Owens & Minor Inc 4.375% 15-Dec-2024	64.108	0,03
55.000	Owens & Minor Inc '144A' 4.500% 31-Mar-2029	48.572	0,02
65.000	Owens & Minor Inc '144A' 6.625% 01-Apr-2030	62.412	0,03
15.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.375% 15-Aug-2025	15.106	0,01
140.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.625% 13-May-2027	140.175	0,06
55.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	44.749	0,02
75.000	Pacific Western Bank FRN 3.250% 01-May-2031	64.634	0,03
90.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	84.081	0,04
10.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	9.327	0,00
120.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	121.906	0,06
150.000	Pampa Energia SA 'REGS' 7.500% 24-Jan-2027	146.573	0,07
41.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	36.322	0,02
75.000	Paramount Global FRN 6.250% 28-Feb-2057	65.778	0,03
86.000	Paramount Global FRN 6.375% 30-Mar-2062	77.503	0,04
60.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	55.564	0,03
60.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	59.064	0,03
55.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	55.346	0,03
90.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	72.226	0,03
10.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.500% 01-Oct-2029	9.178	0,00
10.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.625% 01-May-2030	9.211	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 5.875% 15-Jul-2027	9.966	0,00
110.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	101.874	0,05
15.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	13.700	0,01
10.000	Patrick Industries Inc '144A' 7.500% 15-Oct-2027	10.054	0,00
50.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	47.332	0,02
40.000	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2029	35.390	0,02
50.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	48.607	0,02
79.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 7.875% 15-Sep-2030	80.975	0,04
10.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029	5.110	0,00
30.000	Pediatrx Medical Group Inc '144A' 5.375% 15-Feb-2030	26.742	0,01
20.000	Penn Entertainment Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2029	17.184	0,01
10.000	Penn Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2027	9.712	0,00
58.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	52.275	0,02
45.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	44.522	0,02
80.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	74.192	0,03
40.000	Penske Automotive Group Inc 3.500% 01-Sep-2025	38.834	0,02
45.000	Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029	40.037	0,02
140.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	137.550	0,06
80.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	73.470	0,03
129.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	127.254	0,06
30.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	30.145	0,01
200.000	Petriama Holdings LLC/DE 5.950% 19-Apr-2026	197.356	0,09
30.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	30.018	0,01
54.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 7.000% 15-Jan-2032	55.699	0,03
140.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 9.875% 15-Jul-2031	155.733	0,07
50.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	48.574	0,02
76.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	73.499	0,03
35.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.650 % 15-Jun-2030	31.878	0,01
200.000	Peru LNG Srl 'REGS' 5.375% 22-Mar-2030	165.696	0,08
61.000	Petrofac Ltd '144A' 9.750% 15-Nov-2026	32.084	0,01
200.000	Petron Corp FRN (Perpetual) 5.950% 19-Apr-2026	187.232	0,09
100.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl 'REGS' 6.125% 09-Jun-2026	98.349	0,05
145.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	136.906	0,06
110.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	107.077	0,05
75.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	73.218	0,03
100.000	PG&E Corp 5.250% 01-Jul-2030	96.628	0,04
105.000	PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026	94.148	0,04
70.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	66.774	0,03
107.000	Pike Corp '144A' 8.625% 31-Jan-2031	112.583	0,05
11.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6.875% 15-Mar-2027	10.285	0,00
45.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7.250% 15-Mar-2029	38.579	0,02
35.000	Plantronics Inc '144A' 4.750% 01-Mar-2029	30.406	0,01
68.000	Playtika Holding Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	59.399	0,03
10.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	10.152	0,00
70.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	21.875	0,01
12.000	Port of Newcastle Investments Financing Pty Ltd '144A' 5.900% 24-Nov-2031	10.864	0,01
291.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	261.355	0,12
265.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	244.080	0,11
165.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	159.182	0,07
11.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	10.909	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
87.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	86.442	0,04
40.000	PRA Group Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	33.043	0,02
35.000	PRA Group Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	34.748	0,02
44.000	PRA Group Inc '144A' 8.375 % 01-Feb-2028	42.387	0,02
125.000	PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026	117.304	0,05
141.000	Precision Drilling Corp '144A' 6.875% 15-Jan-2029	136.124	0,06
44.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	44.004	0,02
10.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	7.940	0,00
10.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031	7.745	0,00
30.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4.875% 01-Feb-2027	29.434	0,01
51.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8.250% 01-Feb-2028	51.577	0,02
50.000	Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031	43.870	0,02
50.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	48.604	0,02
215.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	209.860	0,10
130.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	120.570	0,06
90.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	90.443	0,04
114.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	113.520	0,05
123.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	113.473	0,05
70.000	PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	64.596	0,03
50.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	53.750	0,02
84.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025	77.502	0,04
43.000	PTC Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2025	42.097	0,02
105.000	PTC Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2028	99.599	0,05
200.000	Puma International Financing SA '144A' 5.000% 24-Jan-2026	190.330	0,09
55.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	39.772	0,02
65.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	61.090	0,03
225.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	178.346	0,08
20.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	12.146	0,01
15.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	7.899	0,00
70.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2028	28.182	0,01
60.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5.375% 01-Dec-2028	21.684	0,01
55.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	41.984	0,02
175.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	85.920	0,04
85.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	43.685	0,02
51.000	Rain Carbon Inc '144A' 12.250% 01-Sep-2029	49.916	0,02
150.000	Rakuten Group Inc '144A' 10.250% 30-Nov-2024	154.125	0,07
60.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125 % 22-Apr-2026	48.578	0,02
133.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	90.945	0,04
19.000	Rand Parent LLC '144A' 8.500% 15-Feb-2030	18.215	0,01
70.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	69.180	0,03
175.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	181.271	0,08
20.000	Range Resources Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2030	18.510	0,01
10.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	9.529	0,00
116.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 7.625% 15-Jan-2026	106.578	0,05
65.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	56.111	0,03
83.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.250% 15-Apr-2030	62.071	0,03
84.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	65.398	0,03
180.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030	163.307	0,07
139.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A' 9.750% 01-Dec-2026	138.308	0,06
100.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 'REGS' 4.500% 14-Jul-2028	89.041	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
55.000	Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029	51.676	0,02
10.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	8.738	0,00
100.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	82.128	0,04
100.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	87.268	0,04
50.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	48.331	0,02
50.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029	46.543	0,02
97.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 7.250% 15-Jul-2028	100.910	0,05
258.000	RingCentral Inc '144A' 8.500% 15-Aug-2030	264.085	0,12
150.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2028	154.623	0,07
220.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Mar-2031	234.819	0,11
40.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	39.419	0,02
45.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026	42.671	0,02
175.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	157.439	0,07
55.000	ROBLOX Corp '144A' 3.875% 01-May-2030	49.100	0,02
92.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	87.073	0,04
150.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	138.502	0,06
75.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	67.967	0,03
110.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	96.822	0,04
95.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033	80.878	0,04
75.000	Rocket Software Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2029	65.330	0,03
40.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	38.745	0,02
11.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	10.079	0,00
70.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	66.960	0,03
81.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	79.654	0,04
11.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	11.122	0,01
127.000	Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	122.192	0,06
10.000	Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029	9.267	0,00
90.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	86.782	0,04
40.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750 % 15-Oct-2027	40.095	0,02
50.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	46.128	0,02
45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	47.367	0,02
45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	43.481	0,02
225.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.375% 15-Jul-2027	222.902	0,10
15.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	14.868	0,01
105.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	103.751	0,05
45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2030	47.035	0,02
135.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 8.250% 15-Jan-2029	143.555	0,07
10.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	10.767	0,01
110.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.625% 15-Aug-2027	119.775	0,06
70.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	56.084	0,03
136.840	RRD Parent Inc '144A' 10.000% 15-Oct-2031	234.681	0,11
100.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	85.232	0,04
40.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 5.250% 10-Jan-2028	38.539	0,02
30.000	Ryan Specialty Group LLC '144A' 4.375% 01-Feb-2030	27.862	0,01
135.000	Sabre GLBL Inc '144A' 8.625% 01-Jun-2027	122.739	0,06
130.000	Sabre GLBL Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2027	127.810	0,06
11.000	Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031	11.495	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
50.000	Sagcor Financial Co Ltd '144A' 5.300% 13-May-2028	48.053	0,02
50.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025	50.039	0,02
50.000	Sasol Financing USA LLC 4.375% 18-Sep-2026	46.617	0,02
50.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	42.166	0,02
50.000	Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028	47.687	0,02
200.000	Sasol Financing USA LLC 'REGS' 8.750% 03-May-2029	204.264	0,09
165.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	148.457	0,07
145.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	139.386	0,06
40.000	Science Applications International Corp '144A' 4.875% 01-Apr-2028	38.259	0,02
55.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	52.064	0,02
60.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	60.659	0,03
150.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	153.734	0,07
145.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	135.883	0,06
75.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	70.143	0,03
170.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026	163.390	0,07
48.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.375% 01-Feb-2032	40.737	0,02
35.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	31.194	0,01
61.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	54.014	0,02
15.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375 % 15-Jan-2031	11.026	0,01
120.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	106.724	0,05
111.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	102.806	0,05
40.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	35.810	0,02
95.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	94.305	0,04
120.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	117.824	0,05
45.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	43.296	0,02
115.000	Seagate HDD Cayman 9.625 % 01-Dec-2032	131.600	0,06
11.000	Seagate HDD Cayman '144A' 8.500% 15-Jul-2031	11.948	0,01
140.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	131.488	0,06
95.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	91.506	0,04
50.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	50.050	0,02
40.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	42.470	0,02
85.000	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US '144A' 6.125% 01-Feb-2028	85.756	0,04
100.000	Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029	83.745	0,04
170.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	158.900	0,07
15.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	15.104	0,01
30.000	SEG Holding LLC / SEG Finance Corp '144A' 5.625% 15-Oct-2028	30.145	0,01
141.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	141.836	0,07
110.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029	102.357	0,05
50.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	50.107	0,02
125.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.875% 01-Sep-2030	124.301	0,06
60.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	52.971	0,02
40.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	37.202	0,02
70.000	Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030	61.076	0,03
120.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	107.586	0,05
60.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	58.097	0,03
60.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	58.950	0,03
135.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	110.750	0,05
40.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	31.101	0,01
40.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	37.379	0,02
11.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	9.971	0,00
147.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	121.844	0,06
49.000	Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027	44.911	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
140.000	Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025	141.708	0,07
10.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 15-Feb-2028	9.412	0,00
50.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 01-Apr-2029	46.262	0,02
200.000	Shelf Drilling Holdings Ltd 'REGS' 9.625% 15-Apr-2029	195.862	0,09
45.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	43.787	0,02
70.000	SierraCol Energy Andina LLC 'REGS' 6.000% 15-Jun-2028	58.955	0,03
40.000	Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026	36.047	0,02
60.000	Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	42.960	0,02
175.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	167.306	0,08
100.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	86.694	0,04
200.000	Simpair Europe SA 'REGS' 5.200% 26-Jan-2031	173.465	0,08
95.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030	67.093	0,03
10.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2027	8.934	0,00
108.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030	81.141	0,04
100.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	94.081	0,04
80.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	68.537	0,03
50.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	46.241	0,02
100.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	89.109	0,04
100.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	96.594	0,04
18.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	17.422	0,01
55.000	Sitio Royalties Operating Partnership LP / Sitio Finance Corp '144A' 7.875% 01-Nov-2028	57.038	0,03
90.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 7.250% 15-May-2031	90.336	0,04
30.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	30.159	0,01
68.000	SK Invictus Intermediate II Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029	59.065	0,03
11.000	SLM Corp 3.125% 02-Nov-2026	10.266	0,00
40.000	SLM Corp 4.200 % 29-Oct-2025	38.836	0,02
10.000	SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025	9.862	0,00
50.000	SM Energy Co 6.500% 15-Jul-2028	50.078	0,02
11.000	SM Energy Co 6.625% 15-Jan-2027	10.934	0,01
50.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	49.884	0,02
200.000	SMC Global Power Holdings Corp FRN (Perpetual) 7.000% 21-Oct-2025	178.335	0,08
140.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	138.056	0,06
200.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 8.875% 15-Nov-2031	210.482	0,10
37.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	37.561	0,02
55.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	50.175	0,02
60.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.875% 15-Nov-2031	53.549	0,02
125.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	120.676	0,06
5.000	Sotheby's/Bidfair Holdings Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	4.372	0,00
10.000	South Jersey Industries Inc 5.020% 15-Apr-2031	8.058	0,00
180.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	166.780	0,08
70.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	68.385	0,03
35.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	34.247	0,02
50.000	Southwestern Energy Co 5.700 % 23-Jan-2025	49.823	0,02
35.000	Spanish Broadcasting System Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2026	20.516	0,01
40.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	36.452	0,02
50.000	SPCM SA '144A' 3.375 % 15-Mar-2030	42.979	0,02
80.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	78.536	0,04
70.000	Spectrum Brands Inc '144A' 3.875% 15-Mar-2031	63.831	0,03
10.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	9.571	0,00
15.000	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2027	14.129	0,01
124.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	109.816	0,05
58.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	41.359	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
66.667	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	47.539	0,02
11.000	SPX FLOW Inc '144A' 8.750% 01-Apr-2030	11.013	0,01
70.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	66.487	0,03
115.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	107.360	0,05
30.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	28.477	0,01
198.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	195.231	0,09
95.000	Stagwell Global LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	87.498	0,04
116.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	99.955	0,05
190.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	175.062	0,08
110.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	106.015	0,05
60.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	58.536	0,03
235.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	218.803	0,10
120.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	87.583	0,04
120.000	Star Parent Inc '144A' 9.000% 01-Oct-2030	126.623	0,06
47.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	46.416	0,02
10.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.625% 15-Jul-2026	9.482	0,00
150.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.750% 31-Dec-2024	147.308	0,07
10.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2027	9.435	0,00
120.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	113.133	0,05
15.000	Station Casinos LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2031	13.540	0,01
10.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	9.494	0,00
35.000	Stena International SA '144A' 6.125% 01-Feb-2025	34.887	0,02
100.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	90.823	0,04
100.000	Stillwater Mining Co 'REGS' 4.000% 16-Nov-2026	89.188	0,04
100.000	Stillwater Mining Co 'REGS' 4.500% 16-Nov-2029	79.417	0,04
100.000	StoneCo Ltd 'REGS' 3.950% 16-Jun-2028	86.311	0,04
45.000	StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	35.368	0,02
165.000	Strathcona Resources Ltd/Alberta '144A' 6.875% 01-Aug-2026	157.743	0,07
10.000	Studio City Co Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2027	9.848	0,00
145.000	Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029	121.944	0,06
50.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025	49.045	0,02
250.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.500 % 15-Jan-2028	232.206	0,11
10.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	9.997	0,00
108.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	98.884	0,05
150.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	140.641	0,06
60.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	58.106	0,03
10.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	10.019	0,00
25.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025	24.400	0,01
213.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp '144A' 9.000% 15-Oct-2026	212.771	0,10
55.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	49.587	0,02
10.000	Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026	8.521	0,00
45.000	Sunnova Energy Corp '144A' 11.750% 01-Oct-2028	40.854	0,02
85.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	78.995	0,04
105.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 30-Apr-2030	97.330	0,04
35.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	34.990	0,02
95.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027	95.323	0,04
70.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 7.000% 15-Sep-2028	72.248	0,03
50.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	46.409	0,02
26.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	26.105	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
24.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	24.304	0,01
70.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	50.383	0,02
35.000	Synaptics Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	31.442	0,01
80.000	Synchrony Financial 7.250% 02-Feb-2033	79.633	0,04
50.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 8.625% 01-Jun-2030	53.384	0,02
70.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028	66.224	0,03
20.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	19.578	0,01
100.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030	93.120	0,04
160.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	148.600	0,07
10.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	10.060	0,00
50.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	51.469	0,02
85.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	82.320	0,04
141.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	141.658	0,07
45.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	45.277	0,02
12.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	10.063	0,00
125.000	TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026	124.911	0,06
159.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	148.716	0,07
150.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	137.629	0,06
25.000	TEGNA Inc '144A' 4.750 % 15-Mar-2026	24.351	0,01
105.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	99.839	0,05
71.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	69.513	0,03
135.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	135.927	0,06
120.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	122.275	0,06
50.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	48.875	0,02
50.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	47.466	0,02
200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	187.920	0,09
30.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	17.758	0,01
75.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	47.017	0,02
35.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	16.536	0,01
10.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp '144A' 5.750% 01-Jun-2025	10.054	0,00
55.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2031	46.572	0,02
105.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	94.926	0,04
100.000	Tenet Healthcare Corp 4.250 % 01-Jun-2029	93.278	0,04
60.000	Tenet Healthcare Corp 4.375% 15-Jan-2030	55.678	0,03
235.000	Tenet Healthcare Corp 4.625 % 15-Jun-2028	224.303	0,10
80.000	Tenet Healthcare Corp 4.875% 01-Jan-2026	79.172	0,04
85.000	Tenet Healthcare Corp 5.125 % 01-Nov-2027	83.151	0,04
373.000	Tenet Healthcare Corp 6.125% 01-Oct-2028	372.273	0,17
235.000	Tenet Healthcare Corp 6.125 % 15-Jun-2030	237.849	0,11
54.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.750% 15-May-2031	55.258	0,03
100.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 4.000% 15-Aug-2026	94.310	0,04
393.000	Tenneco Inc '144A' 8.000% 17-Nov-2028	335.881	0,15
85.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	80.206	0,04
10.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	9.311	0,00
80.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	77.682	0,04
85.000	Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	89.634	0,04
125.000	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC 6.150% 01-Feb-2036	119.787	0,06
285.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.150% 01-Oct-2026	264.107	0,12
180.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.100% 01-Oct-2046	122.097	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
11.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.750% 09-May-2027	10.546	0,01
165.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5.125% 09-May-2029	157.742	0,07
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6.750% 01-Mar-2028	102.300	0,05
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.875% 15-Sep-2029	107.822	0,05
55.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 8.125% 15-Sep-2031	60.138	0,03
10.000	Texas Capital Bancshares Inc FRN 4.000% 06-May-2031	8.687	0,00
10.000	Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029	8.932	0,00
70.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	70.509	0,03
30.000	Titan International Inc 7.000% 30-Apr-2028	30.045	0,01
35.000	TK Elevator Holdco GmbH '144A' 7.625% 15-Jul-2028	34.422	0,02
75.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	73.752	0,03
110.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	101.869	0,05
60.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	54.361	0,03
50.000	TMS International Corp/DE '144A' 6.250% 15-Apr-2029	41.318	0,02
30.000	Toledo Hospital/The 4.982% 15-Nov-2045	20.212	0,01
10.000	Toledo Hospital/The 5.325% 15-Nov-2028	9.200	0,00
160.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	125.435	0,06
10.817	Topaz Solar Farms LLC '144A' 4.875 % 30-Sep-2039	9.970	0,00
93.743	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	93.334	0,04
70.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	63.502	0,03
11.000	TopBuild Corp '144A' 4.125% 15-Feb-2032	9.801	0,00
50.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV 'REGS' 6.375% 20-Sep-2028	20.377	0,01
55.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV 'REGS' 7.500% 12-Nov-2025	36.669	0,02
20.000	Townsquare Media Inc '144A' 6.875% 01-Feb-2026	19.611	0,01
35.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	35.067	0,02
20.000	TransAlta Corp 7.750% 15-Nov-2029	21.239	0,01
175.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	164.413	0,08
195.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	182.533	0,08
366.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	358.773	0,16
480.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	479.628	0,22
353.000	TransDigm Inc '144A' 6.750% 15-Aug-2028	361.565	0,17
215.000	TransDigm Inc '144A' 6.875% 15-Dec-2030	221.591	0,10
39.000	Transocean Aquila Ltd '144A' 8.000% 30-Sep-2028	39.607	0,02
75.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	60.226	0,03
10.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	8.815	0,00
50.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	44.826	0,02
35.000	Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	34.510	0,02
70.000	Transocean Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	68.848	0,03
100.000	Transocean Inc '144A' 8.000% 01-Feb-2027	97.601	0,04
27.550	Transocean Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2030	28.811	0,01
170.000	Transocean Inc '144A' 11.500% 30-Jan-2027	177.776	0,08
11.250	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	11.219	0,01
10.000	Transocean Titan Financing Ltd '144A' 8.375% 01-Feb-2028	10.382	0,01
100.000	Transportadora de Gas del Sur SA 'REGS' 6.750% 02-May-2025	95.752	0,04
105.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	104.746	0,05
61.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.500% 01-Dec-2029	54.703	0,03
19.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030	17.015	0,01
158.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	159.729	0,07
84.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	74.462	0,03
35.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	34.427	0,02
35.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	34.668	0,02
10.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 12.750% 31-Dec-2028	10.712	0,01
35.000	TriMas Corp '144A' 4.125% 15-Apr-2029	31.489	0,01
76.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	68.347	0,03
98.000	TriNet Group Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2031	101.032	0,05
11.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	10.848	0,01

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Trinity Industries Inc '144A' 7.750% 15-Jul-2028	20.674	0,01
55.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	22.524	0,01
76.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	66.285	0,03
92.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	91.836	0,04
135.000	Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	143.694	0,07
195.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.500% 15-Aug-2026	191.520	0,09
105.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	103.106	0,05
137.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	121.397	0,06
35.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	31.836	0,01
185.000	Tullov Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	165.260	0,08
200.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları AS 'REGS' 6.950% 14-Mar-2026	199.732	0,09
10.000	Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026	9.341	0,00
115.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	112.361	0,05
30.000	Twilio Inc 3.625% 15-Mar-2029	27.400	0,01
25.000	Twilio Inc 3.875% 15-Mar-2031	22.317	0,01
80.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	76.454	0,04
175.000	Uber Technologies Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	175.594	0,08
330.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027	341.964	0,16
5.000	Uber Technologies Inc '144A' 8.000% 01-Nov-2026	5.096	0,00
200.000	Ulker Bisküvi Sanayi AS 'REGS' 6.950% 30-Oct-2025	196.860	0,09
80.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	75.591	0,03
185.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459 % 30-Jun-2035	174.359	0,08
85.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	83.297	0,04
150.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	154.553	0,07
65.000	Unisys Corp '144A' 6.875% 01-Nov-2027	58.589	0,03
35.000	United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-Jan-2025	34.599	0,02
345.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	336.624	0,15
260.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	243.448	0,11
140.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	113.520	0,05
60.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	53.350	0,02
241.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	230.204	0,11
90.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	81.882	0,04
55.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	50.728	0,02
198.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	193.255	0,09
75.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	74.070	0,03
87.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	87.251	0,04
43.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	43.914	0,02
12.000	United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029	12.291	0,01
120.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	119.418	0,05
80.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	75.830	0,03
35.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	34.340	0,02
200.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	139.978	0,06
115.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	83.059	0,04
191.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 10.500% 15-Feb-2028	193.781	0,09
10.000	Universal Entertainment Corp '144A' 8.750% 11-Dec-2024	10.747	0,01
140.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	125.430	0,06
37.000	Univision Communications Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2025	36.894	0,02
280.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	279.412	0,13
95.000	Univision Communications Inc '144A' 7.375 % 30-Jun-2030	95.119	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
76.000	Univision Communications Inc '144A' 8.000% 15-Aug-2028	78.473	0,04
165.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	145.418	0,07
45.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	42.467	0,02
78.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	66.374	0,03
155.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	129.688	0,06
70.000	US Foods Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	65.327	0,03
90.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	85.562	0,04
60.000	US Foods Inc '144A' 6.875% 15-Sep-2028	61.837	0,03
146.000	US Foods Inc '144A' 7.250% 15-Jan-2032	152.418	0,07
66.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	65.792	0,03
82.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	81.132	0,04
100.000	Usiminas International Sarl 'REGS' 5.875% 18-Jul-2026	97.809	0,04
30.000	Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	29.879	0,01
148.000	Valaris Ltd '144A' 8.375% 30-Apr-2030	151.758	0,07
14.000	Valley National Bancorp FRN 3.000% 15-Jun-2031	11.913	0,01
15.000	Valley National Bancorp FRN 6.250% 30-Sep-2032	12.630	0,01
100.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	85.524	0,04
110.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	100.836	0,05
75.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	75.265	0,03
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc 'REGS' 8.950% 11-Mar-2025	148.908	0,07
213.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	193.649	0,09
57.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	48.424	0,02
160.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	141.150	0,06
88.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2030	87.634	0,04
220.000	Venture Global LNG Inc '144A' 8.125% 01-Jun-2028	222.368	0,10
313.000	Venture Global LNG Inc '144A' 8.375% 01-Jun-2031	313.544	0,14
342.000	Venture Global LNG Inc '144A' 9.500% 01-Feb-2029	362.020	0,17
342.000	Venture Global LNG Inc '144A' 9.875% 01-Feb-2032	356.495	0,16
86.000	Verde Purchaser LLC '144A' 10.500% 30-Nov-2030	86.765	0,04
235.000	Vericast Corp '144A' 11.000% 15-Sep-2026	249.981	0,11
30.000	Vericast Corp '144A' 12.500% 15-Dec-2027	34.110	0,02
250.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7.500% 01-Sep-2025	205.699	0,09
50.000	Vermilion Energy Inc '144A' 6.875% 01-May-2030	48.051	0,02
95.000	Versend Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Aug-2026	95.701	0,04
120.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	112.676	0,05
75.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	73.202	0,03
10.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	9.686	0,00
35.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	28.782	0,01
70.000	Viasat Inc '144A' 7.500% 30-May-2031	55.037	0,03
80.000	Viavi Solutions Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2029	70.136	0,03
97.000	Vibrant Technologies Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2030	76.256	0,04
168.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	140.523	0,06
60.000	Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029	44.478	0,02
60.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	54.513	0,03
70.000	Videotron Ltd '144A' 5.125% 15-Apr-2027	69.009	0,03
162.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	156.472	0,07
10.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025	9.969	0,00
65.000	Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029	64.506	0,03
85.000	Viking Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jul-2031	90.644	0,04
7.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029	6.831	0,00
40.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	39.303	0,02
154.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	136.107	0,06
10.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030	8.916	0,00

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
135.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	130.568	0,06
10.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028	9.402	0,00
23.000	Virtusa Corp '144A' 7.125% 15-Dec-2028	19.760	0,01
25.000	Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	24.433	0,01
45.000	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc '144A' 9.500% 01-Jun-2028	38.140	0,02
100.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2030	69.862	0,03
45.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 7.875% 01-May-2027	38.790	0,02
175.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	163.517	0,08
110.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.000% 31-Jul-2027	107.180	0,05
120.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2026	118.763	0,05
95.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2027	93.764	0,04
200.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 7.750% 15-Oct-2031	207.813	0,10
60.000	Vital Energy Inc 9.750% 15-Oct-2030	62.310	0,03
10.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	9.470	0,00
135.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	118.041	0,05
225.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	201.258	0,09
50.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	47.992	0,02
10.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	9.212	0,00
115.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	99.383	0,05
110.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	83.292	0,04
305.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	315.229	0,14
10.000	Vornado Realty LP 2.150% 01-Jun-2026	9.021	0,00
10.000	Vornado Realty LP 3.400% 01-Jun-2031	7.753	0,00
10.000	VT Topco Inc '144A' 8.500% 15-Aug-2030	10.414	0,01
207.000	VZ Secured Financing BV '144A' 5.000% 15-Jan-2032	176.408	0,08
61.000	W&T Offshore Inc '144A' 11.750% 01-Feb-2026	62.981	0,03
20.000	Wabash National Corp '144A' 4.500% 15-Oct-2028	18.071	0,01
20.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.200% 15-Apr-2030	17.654	0,01
70.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.450% 01-Jun-2026	66.585	0,03
18.000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.800% 18-Nov-2044	14.991	0,01
10.000	Warner Media LLC 7.625% 15-Apr-2031	10.952	0,01
218.000	Warrior Met Coal Inc '144A' 7.875% 01-Dec-2028	217.158	0,10
55.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	53.252	0,02
10.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	9.636	0,00
55.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	55.059	0,03
8.000	Weatherford International Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2028	8.251	0,00
170.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	177.612	0,08
55.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 4.875% 15-Sep-2028	51.259	0,02
10.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	8.854	0,00
11.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 11.500% 15-Jun-2028	11.440	0,01
45.000	Wesco Aircraft Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2024	1.800	0,00
50.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	50.408	0,02
83.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	85.351	0,04
200.000	West China Cement Ltd 4.950% 08-Jul-2026	146.121	0,07
120.000	West Technology Group LLC '144A' 8.500% 10-Apr-2027	103.800	0,05
62.000	Western Alliance Bancorp FRN 3.000% 15-Jun-2031	54.095	0,03
25.000	Western Alliance Bank 'BKNT' FRN 5.250% 01-Jun-2030	23.812	0,01
331.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	325.078	0,15
160.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	155.082	0,07
11.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	10.963	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
180.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	177.859	0,08
67.000	Williams Scotsman Inc '144A' 7.375% 01-Oct-2031	70.336	0,03
67.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15-Aug-2028	63.271	0,03
10.000	Wilton RE Ltd '144A' FRN (Perpetual) 6.000% 22-Oct-2030	8.878	0,00
94.000	Windsor Holdings III LLC '144A' 8.500% 15-Jun-2030	98.350	0,05
199.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	174.554	0,08
60.000	Winnebago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	59.018	0,03
105.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	95.726	0,04
65.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029	51.107	0,02
11.000	World Acceptance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	10.020	0,00
80.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	77.074	0,04
95.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	84.042	0,04
140.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 7.375% 01-Mar-2031	140.266	0,06
35.000	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	23.244	0,01
50.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	46.798	0,02
105.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	102.241	0,05
30.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	29.863	0,01
90.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024	88.924	0,04
166.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	147.643	0,07
20.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	19.535	0,01
15.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027	14.174	0,01
250.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.625% 26-Aug-2028	231.902	0,11
55.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	51.978	0,02
159.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.125% 15-Feb-2031	165.630	0,08
10.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	7.779	0,00
10.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	8.744	0,00
158.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2025	154.929	0,07
239.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.500% 15-Aug-2028	216.018	0,10
50.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	46.081	0,02
5.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	4.992	0,00
50.000	XP Inc 'REGS' 3.250% 01-Jul-2026	46.922	0,02
10.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	10.239	0,00
105.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	94.812	0,04
160.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	149.847	0,07
10.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	9.736	0,00
74.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	72.803	0,03
11.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	12.082	0,01
175.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	169.821	0,08
133.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	106.781	0,05
125.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	91.934	0,04
120.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	118.708	0,05
75.000	ZF North America Capital Inc '144A' 6.875 % 14-Apr-2028	77.924	0,04
90.000	ZF North America Capital Inc '144A' 7.125 % 14-Apr-2030	96.046	0,04
67.000	Ziff Davis Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2030	61.541	0,03
81.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030	67.824	0,03
120.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	116.903	0,05
98.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	87.498	0,04
80.000	ZipRecruiter Inc '144A' 5.000% 15-Jan-2030	70.096	0,03
108.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3.875% 01-Feb-2029	98.060	0,05
Gesamtanlagen in Anleihen		208.800.464	95,46

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 166				
(31. Dezember 2022: –)				
3	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	354.047	42	0,00
2	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	267.188	124	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			166	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.968.548 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 785.200)			3.968.548	1,82
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			212.769.178	97,28
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (9)				
(31. Dezember 2022: –)				
5	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	564.453	(9)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(9)	(0,00)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (1.133.320) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (3.087.654))			(1.133.320)	(0,52)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.133.329)	(0,52)
Nettoumlaufvermögen			7.089.515	3,24
Summe Nettovermögen			218.725.364	100,00
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			94,84	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente			0,00	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			1,80	
Sonstiges Umlaufvermögen			3,36	
Gesamtvermögen			100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (B)	Betrag (S)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund						
Euro	US-Dollar	1.800.000	1.978.188	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	9.779
US-Dollar	Euro	1.403.411	1.270.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	790
US-Dollar	Pfund Sterling	127.484	100.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	12
USD						10.581
Pfund Sterling	US-Dollar	262.000	333.991	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(12)
US-Dollar	Euro	44.308.673	41.060.900	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(1.040.055)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.235.099	4.159.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(66.491)
USD						(1.106.558)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	54	64	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	US-Dollar	170	196	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Schweizer Franken	US-Dollar	10.496	11.975	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	519
USD						526
CHF						442
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	59.808	65.888	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	165
Euro	US-Dollar	820.065	896.681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9.020
Euro	US-Dollar	229.378	247.983	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.348
Euro	US-Dollar	497	535	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	154	166	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	49.527.050	53.282.984	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.415.981
USD						1.430.531
EUR						1.295.829
US-Dollar	Euro	65.863	59.808	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(161)
Euro	US-Dollar	281.456	310.887	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
US-Dollar	Euro	12.827	11.723	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(121)
US-Dollar	Euro	6.824	6.244	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(71)
US-Dollar	Euro	27.844	25.530	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(352)
US-Dollar	Euro	24.058	21.862	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(87)
US-Dollar	Euro	47.467	43.572	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(655)
USD						(1.487)
EUR						(1.347)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	162	177	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	9.839	10.585	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	281
USD						283
EUR						256
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	147	161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	8.953	9.632	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	256
USD						258
EUR						234
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	7.600	8.307	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	87
Euro	US-Dollar	410	448	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	24.885	26.772	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	711
Euro	US-Dollar	177	196	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						802
EUR						726
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	60	67	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	176	192	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.680	11.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	305
USD						307
EUR						278
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	US-Dollar	574	56	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Norwegische Krone	US-Dollar	1.637	156	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Norwegische Krone	US-Dollar	101.453	9.251	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	737
USD						742
NOK						7.539
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)						
Schwedische Krone	US-Dollar	1.622	158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schwedische Krone	US-Dollar	99.877	9.523	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	384
USD						387
SEK						3.903
Schwedische Krone	US-Dollar	561	56	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
SEK						(10)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	31.370	39.851	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	135
Pfund Sterling	US-Dollar	77.66	9.887	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Pfund Sterling	US-Dollar	74.707	93.777	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.455
Pfund Sterling	US-Dollar	90.850.514	114.076.664	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.732.944
Pfund Sterling	US-Dollar	59.538	74.785	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.110
Pfund Sterling	US-Dollar	56.061	70.483	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	978

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	78.824	99.564	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	914
Pfund Sterling	US-Dollar	1.514.666	1.926.193	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.592
Pfund Sterling	US-Dollar	88.954	112.516	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	876
Pfund Sterling	US-Dollar	194.250	247.179	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	437
Pfund Sterling	US-Dollar	70.284	88.757	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	837
Pfund Sterling	US-Dollar	442.723	560.927	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.424
Pfund Sterling	US-Dollar	80.926	102.681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	477
Pfund Sterling	US-Dollar	90.014	114.365	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	379
Pfund Sterling	US-Dollar	49.781	63.243	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	214
Pfund Sterling	US-Dollar	47.666	60.418	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	344
Pfund Sterling	US-Dollar	32.989	42.002	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	50
US-Dollar	Pfund Sterling	34.858	27.288	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	74
USD						1.749.252
GBP						1.372.339
US-Dollar	Pfund Sterling	63.239	49.781	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(214)
US-Dollar	Pfund Sterling	41.999	32.989	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(50)
Pfund Sterling	US-Dollar	83.371	106.501	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(226)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.888	7.766	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Pfund Sterling	39.854	31.370	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(135)
US-Dollar	Pfund Sterling	19.530	15.372	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(65)
US-Dollar	Pfund Sterling	25.603	20.179	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(119)
US-Dollar	Pfund Sterling	74.132	58.703	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(699)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.612.085	8.339.694	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18.748)
US-Dollar	Pfund Sterling	27.581	21.805	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(215)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.632	16.277	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(117)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.770	21.985	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(255)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.750	18.890	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(330)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.438	13.883	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(259)
US-Dollar	Pfund Sterling	66.554	53.020	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.032)
USD						(22.476)
GBP						(17.633)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) (M)						
Pfund Sterling	US-Dollar	61	78	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	174	222	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	10.464	13.140	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	200
USD						201
GBP						158
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	459	583	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Pfund Sterling	US-Dollar	342	436	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	254	200	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	403	506	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	200	254	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	251.800	319.894	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.083
Pfund Sterling	US-Dollar	12.794	16.255	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	54
Pfund Sterling	US-Dollar	105.264	134.034	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	149
Pfund Sterling	US-Dollar	265	335	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	2.742	3.479	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16
Pfund Sterling	US-Dollar	17.983.391	22.580.888	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	343.027
Pfund Sterling	US-Dollar	17.913	22.658	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	176
Pfund Sterling	US-Dollar	1.407	1.783	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Pfund Sterling	US-Dollar	299.461	380.823	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	908
Pfund Sterling	US-Dollar	555	701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Pfund Sterling	US-Dollar	1.947	2.448	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	34
Pfund Sterling	US-Dollar	1.508	1.919	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	16.830	21.127	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	328
US-Dollar	Pfund Sterling	2.724	2.132	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Pfund Sterling	26	20	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						345.812
GBP						271.300
US-Dollar	Pfund Sterling	319.874	251.800	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.083)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.378	10.703	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Pfund Sterling	436	342	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	583	459	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.448	1.141	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.319	1.836	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.112	874	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.297	3.397	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Pfund Sterling	359	283	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.134	8.023	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(93)
US-Dollar	Pfund Sterling	538	428	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Pfund Sterling	874	696	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.752	5.379	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(105)
USD						(1.393)
GBP						(1.093)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	2.754	3.499	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Pfund Sterling	US-Dollar	1.949	2.481	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	13.323	16.829	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	155
Pfund Sterling	US-Dollar	351.846	447.440	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.067
Pfund Sterling	US-Dollar	11.378	14.421	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	82
Pfund Sterling	US-Dollar	26.375	33.362	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	260
Pfund Sterling	US-Dollar	10.055	12.795	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23
Pfund Sterling	US-Dollar	39.263	49.582	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	467
Pfund Sterling	US-Dollar	123.296	156.995	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	174

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	11.561	14.689	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
Pfund Sterling	US-Dollar	6.287	7.988	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27
Pfund Sterling	US-Dollar	10.896	13.677	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	212
Pfund Sterling	US-Dollar	21.138.873	26.543.076	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	403.217
Pfund Sterling	US-Dollar	18.894	23.732	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	352
Pfund Sterling	US-Dollar	19.217	24.161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	335
Pfund Sterling	US-Dollar	14.284	18.124	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	84
Pfund Sterling	US-Dollar	6.686	8.513	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
US-Dollar	Pfund Sterling	33.801	26.460	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	72
USD						406.601
GBP						318.990
US-Dollar	Pfund Sterling	7.987	6.287	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(27)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.512	6.686	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
Pfund Sterling	US-Dollar	15.199	19.416	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(41)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.481	1.949	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.499	2.754	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.686	6.837	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.375	18.423	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(109)
US-Dollar	Pfund Sterling	19.016	15.058	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(179)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.544	10.644	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.036	13.469	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(133)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.633	9.967	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(72)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.335	7.391	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(86)
US-Dollar	Pfund Sterling	15.293	12.163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(212)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.225	9.732	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(181)
US-Dollar	Pfund Sterling	14.640	11.663	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(227)
USD						(1.345)
GBP						(1.055)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	77	98	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	16	21	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	172	216	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	321	408	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	1.161.212	1.458.079	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22.150
Pfund Sterling	US-Dollar	1.854	2.352	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Pfund Sterling	US-Dollar	483	609	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Pfund Sterling	US-Dollar	6.754	8.600	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Pfund Sterling	US-Dollar	569	721	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	19.285	24.525	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
Pfund Sterling	US-Dollar	669	846	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Pfund Sterling	US-Dollar	510	641	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
Pfund Sterling	US-Dollar	2.032	2.585	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Pfund Sterling	10	8	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	2	2	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	183	143	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	45	35	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	5	4	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	98	77	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	21	16	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						22.265
GBP						17.468
Pfund Sterling	US-Dollar	318	406	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	212	168	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.177	4.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.459	2.751	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
USD						(60)
GBP						(47)

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Kanadischer Dollar - 2.330.035			
(31. Dezember 2022: 1.587.800)		2.330.035	3,14
5.000	55 Ontario School Board Trust/The 5.900% 02-Jun-2033	4.293	0,01
5.000	Aeroports de Montreal 5.170% 17-Sep-2035	4.012	0,01
13.339	Aeroports de Montreal 6.950% 16-Apr-2032	11.031	0,01
10.000	Air Lease Corp 2.625% 05-Dec-2024	7.346	0,01
30.000	Alectra Inc 5.297% 29-Apr-2041	24.891	0,03
10.000	Algonquin Power Co 4.090% 17-Feb-2027	7.373	0,01
20.000	Allied Properties Real Estate Investment Trust 3.095% 06-Feb-2032	11.832	0,02
10.000	AltaGas Ltd 'MTN' 2.075% 30-May-2028	6.805	0,01
20.000	AltaLink LP 'MTN' 3.717% 03-Dec-2046	13.563	0,02
10.000	AltaLink LP 'MTN' 3.990% 30-Jun-2042	7.080	0,01
10.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 4.320% 15-May-2047	7.179	0,01
150.000	AT&T Inc 4.000% 25-Nov-2025	111.502	0,15
5.000	Athene Global Funding 2.470% 09-Jun-2028	3.362	0,00
70.000	Bank of America Corp FRN 3.615% 16-Mar-2028	51.152	0,07
30.000	Bank of Montreal 3.190% 01-Mar-2028	21.853	0,03
30.000	Bank of Montreal 4.309% 01-Jun-2027	22.527	0,03
15.000	Bank of Montreal 4.709% 07-Dec-2027	11.419	0,02
20.000	Bank of Montreal 5.039% 29-May-2028	15.437	0,02
50.000	Bank of Montreal FRN 2.077% 17-Jun-2030	36.119	0,05
20.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.370% 03-Feb-2025	14.657	0,02
5.000	Bank of Nova Scotia/The 2.160% 03-Feb-2025	3.656	0,00
40.000	Bank of Nova Scotia/The 2.950% 08-Mar-2027	28.837	0,04
15.000	Bank of Nova Scotia/The 3.100% 02-Feb-2028	10.895	0,01
10.000	Bank of Nova Scotia/The 8.900% 20-Jun-2025	7.924	0,01
20.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.934% 03-May-2032	14.584	0,02
10.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 5.679% 02-Aug-2033	7.753	0,01
10.000	bclMC Realty Corp 'MTN' 2.840% 03-Jun-2025	7.354	0,01
20.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 3.500% 30-Sep-2050	11.738	0,02
5.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 4.550% 09-Feb-2030	3.800	0,01
20.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 5.850% 10-Nov-2032	16.406	0,02
60.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 'MTN' 3.350% 12-Mar-2025	44.403	0,06
15.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 'MTN' 3.800% 21-Aug-2028	11.109	0,01
5.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 'MTN' 6.170% 26-Feb-2037	4.195	0,01
10.000	British Columbia Ferry Services Inc 5.021% 20-Mar-2037	8.002	0,01
10.000	Brookfield Corp 5.950% 14-Jun-2035	7.994	0,01
10.000	Brookfield Corp 'MTN' 4.820% 28-Jan-2026	7.560	0,01
20.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 5.789% 25-Apr-2052	16.064	0,02
10.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN' 2.855% 01-Sep-2032	6.444	0,01
15.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN' 3.410% 09-Oct-2029	10.549	0,01
10.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 3.630% 15-Jan-2027	7.346	0,01
5.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 4.290% 05-Nov-2049	3.355	0,00
10.000	Bruce Power LP 3.969% 23-Jun-2026	7.469	0,01
20.000	Bruce Power LP 4.000% 21-Jun-2030	14.684	0,02
2.000	Cameco Corp 2.950% 21-Oct-2027	1.424	0,00
10.000	Canadian Core Real Estate LP 3.299% 02-Mar-2027	7.081	0,01
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 1.100% 19-Jan-2026	7.054	0,01
40.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.000% 17-Apr-2025	29.093	0,04
50.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.250% 07-Jan-2027	35.469	0,05
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.750% 07-Mar-2025	7.355	0,01
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 2.010% 21-Jul-2030	14.379	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.			
40.000	Canadian National Railway Co 3.050% 08-Feb-2050	23.518	0,03
20.000	Canadian Pacific Railway Co 2.540% 28-Feb-2028	14.150	0,02
20.000	Canadian Pacific Railway Co 3.050% 09-Mar-2050	11.637	0,02
10.000	Canadian Tire Corp Ltd 'MTN' 6.500% 13-Apr-2028	8.076	0,01
10.000	Canadian Western Bank 1.818% 16-Dec-2027	6.801	0,01
10.000	Cenovus Energy Inc 3.500% 07-Feb-2028	7.273	0,01
2.000	CGI Inc 2.100% 18-Sep-2028	1.371	0,00
30.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 2.981% 04-Mar-2030	20.501	0,03
5.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.178% 08-Mar-2028	3.704	0,00
10.000	CT Real Estate Investment Trust 2.371% 06-Jan-2031	6.284	0,01
5.000	CU Inc 2.963% 07-Sep-2049	2.923	0,00
5.000	CU Inc 3.964% 27-Jul-2045	3.499	0,00
5.000	CU Inc 4.543% 24-Oct-2041	3.789	0,01
10.000	CU Inc 4.722% 09-Sep-2043	7.759	0,01
5.000	CU Inc 'MTN' 3.857% 14-Nov-2052	3.427	0,00
50.000	Daimler Truck Finance Canada Inc 5.220% 20-Sep-2027	38.443	0,05
15.000	Enbridge Gas Inc 4.150% 17-Aug-2032	11.195	0,02
5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.200% 02-Jun-2044	3.571	0,00
20.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.500% 23-Nov-2043	14.860	0,02
10.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.880% 21-Jun-2041	7.773	0,01
50.000	Enbridge Inc 6.100% 09-Nov-2032	41.086	0,06
10.000	Enbridge Inc 'MTN' 3.200% 08-Jun-2027	7.253	0,01
20.000	Enbridge Inc 'MTN' 4.240% 27-Aug-2042	13.199	0,02
10.000	Enbridge Inc 'MTN' 4.870% 21-Nov-2044	7.162	0,01
20.000	Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 3.520% 22-Feb-2029	14.481	0,02
10.000	Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 4.330% 22-Feb-2049	6.636	0,01
10.000	Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 5.350% 10-Nov-2039	7.644	0,01
5.000	Energir Inc 3.530% 16-May-2047	3.258	0,00
50.000	Equitable Bank 1.939% 10-Mar-2025	36.158	0,05
10.000	Fairfax Financial Holdings Ltd 4.250% 06-Dec-2027	7.450	0,01
10.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 4.407% 19-May-2027	7.529	0,01
50.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5.200% 01-Oct-2025	38.010	0,05
5.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec FRN 5.035% 23-Aug-2032	3.774	0,01
5.000	Finnish International Inc 4.445% 16-May-2028	3.761	0,01
5.000	First Capital Real Estate Investment Trust 3.456% 22-Jan-2027	3.559	0,00
20.000	FortisAlberta Inc 'MTN' 4.270% 22-Sep-2045	14.544	0,02
15.000	FortisBC Energy Inc 'MTN' 2.420% 18-Jul-2031	10.051	0,01
20.000	FortisBC Energy Inc 'MTN' 5.900% 26-Feb-2035	16.818	0,02
10.000	G Granite REIT Holdings LP 2.378% 18-Dec-2030	6.417	0,01
5.000	Greater Toronto Airports Authority 'MTN' 5.300% 25-Feb-2041	4.201	0,01
30.000	Greater Toronto Airports Authority 'MTN' 7.050% 12-Jun-2030	26.109	0,04
5.000	Great-West Lifeco Inc 3.337% 28-Feb-2028	3.649	0,00
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.670% 21-Mar-2033	4.313	0,01
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.740% 24-Nov-2031	4.293	0,01
10.000	Honda Canada Finance Inc 1.711% 28-Sep-2026	7.047	0,01
10.000	Honda Canada Finance Inc 3.444% 23-May-2025	7.418	0,01
4.297	Hospital Infrastructure Partners NOH Partnership 5.439% 31-Jan-2045	3.362	0,00
10.000	Hydro One Inc 2.230% 17-Sep-2031	6.646	0,01
5.000	Hydro One Inc 7.350% 03-Jun-2030	4.412	0,01
10.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.630% 25-Jun-2049	6.626	0,01
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.720% 18-Nov-2047	3.365	0,00
10.000	Hydro One Inc 'MTN' 4.460% 27-Jan-2053	7.594	0,01
10.000	Hydro One Inc 'MTN' 4.910% 27-Jan-2028	7.800	0,01
20.000	Hydro One Inc 'MTN' 5.360% 20-May-2036	16.399	0,02
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 6.590% 22-Apr-2043	4.790	0,01
50.000	Hyundai Capital Canada Inc 2.008% 12-May-2026	35.547	0,05
10.000	IGM Financial Inc 3.440% 26-Jan-2027	7.275	0,01
5.000	IGM Financial Inc 4.206% 21-Mar-2050	3.431	0,00
20.000	Intact Financial Corp 3.765% 20-May-2053	13.311	0,02
20.000	Intact Financial Corp 'MTN' 3.770% 02-Mar-2026	14.882	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.			
20.000	Inter Pipeline Ltd 5.760% 17-Feb-2028	15.583	0,02
10.000	John Deere Financial Inc 2.410% 14-Jan-2025	7.353	0,01
20.000	John Deere Financial Inc 5.170% 15-Sep-2028	15.792	0,02
5.000	Loblaw Cos Ltd 4.488% 11-Dec-2028	3.818	0,01
10.000	Loblaw Cos Ltd 5.008% 13-Sep-2032	7.830	0,01
25.000	Macquarie Group Ltd FRN 2.723% 21-Aug-2029	16.948	0,02
10.000	Manulife Financial Corp FRN 2.237% 12-May-2030	7.257	0,01
15.000	Manulife Financial Corp FRN 2.818% 13-May-2035	10.073	0,01
10.000	Manulife Financial Corp FRN 5.409% 10-Mar-2033	7.707	0,01
5.000	Metro Inc/CN 'MTN' 3.390% 06-Dec-2027	3.673	0,00
10.000	Metro Inc/CN 'MTN' 5.030% 01-Dec-2044	7.755	0,01
10.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.950% 20-Mar-2028	6.872	0,01
10.000	Molson Coors International LP 3.440% 15-Jul-2026	7.356	0,01
30.000	National Bank of Canada 5.219% 14-Jun-2028	23.317	0,03
20.000	National Bank of Canada FRN 5.426% 16-Aug-2032	15.265	0,02
5.000	NAV Canada 7.400% 01-Jun-2027	4.156	0,01
15.000	NAV Canada 'MTN' 3.534% 23-Feb-2046	10.118	0,01
20.000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 3.200% 24-Apr-2026	14.706	0,02
25.000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 4.350% 10-Jan-2039	18.115	0,02
7.000	Nova Scotia Power Inc 3.571% 05-Apr-2049	4.234	0,01
15.000	Nova Scotia Power Inc 'MTN' 5.610% 15-Jun-2040	12.046	0,02
10.000	OMERS Realty Corp 3.331% 05-Jun-2025	7.406	0,01
5.000	Pembina Pipeline Corp 4.020% 27-Mar-2028	3.692	0,00
20.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.240% 15-Jun-2027	14.964	0,02
10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.540% 03-Apr-2049	6.639	0,01
10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.740% 21-Jan-2047	6.859	0,01
50.000	Penske Truck Leasing Canada Inc 5.440% 08-Dec-2025	38.085	0,05
7.762	Plenary Health Care Partnerships Humber LP 4.895% 31-May-2039	5.852	0,01
8.422	Plenary Properties LTAP LP 6.288% 31-Jan-2044	7.126	0,01
10.000	Prologis LP 5.250% 15-Jan-2031	7.837	0,01
20.000	RioCan Real Estate Investment Trust 2.361% 10-Mar-2027	13.880	0,02
8.000	Rogers Communications Inc 2.900% 09-Dec-2030	5.410	0,01
10.000	Rogers Communications Inc 3.100% 15-Apr-2025	7.373	0,01
15.000	Rogers Communications Inc 3.650% 31-Mar-2027	11.034	0,01
15.000	Rogers Communications Inc 5.250% 15-Apr-2052	11.259	0,02
10.000	Rogers Communications Inc 6.110% 25-Aug-2040	8.133	0,01
20.000	Rogers Communications Inc 6.750% 09-Nov-2039	17.222	0,02
30.000	Royal Bank of Canada 1.589% 04-May-2026	21.296	0,03
40.000	Royal Bank of Canada 2.328% 28-Jan-2027	28.453	0,04
15.000	Royal Bank of Canada 3.369% 29-Sep-2025	11.073	0,01
15.000	Royal Bank of Canada 5.228% 24-Jun-2030	11.809	0,02
50.000	Royal Bank of Canada FRN 2.140% 03-Nov-2031	35.010	0,05
10.000	Royal Bank of Canada FRN 2.880% 23-Dec-2029	7.358	0,01
10.000	Royal Bank of Canada FRN 2.880% 23-Dec-2029	7.358	0,01
20.000	Sagen MI Canada Inc 3.261% 05-Mar-2031	12.744	0,02
10.000	Saputo Inc 2.297% 22-Jun-2028	6.906	0,01
10.000	Saputo Inc 5.250% 29-Nov-2029	7.817	0,01
5.000	Sun Life Assurance Co of Canada 6.300% 15-May-2028	3.991	0,01
10.000	Sun Life Financial Inc FRN 3.150% 18-Nov-2036	6.687	0,01
5.000	Sun Life Financial Inc 'MTN' FRN 5.400% 29-May-2042	3.885	0,01
15.000	Suncor Energy Inc 'MTN' 3.950% 04-Mar-2051	9.460	0,01
10.000	Sysco Canada Inc 3.650% 25-Apr-2025	7.420	0,01
10.000	TELUS Corp 2.750% 08-Jul-2026	7.266	0,01
50.000	TELUS Corp 3.300% 02-May-2029	35.795	0,05
10.000	TELUS Corp 5.250% 15-Nov-2032	7.804	0,01
20.000	TELUS Corp 5.650% 13-Sep-2052	16.098	0,02
2.000	Teranet Holdings LP 5.754% 17-Dec-2040	1.492	0,00
10.000	Teranet Holdings LP 6.100% 17-Jun-2041	7.742	0,01
10.000	Thomson Reuters Corp 2.239% 14-May-2025	7.296	0,01
10.000	Toromont Industries Ltd 3.710% 30-Sep-2025	7.405	0,01
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.896% 11-Sep-2028	13.625	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.			
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.943% 13-Mar-2025	3.648	0,00
30.000	Toronto-Dominion Bank/The 2.667% 09-Sep-2025	21.901	0,03
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 4.210% 01-Jun-2027	7.494	0,01
50.000	Toronto-Dominion Bank/The 5.376% 21-Oct-2027	38.929	0,05
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 9.150% 26-May-2025	7.939	0,01
50.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.060% 26-Jan-2032	35.818	0,05
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.105% 22-Apr-2030	3.670	0,00
30.000	Toyota Credit Canada Inc 'MTN' 2.730% 25-Aug-2025	22.005	0,03
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 3.800% 05-Apr-2027	7.400	0,01
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 5.330% 12-May-2032	15.620	0,02
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 3.300% 17-Jul-2025	7.382	0,01
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 4.340% 15-Oct-2049	13.066	0,02
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 4.550% 15-Nov-2041	13.711	0,02
20.000	University of Toronto 5.841% 15-Dec-2043	17.596	0,02
10.000	Verizon Communications Inc 4.050% 22-Mar-2051	6.501	0,01
10.000	Wells Fargo & Co 2.975% 19-May-2026	7.264	0,01
30.000	Wells Fargo & Co FRN 4.168% 28-Apr-2026 VAR	22.333	0,03
Euro - 17.522.679			
(31. Dezember 2022: 11.323.775)			
100.000	Abertis Infraestructuras SA 'EMTN' 1.250% 07-Feb-2028	101.960	0,14
100.000	ABN AMRO Bank NV 0.600% 15-Jan-2027	101.969	0,14
100.000	Akelius Residential Property AB 'EMTN' 1.750% 07-Feb-2025	107.153	0,14
100.000	Allianz SE FRN 3.099% 06-Jul-2047	108.292	0,15
100.000	Altria Group Inc 3.125% 15-Jun-2031	100.349	0,14
100.000	American Tower Corp 0.400% 15-Feb-2027	100.718	0,14
20.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2030	20.367	0,03
75.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.750% 17-Mar-2036	79.281	0,11
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.875% 02-Apr-2032	109.654	0,15
100.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	111.943	0,15
100.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025	110.364	0,15
100.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 'EMTN' 0.625% 25-Aug-2030	93.320	0,13
100.000	Autoroutes du Sud de la France SA 'EMTN' 2.750% 02-Sep-2032	107.302	0,14
100.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.625% 25-Jan-2028	101.658	0,14
100.000	AXA SA 'EMTN' FRN 5.500% 11-Jul-2043	118.622	0,16
100.000	Babcock International Group Plc 'EMTN' 1.375% 13-Sep-2027	101.846	0,14
100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 3.500% 10-Feb-2027	110.745	0,15
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	97.876	0,13
100.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.102% 24-May-2032	92.115	0,12
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.625% 21-Feb-2031	90.609	0,12
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.250% 14-Jan-2025	107.688	0,15
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 18-Jun-2029	100.916	0,14
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.125% 14-Sep-2027	110.121	0,15
20.000	BASF SE 1.625% 15-Nov-2037	18.367	0,02
10.000	BASF SE 'EMTN' 0.875% 06-Oct-2031	9.558	0,01
100.000	BASF SE 'EMTN' 3.125% 29-Jun-2028	111.955	0,15
100.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030	98.384	0,13
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026	105.455	0,14

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 2.000% 18-Mar-2034	98.335	0,13
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.250% 26-Apr-2027	97.036	0,13
100.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.000% 22-May-2028	102.500	0,14
10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.500% 06-Feb-2029	10.345	0,01
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 0.625% 03-Dec-2032	86.261	0,12
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.500% 31-Mar-2032	104.716	0,14
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 3.875% 23-Feb-2029	112.879	0,15
100.000	Booking Holdings Inc 1.800% 03-Mar-2027	106.381	0,14
100.000	Bouygues SA 4.625% 07-Jun-2032	121.541	0,16
100.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN' 2.519% 07-Apr-2028	108.489	0,15
100.000	BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	103.827	0,14
100.000	BPCE SA 'EMTN' 4.500% 13-Jan-2033	116.086	0,16
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' 4.375% 29-Nov-2033	115.956	0,16
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 6.125% 30-May-2034	116.959	0,16
100.000	CaixaBank SA 'GMTN' FRN 1.625% 13-Apr-2026	107.499	0,15
100.000	Capgemini SE 1.625% 15-Apr-2026	106.980	0,14
100.000	Carrefour SA 'EMTN' 4.375% 14-Nov-2031	117.187	0,16
100.000	Celanese US Holdings LLC 4.777% 19-Jul-2026	112.407	0,15
100.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0.500% 08-Oct-2027	102.098	0,14
20.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 4.250% 25-Feb-2030	22.085	0,03
100.000	Coca-Cola Co/The 1.250% 08-Mar-2031	99.059	0,13
100.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.750% 27-Mar-2026	107.432	0,15
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.000% 04-Mar-2026	15.833	0,02
10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.500% 28-Aug-2028	10.555	0,01
100.000	Compass Group Finance Netherlands BV 'EMTN' 3.000% 08-Mar-2030	110.298	0,15
10.000	Cooperative Rabobank UA 'GMTN' 1.375% 03-Feb-2027	10.509	0,01
100.000	Credit Agricole Assurances SA 2.000% 17-Jul-2030	97.062	0,13
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029	102.400	0,14
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 2.500% 29-Aug-2029	106.535	0,14
100.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.750% 05-Mar-2029	102.111	0,14
100.000	Danske Bank A/S FRN 4.000% 12-Jan-2027	111.314	0,15
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' 1.625% 20-Jan-2027	103.832	0,14
20.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	21.417	0,03
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 03-Sep-2026	105.806	0,14
20.000	Deutsche Boerse AG 1.125% 26-Mar-2028	20.814	0,03
15.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034	14.369	0,02
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 2.250% 29-Mar-2039	10.345	0,01
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.500% 03-Apr-2028	5.246	0,01
100.000	DH Europe Finance II Sarl 0.200% 18-Mar-2026	103.695	0,14
100.000	Dow Chemical Co/The 1.125% 15-Mar-2032	92.175	0,12
100.000	DS Smith Plc 'EMTN' 4.375% 27-Jul-2027	113.495	0,15
100.000	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 'EMTN' 0.400% 17-Nov-2028	94.034	0,13
20.000	E.ON International Finance BV 1.000% 13-Apr-2025	21.422	0,03
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	10.390	0,01
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.500% 31-Jul-2029	10.280	0,01
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033	6.596	0,01
20.000	E.ON SE 'EMTN' 2.875% 26-Aug-2028	22.018	0,03
20.000	E.ON SE 'EMTN' 3.875% 12-Jan-2035	22.993	0,03
100.000	East Japan Railway Co 'EMTN' 1.850% 13-Apr-2033	99.101	0,13
100.000	EDP Servicios Financieros Espana SA 'EMTN' 4.125% 04-Apr-2029	114.995	0,16
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.000% 17-Jun-2027	99.580	0,13
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.875% 28-Sep-2034	83.297	0,11
100.000	Engie SA 'EMTN' 4.250% 06-Sep-2034	117.277	0,16

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Engie SA 'EMTN' 4.250% 11-Jan-2043	115.967	0,16
5.000	Engie SA 'EMTN' 5.950% 16-Mar-2111	7.059	0,01
100.000	Eni SpA 'EMTN' 2.000% 18-May-2031	101.553	0,14
100.000	Euroclear Bank SA 'EMTN' 3.625% 13-Oct-2027	112.810	0,15
20.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 2.875% 24-May-2030	21.142	0,03
100.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 4.250% 28-May-2026	112.977	0,15
10.000	GE Capital European Funding Unlimited Co 'EMTN' 6.025% 01-Mar-2038	13.851	0,02
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	16.530	0,02
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	17.695	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.875% 21-Jan-2030	9.519	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.625% 27-Jul-2026	10.620	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028	10.546	0,01
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.875% 03-Jun-2026	16.434	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.000% 12-Feb-2031	10.881	0,01
100.000	Hannover Rueck SE FRN 5.875% 26-Aug-2043	123.418	0,17
60.000	HBOS Plc 'EMTN' FRN 4.500% 18-Mar-2030	66.142	0,09
50.000	Heidelberg Materials AG 3.750% 31-May-2032	55.858	0,08
20.000	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2026	21.475	0,03
15.000	HOCHTIEF AG 'EMTN' 1.750% 03-Jul-2025	16.140	0,02
100.000	Holcim Finance Luxembourg SA 'EMTN' 0.500% 03-Sep-2030	91.937	0,12
100.000	Honeywell International Inc 0.750% 10-Mar-2032	91.489	0,12
100.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.019% 15-Jun-2027	109.115	0,15
100.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	118.944	0,16
100.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Aug-2027	98.527	0,13
100.000	Iberdrola International BV 'EMTN' 1.125% 21-Apr-2026	106.480	0,14
100.000	Imperial Brands Finance Netherlands BV 'EMTN' 5.250% 15-Feb-2031	114.402	0,15
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 23-May-2026	108.075	0,15
100.000	ING Groep NV FRN 4.125% 24-Aug-2033	110.976	0,15
100.000	ING Groep NV FRN 4.500% 23-May-2029	113.902	0,15
100.000	International Business Machines Corp 1.200% 11-Feb-2040	80.449	0,11
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 4.875% 19-May-2030	116.361	0,16
100.000	ISS Global A/S 'EMTN' 1.500% 31-Aug-2027	103.195	0,14
100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.638% 18-May-2028	104.357	0,14
100.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0.750% 21-Jan-2028	101.697	0,14
100.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.875% 17-Feb-2031	91.745	0,12
100.000	Linde Plc 1.625% 31-Mar-2035	95.143	0,13
100.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN 3.500% 01-Apr-2026	110.130	0,15
100.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN' 3.500% 07-Sep-2033	114.251	0,15
100.000	Mapfre SA 2.875% 13-Apr-2030	101.113	0,14
100.000	McDonald's Corp 'GMTN' 2.375% 31-May-2029	107.149	0,14
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.000% 15-Oct-2025	104.417	0,14
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 15-Oct-2028	98.280	0,13
25.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2033	22.830	0,03
10.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 2.125% 03-Jul-2037	10.019	0,01
15.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 2.375% 22-May-2030	16.017	0,02
100.000	Metso Oyj 'EMTN' 0.875% 26-May-2028	99.083	0,13
100.000	Mizuho Financial Group Inc 'EMTN' 0.693% 07-Oct-2030	92.159	0,12
100.000	Mondelez International Inc 0.250% 17-Mar-2028	98.829	0,13
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' 1.750% 30-Jan-2025	108.139	0,15
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' 1.875% 27-Apr-2027	105.389	0,14

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049	107.263	0,14
100.000	Nasdaq Inc 4.500% 15-Feb-2032	118.451	0,16
15.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 1.250% 18-May-2026	15.981	0,02
100.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 0.250% 14-Sep-2028	96.432	0,13
100.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 0.780% 26-Feb-2030	95.267	0,13
10.000	Nestle Finance International Ltd 0.375% 03-Dec-2040	7.380	0,01
40.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 0.000% 03-Mar-2033	34.263	0,05
35.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030	36.000	0,05
10.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.750% 02-Nov-2037	9.579	0,01
100.000	Netflix Inc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2029	114.377	0,15
100.000	Nokia Oyj 'EMTN' 2.000% 11-Mar-2026	106.570	0,14
100.000	Nordea Bank Abp 'EMTN' 4.125% 05-May-2028	114.109	0,15
50.000	OMV AG FRN (Perpetual) 6.250% 09-Dec-2025	57.293	0,08
100.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.500% 12-Aug-2025	105.472	0,14
70.000	Orange SA 'EMTN' 8.125% 28-Jan-2033	108.689	0,15
100.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.375% 18-Jan-2030	115.811	0,16
100.000	PepsiCo Inc 0.875% 18-Jul-2028	101.698	0,14
100.000	Philip Morris International Inc 0.800% 01-Aug-2031	90.305	0,12
200.000	Praemia Healthcare SACA 0.875% 04-Nov-2029	183.089	0,25
100.000	Procter & Gamble Co/The 1.250% 25-Oct-2029	102.094	0,14
100.000	Prosus NV 'REGS' 1.207% 19-Jan-2026	104.069	0,14
5.000	PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033	6.558	0,01
30.000	RCI Banque SA 'EMTN' 1.125% 15-Jan-2027	31.040	0,04
100.000	RELX Finance BV 0.500% 10-Mar-2028	100.295	0,14
100.000	Repsol International Finance BV FRN 4.500% 25-Mar-2075	110.322	0,15
100.000	Robert Bosch GmbH 'EMTN' 4.375% 02-Jun-2043	118.633	0,16
10.000	RWE AG 0.625% 11-Jun-2031	9.277	0,01
20.000	RWE AG 2.500% 24-Aug-2025	21.793	0,03
20.000	RWE AG 'EMTN' 0.500% 26-Nov-2028	19.724	0,03
100.000	Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	109.426	0,15
100.000	Sandvik AB 'EMTN' 3.750% 27-Sep-2029	114.286	0,15
100.000	Sanofi SA 1.375% 21-Mar-2030	102.062	0,14
100.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'EMTN' 1.750% 11-Apr-2028	100.767	0,14
100.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 1.875% 07-Apr-2032	101.482	0,14
100.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 3.375% 24-Aug-2031	114.130	0,15
100.000	SKF AB 0.250% 15-Feb-2031	87.956	0,12
100.000	Sky Ltd 'GMTN' 2.250% 17-Nov-2025	108.606	0,15
100.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.500% 15-Sep-2027	103.829	0,14
100.000	Snam SpA 'EMTN' 0.000% 15-Aug-2025	104.785	0,14
100.000	Snam SpA 'EMTN' 0.875% 25-Oct-2026	104.139	0,14
100.000	Societe Generale SA 4.125% 02-Jun-2027	113.320	0,15
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' 2.625% 27-Feb-2025	108.884	0,15
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 4.250% 06-Dec-2030	112.367	0,15
100.000	SSE Plc 'EMTN' 0.875% 06-Sep-2025	106.105	0,14
100.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	116.768	0,16
100.000	Stryker Corp 0.750% 01-Mar-2029	98.318	0,13
100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 'EMTN' 0.303% 28-Oct-2027	99.298	0,13
100.000	Svenska Handelsbanken AB 2.625% 05-Sep-2029	107.959	0,15
100.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 0.750% 09-Jul-2027	102.351	0,14
60.000	Telefonica Europe BV 'EMTN' 5.875% 14-Feb-2033	79.870	0,11
100.000	Teleperformance SE 'EMTN' 5.250% 22-Nov-2028	115.571	0,16
50.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.875% 01-Oct-2025	55.869	0,08
100.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.800% 18-Oct-2030	95.972	0,13
100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.125% 01-Mar-2025	106.201	0,14

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 2.551% 03-Aug-2027	108.124	0,15
100.000	TotalEnergies Capital International SA 'EMTN' 1.535% 31-May-2039	88.093	0,12
100.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.369% 06-Oct-2026	107.742	0,15
100.000	Toyota Finance Australia Ltd 'EMTN' 0.064% 13-Jan-2025	106.556	0,14
100.000	Traton Finance Luxembourg SA 'EMTN' 4.250% 16-May-2028	113.629	0,15
100.000	UBS Group AG FRN 2.125% 13-Oct-2026	107.323	0,14
100.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	103.328	0,14
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	93.591	0,13
100.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.925% 18-Jan-2028	102.610	0,14
100.000	Upjohn Finance BV 1.362% 23-Jun-2027	102.580	0,14
100.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 0.800% 15-Jan-2032	92.409	0,12
5.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 6.125% 25-Nov-2033	6.892	0,01
100.000	Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026	105.728	0,14
100.000	Verizon Communications Inc 1.850% 18-May-2040	87.087	0,12
100.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	98.376	0,13
100.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 1.600% 29-Jul-2031	99.245	0,13
100.000	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 4.625% 03-May-2031	115.974	0,16
160.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0.875% 31-Jan-2028	160.001	0,22
20.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 1.625% 16-Jan-2030	19.993	0,03
20.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.375% 20-Jul-2026	20.493	0,03
10.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.625% 19-Jul-2029	9.500	0,01
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029	91.223	0,12
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 1.375% 26-Oct-2026	104.326	0,14
100.000	Wolters Kluwer NV 0.750% 03-Jul-2030	96.046	0,13
Pfund Sterling - 3.687.627			
(31. Dezember 2022: 1.834.923)		3.687.627	4,97
20.000	Anglian Water Services Financing Plc 6.293% 30-Jul-2030	27.599	0,04
30.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.250% 24-May-2029	35.540	0,05
50.000	AT&T Inc 5.500% 15-Mar-2027	65.371	0,09
20.000	Aviva Plc FRN 6.125% 14-Nov-2036	26.095	0,03
50.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.686% 06-Jul-2026	65.070	0,09
50.000	Bank of America Corp 'EMTN' 7.000% 31-Jul-2028	70.422	0,09
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.000% 16-Jul-2026	116.728	0,16
100.000	Barclays Plc 'EMTN' 3.250% 12-Feb-2027	120.534	0,16
50.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 6.000% 24-Nov-2034	62.903	0,08
50.000	BG Energy Capital Plc 'EMTN' 5.125% 01-Dec-2025	64.532	0,09
100.000	Blend Funding Plc 3.459% 21-Sep-2047	101.500	0,14
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 5.750% 13-Jun-2032	134.428	0,18
10.000	British Telecommunications Plc 5.750% 07-Dec-2028	13.458	0,02
15.000	Citigroup Inc 'EMTN' 5.150% 21-May-2026	19.303	0,03
5.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN' 5.250% 23-May-2041	7.073	0,01
100.000	Crh Finance UK Plc 'EMTN' 4.125% 02-Dec-2029	124.026	0,17
60.000	Deutsche Telekom International Finance BV 7.625% 15-Jun-2030	91.006	0,12
100.000	Digital Stout Holding LLC 3.300% 19-Jul-2029	117.666	0,16
50.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.875% 30-Oct-2037	68.338	0,09
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.250% 03-Jun-2030	13.855	0,02
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.375% 07-Jun-2032	7.047	0,01
50.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 5.750% 14-Sep-2040	66.743	0,09
50.000	Engie SA 'EMTN' 5.000% 01-Oct-2060	63.239	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Pfund Sterling Forts.			
100.000	Fidelity National Information Services Inc 3.360% 21-May-2031	116.748	0,16
20.000	Freshwater Finance Plc 5.182% 20-Apr-2035	25.200	0,03
10.000	General Electric Co 'EMTN' 4.875% 18-Sep-2037	11.999	0,02
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 5.250% 19-Dec-2033	6.980	0,01
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.500% 07-Dec-2027	57.058	0,08
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.125% 25-Jul-2029	35.473	0,05
100.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 5.875% 13-May-2041	138.005	0,19
5.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP FRN (Perpetual) 5.844% 05-Nov-2031	6.664	0,01
5.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 5.750% 20-Dec-2027	6.629	0,01
50.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 7.000% 07-Apr-2038	70.285	0,09
100.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028	118.817	0,16
10.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN' 5.875% 11-Dec-2031	13.958	0,02
10.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN' 5.875% 05-Apr-2033	13.862	0,02
5.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 6.500% 17-Sep-2040	7.637	0,01
100.000	London & Quadrant Housing Trust 2.250% 20-Jul-2029	112.592	0,15
100.000	M&G Plc FRN 5.625% 20-Oct-2051	121.686	0,16
8.000	McDonald's Corp 'EMTN' 5.875% 23-Apr-2032	11.308	0,01
100.000	National Grid Electricity Distribution Plc 3.500% 16-Oct-2026	123.293	0,17
10.000	National Grid Electricity Distribution South West Plc 5.875% 25-Mar-2027	13.268	0,02
100.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 2.105% 28-Nov-2031	113.814	0,15
100.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 19-Sep-2026	122.195	0,16
50.000	Orange SA 'EMTN' 5.375% 22-Nov-2050	69.509	0,09
15.000	Orange SA 'EMTN' 5.625% 23-Jan-2034	20.805	0,03
100.000	Pfizer Inc 'REGS' 2.735% 15-Jun-2043	96.639	0,13
10.000	Prudential Funding Asia Plc 'EMTN' 6.125% 19-Dec-2031	13.353	0,02
50.000	Sanctuary Capital Plc 6.697% 23-Mar-2039	77.129	0,10
100.000	Santander UK Plc 'EMTN' 3.875% 15-Oct-2029	123.468	0,17
50.000	Scotland Gas Networks Plc 4.875% 21-Dec-2034	62.298	0,08
5.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 6.250% 07-Jun-2029	6.832	0,01
10.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN' 5.500% 05-Jun-2026	12.999	0,02
9.490	Sunderland SHG Finance Plc 6.380% 31-Mar-2042	13.345	0,02
50.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 5.125% 28-Sep-2037	55.708	0,07
10.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 6.750% 16-Nov-2028	12.974	0,02
10.000	THFC Funding No 1 Plc 5.125% 21-Dec-2035	13.168	0,02
5.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN' 5.625% 20-Dec-2027	6.621	0,01
100.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN 4.000% 25-Sep-2026	122.515	0,16
10.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 5.900% 26-Nov-2032	14.007	0,02
30.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2025	37.028	0,05
10.000	Walmart Inc 5.250% 28-Sep-2035	14.014	0,02
5.000	Wessex Water Services Finance Plc 5.375% 10-Mar-2028	6.464	0,01
100.000	Whitbread Group Plc 3.000% 31-May-2031	109.833	0,15
50.000	Yorkshire Water Finance Plc 6.375% 19-Aug-2039	68.971	0,09
US-Dollar - 48.329.458			
(31. Dezember 2022: 31.269.488)		48.329.458	65,13
20.000	3M Co 2.375% 26-Aug-2029	17.728	0,02
30.000	3M Co 'MTN' 3.375% 01-Mar-2029	28.117	0,04
20.000	3M Co 'MTN' 3.625% 14-Sep-2028	19.094	0,03
15.000	7-Eleven Inc '144A' 0.950% 10-Feb-2026	13.875	0,02
15.000	7-Eleven Inc '144A' 1.800% 10-Feb-2031	12.218	0,02
10.000	7-Eleven Inc '144A' 2.500% 10-Feb-2041	6.932	0,01
5.000	ABB Finance USA Inc 4.375% 08-May-2042	4.614	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Abbott Laboratories 4.750% 30-Nov-2036	5.137	0,01
10.000	Abbott Laboratories 6.150% 30-Nov-2037	11.535	0,02
30.000	AbbVie Inc 2.950% 21-Nov-2026	28.791	0,04
50.000	AbbVie Inc 3.200% 14-May-2026	48.468	0,07
20.000	AbbVie Inc 3.200% 21-Nov-2029	18.728	0,03
20.000	AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039	18.138	0,02
40.000	AbbVie Inc 4.400% 06-Nov-2042	37.270	0,05
50.000	AbbVie Inc 4.500% 14-May-2035	49.046	0,07
20.000	AbbVie Inc 4.550% 15-Mar-2035	19.658	0,03
10.000	ABN AMRO Bank NV '144A' 4.750% 28-Jul-2025	9.810	0,01
10.000	ACE Capital Trust II 9.700% 01-Apr-2030	11.761	0,02
20.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 4.375% 03-Jul-2029	17.558	0,02
10.000	Adobe Inc 2.300% 01-Feb-2030	8.975	0,01
5.000	Adventist Health System/West 2.952% 01-Mar-2029	4.528	0,01
5.000	Advocate Health & Hospitals Corp 2.211% 15-Jun-2030	4.308	0,01
10.000	Advocate Health & Hospitals Corp 3.829% 15-Aug-2028	9.736	0,01
30.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.450% 29-Oct-2026	27.794	0,04
15.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.000% 29-Oct-2028	13.717	0,02
50.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.300% 30-Jan-2032	43.584	0,06
20.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.650% 21-Jul-2027	19.033	0,03
10.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.850% 29-Oct-2041	8.091	0,01
10.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 6.500% 15-Jul-2025	10.133	0,01
25.000	AES Corp/The '144A' 3.300% 15-Jul-2025	24.097	0,03
20.000	Aetna Inc 3.875% 15-Aug-2047	15.728	0,02
5.000	Aetna Inc 4.500% 15-May-2042	4.403	0,01
5.000	Aetna Inc 6.625% 15-Jun-2036	5.620	0,01
50.000	Affiliated Managers Group Inc 3.500% 01-Aug-2025	48.519	0,07
10.000	Aflac Inc 3.600% 01-Apr-2030	9.474	0,01
5.000	Ahold Finance USA LLC 6.875% 01-May-2029	5.538	0,01
10.000	Alia Group Ltd '144A' 3.200% 16-Sep-2040	7.622	0,01
10.000	Alia Group Ltd '144A' 3.600% 09-Apr-2029	9.475	0,01
10.000	Alia Group Ltd '144A' 5.625% 25-Oct-2027	10.328	0,01
10.000	AlB Group Plc '144A' FRN 7.583% 14-Oct-2026	10.326	0,01
5.000	AlG SunAmerica Global Financing X '144A' 6.900% 15-Mar-2032	5.492	0,01
6.225	Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 3.600% 15-Mar-2027	5.864	0,01
20.000	Air Products and Chemicals Inc 1.850% 15-May-2027	18.458	0,03
5.000	Airbus SE '144A' 3.150% 10-Apr-2027	4.787	0,01
5.000	Aircastle Ltd 4.250% 15-Jun-2026	4.837	0,01
20.000	Aircastle Ltd '144A' 6.500% 18-Jul-2028	20.435	0,03
20.000	Aker BP ASA '144A' 3.100% 15-Jul-2031	17.150	0,02
10.000	Alabama Power Co 3.850% 01-Dec-2042	8.483	0,01
7.648	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.800% 15-Aug-2027	7.446	0,01
5.000	Albemarle Corp 5.650% 01-Jun-2052	4.670	0,01
20.000	Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.125% 15-May-2028	20.138	0,03
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 1.875% 01-Feb-2033	7.808	0,01
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 2.950% 15-Mar-2034	8.365	0,01
20.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.000% 18-May-2051	13.260	0,02
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.950% 15-Jan-2028	9.613	0,01
4.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 4.750% 15-Apr-2035	3.892	0,01
5.000	Alfa SAB de CV 'REGS' 6.875% 25-Mar-2044	4.989	0,01
10.000	Alibaba Group Holding Ltd 2.700% 09-Feb-2041	6.871	0,01
50.000	Alibaba Group Holding Ltd 3.400% 06-Dec-2027	47.479	0,06
20.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.000% 06-Dec-2037	17.240	0,02
10.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.400% 06-Dec-2057	8.191	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 2.950% 25-Jan-2030	17.943	0,02
20.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 3.550% 26-Jul-2027	19.269	0,03
10.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 3.800% 25-Jan-2050	7.655	0,01
20.000	Allegion US Holding Co Inc 3.550% 01-Oct-2027	19.034	0,03
74.000	Alliant Energy Finance LLC '144A' 5.950% 30-Mar-2029	77.091	0,10
5.000	Allstate Corp/The 1.450% 15-Dec-2030	4.051	0,01
5.000	Allstate Corp/The FRN 6.500% 15-May-2057	4.981	0,01
30.000	Ally Financial Inc 8.000% 01-Nov-2031	32.932	0,04
50.000	Ally Financial Inc FRN 6.848% 03-Jan-2030	51.438	0,07
10.000	Altria Group Inc 2.450% 04-Feb-2032	8.174	0,01
40.000	Altria Group Inc 3.875% 16-Sep-2046	30.197	0,04
10.000	Altria Group Inc 4.000% 04-Feb-2061	7.343	0,01
10.000	Altria Group Inc 4.250% 09-Aug-2042	8.161	0,01
20.000	Altria Group Inc 4.800% 14-Feb-2029	19.967	0,03
50.000	Altria Group Inc 5.800% 14-Feb-2039	51.157	0,07
10.000	Altria Group Inc 5.950% 14-Feb-2049	10.248	0,01
20.000	Altria Group Inc 6.875% 01-Nov-2033	22.078	0,03
20.000	Amazon.com Inc 2.700% 03-Jun-2060	13.321	0,02
50.000	Amazon.com Inc 2.875% 12-May-2041	39.460	0,05
10.000	Amazon.com Inc 3.250% 12-May-2061	7.386	0,01
20.000	Amazon.com Inc 3.875% 22-Aug-2037	18.621	0,03
20.000	Amazon.com Inc 4.250% 22-Aug-2057	18.518	0,03
20.000	Amcort Finance USA Inc 4.500% 15-May-2028	19.603	0,03
20.000	Amcort Flexibles North America Inc 2.690% 25-May-2031	17.262	0,02
20.000	Amcort Flexibles North America Inc 4.000% 17-May-2025	19.673	0,03
10.000	Ameren Corp 3.500% 15-Jan-2031	9.143	0,01
10.000	Ameren Illinois Co 3.850% 01-Sep-2032	9.345	0,01
50.000	Ameren Illinois Co 4.950% 01-Jun-2033	50.782	0,07
20.000	America Movil SAB de CV 3.625% 22-Apr-2029	18.922	0,03
15.000	America Movil SAB de CV 4.700% 21-Jul-2032	14.756	0,02
50.000	America Movil SAB de CV 6.125% 30-Mar-2040	54.771	0,07
20.000	America Movil SAB de CV 6.375% 01-Mar-2035	22.446	0,03
60.000	American Electric Power Co Inc 3.200% 13-Nov-2027	57.203	0,08
40.000	American Express Co 2.550% 04-Mar-2027	37.511	0,05
10.000	American Express Co 3.300% 03-May-2027	9.573	0,01
50.000	American Express Co 3.625% 05-Dec-2024	49.203	0,07
10.000	American Express Co 3.950% 01-Aug-2025	9.842	0,01
50.000	American Express Co 5.850% 05-Nov-2027	52.203	0,07
100.000	American Express Co FRN 4.989% 26-May-2033	99.727	0,13
60.000	American Express Co FRN 5.389% 28-Jul-2027	60.738	0,08
30.000	American Express Co FRN 5.625% 28-Jul-2034	31.087	0,04
20.000	American Express Co FRN 6.489% 30-Oct-2031	21.731	0,03
10.000	American Homes 4 Rent LP 3.375% 15-Jul-2051	6.901	0,01
5.000	American Homes 4 Rent LP 4.900% 15-Feb-2029	4.955	0,01
10.000	American Honda Finance Corp 4.600% 17-Apr-2030	10.000	0,01
50.000	American Honda Finance Corp 'GMTN' 5.125% 07-Jul-2028	51.440	0,07
10.000	American International Group Inc 4.375% 30-Jun-2050	8.984	0,01
10.000	American International Group Inc 4.500% 16-Jul-2044	9.084	0,01
30.000	American International Group Inc 6.250% 01-May-2036	32.008	0,04
10.000	American International Group Inc FRN 5.750% 01-Apr-2048	9.876	0,01
10.000	American Tower Corp 1.500% 31-Jan-2028	8.742	0,01
10.000	American Tower Corp 1.875% 15-Oct-2030	8.215	0,01
10.000	American Tower Corp 2.300% 15-Sep-2031	8.285	0,01
10.000	American Tower Corp 2.700% 15-Apr-2031	8.607	0,01
20.000	American Tower Corp 2.750% 15-Jan-2027	18.774	0,03
10.000	American Tower Corp 2.950% 15-Jan-2025	9.765	0,01
20.000	American Tower Corp 3.100% 15-Jun-2050	13.707	0,02
40.000	American Tower Corp 3.375% 15-Oct-2026	38.367	0,05
20.000	American Tower Corp 3.800% 15-Aug-2029	19.020	0,03
10.000	American Tower Corp 4.000% 01-Jun-2025	9.832	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	American Tower Corp 4.400% 15-Feb-2026	9.884	0,01
24.000	American Tower Corp 5.550% 15-Jul-2033	24.894	0,03
10.000	American Water Capital Corp 2.800% 01-May-2030	8.971	0,01
5.000	American Water Capital Corp 3.450% 01-Jun-2029	4.736	0,01
20.000	American Water Capital Corp 4.000% 01-Dec-2046	16.906	0,02
5.000	American Water Capital Corp 4.150% 01-Jun-2049	4.331	0,01
5.000	American Water Capital Corp 4.450% 01-Jun-2032	4.963	0,01
20.000	Ameriprise Financial Inc 5.150% 15-May-2033	20.668	0,03
50.000	Amgen Inc 2.200% 21-Feb-2027	46.542	0,06
10.000	Amgen Inc 2.300% 25-Feb-2031	8.572	0,01
25.000	Amgen Inc 3.150% 21-Feb-2040	19.524	0,03
25.000	Amgen Inc 3.375% 21-Feb-2050	18.706	0,03
10.000	Amgen Inc 4.400% 01-May-2045	8.917	0,01
20.000	Amgen Inc 4.400% 22-Feb-2062	16.967	0,02
60.000	Amgen Inc 4.663% 15-Jun-2051	54.838	0,07
60.000	Amgen Inc 5.150% 02-Mar-2028	61.409	0,08
40.000	Amgen Inc 5.250% 02-Mar-2025	40.112	0,05
50.000	Amgen Inc 5.250% 02-Mar-2030	51.492	0,07
40.000	Amgen Inc 5.250% 02-Mar-2033	41.082	0,06
20.000	Amgen Inc 5.600% 02-Mar-2043	20.742	0,03
20.000	Amgen Inc 5.650% 02-Mar-2053	21.151	0,03
10.000	Amgen Inc 5.750% 02-Mar-2063	10.555	0,01
20.000	Amphenol Corp 2.200% 15-Sep-2031	16.869	0,02
10.000	Analog Devices Inc 4.250% 01-Oct-2032	9.791	0,01
10.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.000% 11-Sep-2027	9.623	0,01
15.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.500% 15-Mar-2028	14.626	0,02
5.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14-May-2025	4.966	0,01
10.000	Anglo American Capital Plc 'REGS' 2.625% 10-Sep-2030	8.529	0,01
10.000	Anglo American Capital Plc 'REGS' 4.750% 16-Mar-2052	8.625	0,01
10.000	Anglo American Capital Plc 'REGS' 5.625% 01-Apr-2030	10.176	0,01
50.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.700% 01-Feb-2036	50.058	0,07
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.350% 01-Jun-2040	18.764	0,03
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.900% 23-Jan-2031	20.854	0,03
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.950% 15-Jan-2042	20.096	0,03
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.450% 23-Jan-2039	21.156	0,03
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.800% 23-Jan-2059	11.284	0,02
50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 8.000% 15-Nov-2039	64.855	0,09
10.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 17-Jul-2027	9.536	0,01
5.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 21-Jan-2028	4.742	0,01
5.000	Aon Corp 8.205% 01-Jan-2027	5.348	0,01
25.000	Aon Corp / Aon Global Holdings Plc 3.900% 28-Feb-2052	19.982	0,03
20.000	Aon Corp / Aon Global Holdings Plc 5.350% 28-Feb-2033	20.563	0,03
5.000	Aon Global Ltd 3.875% 15-Dec-2025	4.901	0,01
10.000	AP Moller - Maersk A/S '144A' 4.500% 20-Jun-2029	9.863	0,01
35.000	APA Infrastructure Ltd '144A' 4.200% 23-Mar-2025	34.504	0,05
20.000	APA Infrastructure Ltd '144A' 4.250% 15-Jul-2027	19.433	0,03
20.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	17.168	0,02
5.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	4.167	0,01
50.000	Apollo Global Management Inc 6.375% 15-Nov-2033	53.965	0,07
20.000	Apollo Management Holdings LP '144A' 4.400% 27-May-2026	19.613	0,03
20.000	Appalachian Power Co 2.700% 01-Apr-2031	17.126	0,02
5.000	Appalachian Power Co 3.300% 01-Jun-2027	4.748	0,01
50.000	Appalachian Power Co 3.700% 01-May-2050	37.673	0,05
30.000	Appalachian Power Co 7.000% 01-Apr-2038	34.879	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Apple Inc 1.650% 08-Feb-2031	4.224	0,01
20.000	Apple Inc 1.700% 05-Aug-2031	16.772	0,02
20.000	Apple Inc 2.375% 08-Feb-2041	14.669	0,02
10.000	Apple Inc 2.800% 08-Feb-2061	6.859	0,01
20.000	Apple Inc 2.850% 05-Aug-2061	13.759	0,02
10.000	Apple Inc 3.350% 08-Aug-2032	9.415	0,01
10.000	Apple Inc 4.100% 08-Aug-2062	8.966	0,01
20.000	Aptiv Plc / Aptiv Corp 4.150% 01-May-2052	15.922	0,02
10.000	Aquarion Co '144A' 4.000% 15-Aug-2024	9.895	0,01
20.000	ArcelorMittal SA 6.550% 29-Nov-2027	21.032	0,03
30.000	ArcelorMittal SA 6.800% 29-Nov-2032	32.521	0,04
10.000	Arch Capital Group Ltd 7.350% 01-May-2034	11.499	0,02
10.000	Arch Capital Group US Inc 5.144% 01-Nov-2043	9.523	0,01
50.000	Archer-Daniels-Midland Co 4.016% 16-Apr-2043	43.260	0,06
10.000	Ares Capital Corp 2.875% 15-Jun-2028	8.878	0,01
20.000	Ares Capital Corp 3.200% 15-Nov-2031	16.777	0,02
20.000	Ares Capital Corp 3.875% 15-Jan-2026	19.230	0,03
10.000	Ares Capital Corp 4.250% 01-Mar-2025	9.783	0,01
30.000	Arizona Public Service Co 2.600% 15-Aug-2029	26.859	0,04
30.000	Arizona Public Service Co 6.350% 15-Dec-2032	32.581	0,04
10.000	Arrow Electronics Inc 3.875% 12-Jan-2028	9.500	0,01
20.000	Arthur J Gallagher & Co 3.500% 20-May-2051	14.914	0,02
20.000	Arthur J Gallagher & Co 6.500% 15-Feb-2034	21.914	0,03
10.000	ASB Bank Ltd '144A' FRN 5.284% 17-Jun-2032	9.835	0,01
20.000	Ascension Health 2.532% 15-Nov-2029	17.888	0,02
20.000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.250% 01-Nov-2029	18.719	0,03
20.000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2027	19.242	0,03
20.000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.500% 11-Aug-2032	19.811	0,03
20.000	Assured Guaranty US Holdings Inc 3.600% 15-Sep-2051	14.426	0,02
20.000	Assured Guaranty US Holdings Inc 6.125% 15-Sep-2028	21.037	0,03
10.000	Astrazeneca Finance LLC 2.250% 28-May-2031	8.641	0,01
10.000	AstraZeneca Plc 3.125% 12-Jun-2027	9.617	0,01
30.000	AstraZeneca Plc 6.450% 15-Sep-2037	35.185	0,05
15.000	AT&T Inc 1.650 % 01-Feb-2028	13.373	0,02
55.000	AT&T Inc 1.700% 25-Mar-2026	51.490	0,07
50.000	AT&T Inc 2.550% 01-Dec-2033	40.817	0,06
50.000	AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031	43.928	0,06
25.000	AT&T Inc 3.300% 01-Feb-2052	17.938	0,02
60.000	AT&T Inc 3.500% 15-Sep-2053	43.789	0,06
80.000	AT&T Inc 3.550% 15-Sep-2055	57.894	0,08
15.000	AT&T Inc 3.650% 01-Jun-2051	11.360	0,02
20.000	AT&T Inc 3.650% 15-Sep-2059	14.413	0,02
20.000	AT&T Inc 3.800% 01-Dec-2057	14.951	0,02
20.000	AT&T Inc 4.100 % 15-Feb-2028	29.362	0,04
5.000	AT&T Inc 4.250% 01-Mar-2027	4.950	0,01
20.000	AT&T Inc 4.300% 15-Feb-2030	19.632	0,03
45.000	AT&T Inc 4.500 % 15-May-2035	42.748	0,06
10.000	AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048	8.769	0,01
5.000	AT&T Inc 4.550% 09-Mar-2049	4.395	0,01
10.000	AT&T Inc 4.650% 01-Jun-2044	8.974	0,01
10.000	AT&T Inc 4.750 % 15-May-2046	9.080	0,01
20.000	AT&T Inc 4.800% 15-Jun-2044	18.369	0,02
10.000	AT&T Inc 5.350% 01-Sep-2040	9.909	0,01
57.000	AT&T Inc 5.400 % 15-Feb-2034	58.926	0,08
18.000	AT&T Inc 5.700% 01-Mar-2057	18.198	0,02
20.000	Athene Global Funding '144A' 1.608% 29-Jun-2026	18.122	0,02
30.000	Athene Global Funding '144A' 1.985% 19-Aug-2028	25.967	0,04
20.000	Athene Global Funding '144A' 2.450% 20-Aug-2027	17.971	0,02
10.000	Athene Global Funding '144A' 2.550% 29-Jun-2025	9.529	0,01
10.000	Athene Global Funding '144A' 2.673% 07-Jun-2031	8.229	0,01
50.000	Athene Holding Ltd 5.875% 15-Jan-2034	50.598	0,07
9.228	Atlantica Transmision Sur SA 'REGS' 6.875% 30-Apr-2043	9.159	0,01
10.000	Atmos Energy Corp 1.500% 15-Jan-2031	8.152	0,01
20.000	Atmos Energy Corp 6.200% 15-Nov-2053	23.582	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' 4.400% 19-May-2026	9.766	0,01
20.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 2.570% 25-Nov-2035	16.179	0,02
20.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 2.950% 22-Jul-2030	19.008	0,03
10.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 'MTN' 3.700% 16-Nov-2025	9.831	0,01
10.000	Automatic Data Processing Inc 1.250% 01-Sep-2030	8.343	0,01
20.000	AutoNation Inc 1.950% 01-Aug-2028	17.237	0,02
10.000	AutoZone Inc 4.500% 01-Feb-2028	9.947	0,01
10.000	AutoZone Inc 4.750% 01-Feb-2033	9.870	0,01
20.000	AutoZone Inc 6.250% 01-Nov-2028	21.283	0,03
20.000	AutoZone Inc 6.550% 01-Nov-2033	22.261	0,03
20.000	Avery Dennison Corp 2.250% 15-Feb-2032	16.485	0,02
15.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 4.875% 01-Oct-2025	14.715	0,02
20.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 6.250% 15-Apr-2028	20.407	0,03
20.000	Avnet Inc 3.000% 15-May-2031	16.960	0,02
10.000	Avnet Inc 4.625% 15-Apr-2026	9.848	0,01
20.000	Avnet Inc 6.250% 15-Mar-2028	20.767	0,03
10.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.875% 15-Feb-2025	9.654	0,01
10.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	9.688	0,01
40.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 6.375% 04-May-2028	40.862	0,06
10.000	AXA SA 8.600% 15-Dec-2030	11.983	0,02
40.000	Bacardi Ltd 'REGS' 4.700% 15-May-2028	39.264	0,05
10.000	BAE Systems Plc '144A' 3.000% 15-Sep-2050	7.100	0,01
20.000	BAE Systems Plc '144A' 3.400% 15-Apr-2030	18.491	0,03
50.000	Baidu Inc 1.720% 09-Apr-2026	46.447	0,06
15.000	Baker Hughes Holdings LLC 5.125% 15-Sep-2040	15.221	0,02
10.000	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 3.337% 15-Dec-2027	9.572	0,01
10.000	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 4.486% 01-May-2030	10.020	0,01
10.000	Baltimore Gas and Electric Co 5.400% 01-Jun-2053	10.392	0,01
10.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN 3.125% 01-Jul-2030	9.539	0,01
10.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS' 2.875% 14-Oct-2031	8.487	0,01
10.000	Banco Inbursa SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 'REGS' 4.375% 11-Apr-2027	9.676	0,01
10.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' 3.250% 04-Oct-2026	9.443	0,01
20.000	Banco Santander Chile 'REGS' 2.700% 10-Jan-2025	19.471	0,03
10.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	9.993	0,01
20.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong '144A' 9.025% 15-Mar-2029	23.004	0,03
50.000	Bank of America Corp 7.750% 14-May-2038	61.040	0,08
100.000	Bank of America Corp FRN 1.734% 22-Jul-2027	91.691	0,12
10.000	Bank of America Corp FRN 2.687% 22-Apr-2032	8.462	0,01
10.000	Bank of America Corp FRN 3.311% 22-Apr-2042	7.869	0,01
70.000	Bank of America Corp FRN 3.419% 20-Dec-2028	65.958	0,09
50.000	Bank of America Corp FRN 3.846% 08-Mar-2037	44.010	0,06
30.000	Bank of America Corp FRN 4.571% 27-Apr-2033	28.683	0,04
100.000	Bank of America Corp FRN 6.204% 10-Nov-2028	104.439	0,14
35.000	Bank of America Corp 'MTN' 3.248% 21-Oct-2027	33.356	0,05
15.000	Bank of America Corp 'MTN' 3.875% 01-Aug-2025	14.786	0,02
20.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.000% 22-Jan-2025	19.747	0,03
15.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.250% 22-Oct-2026	14.743	0,02
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 1.319% 19-Jun-2026	94.197	0,13
50.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.015% 13-Feb-2026	48.059	0,06
45.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031	38.720	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
35.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.676% 19-Jun-2041	25.174	0,03
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.972% 04-Feb-2033	85.118	0,11
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.384% 02-Apr-2026	19.466	0,03
30.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.559% 23-Apr-2027	28.898	0,04
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.974% 07-Feb-2030	14.227	0,02
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.078% 23-Apr-2040	8.767	0,01
50.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029	48.371	0,07
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 5.015% 22-Jul-2033	19.820	0,03
100.000	Bank of America NA 5.526% 18-Aug-2026	101.923	0,14
20.000	Bank of Ireland Group Plc '144A' FRN 2.029% 30-Sep-2027	18.262	0,02
10.000	Bank of Ireland Group Plc '144A' FRN 6.253% 16-Sep-2026	10.118	0,01
20.000	Bank of Montreal 5.203% 01-Feb-2028	20.402	0,03
20.000	Bank of Montreal FRN 3.803% 15-Dec-2032	18.432	0,03
5.000	Bank of Montreal 'MTN' 1.250% 15-Sep-2026	4.559	0,01
10.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.650% 08-Mar-2027	9.426	0,01
55.000	Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027	50.685	0,07
10.000	Bank of New Zealand '144A' 2.285% 27-Jan-2027	9.265	0,01
15.000	Bank of Nova Scotia/The 1.050% 02-Mar-2026	13.826	0,02
15.000	Bank of Nova Scotia/The 1.950% 02-Feb-2027	13.831	0,02
70.000	Bank of Nova Scotia/The 4.500% 16-Dec-2025	68.924	0,09
50.000	Bank of Nova Scotia/The 4.850% 01-Feb-2030	50.008	0,07
20.000	Bank of Nova Scotia/The 5.650% 01-Feb-2034	20.792	0,03
40.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 4.588% 04-May-2037	35.904	0,05
20.000	Bank of Nova Scotia/The 'MTN' 3.450% 11-Apr-2025	19.587	0,03
30.000	Banner Health 2.338% 01-Jan-2030	25.982	0,04
10.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 0.998% 04-Feb-2025	9.546	0,01
40.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 4.753% 13-Jul-2027	39.787	0,05
20.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 5.896% 13-Jul-2026	20.439	0,03
15.000	Barclays Plc 3.650% 16-Mar-2025	14.677	0,02
25.000	Barclays Plc 4.375% 12-Jan-2026	24.684	0,03
10.000	Barclays Plc 4.836% 09-May-2028	9.760	0,01
20.000	Barclays Plc 4.950% 10-Jan-2047	18.810	0,03
30.000	Barclays Plc 5.200% 12-May-2026	29.835	0,04
50.000	Barclays Plc FRN 2.852% 07-May-2026	48.249	0,07
70.000	Barclays Plc FRN 3.564% 23-Sep-2035	60.167	0,08
10.000	Barclays Plc FRN 5.088% 20-Jun-2030	9.710	0,01
40.000	Barclays Plc FRN 5.501% 09-Aug-2028	40.217	0,05
20.000	Barclays Plc FRN 7.437% 02-Nov-2033	22.448	0,03
10.000	Barrick Gold Corp 5.250% 01-Apr-2042	10.072	0,01
50.000	BAT Capital Corp 2.259% 25-Mar-2028	44.817	0,06
10.000	BAT Capital Corp 3.215% 06-Sep-2026	9.575	0,01
14.000	BAT Capital Corp 3.557% 15-Aug-2027	13.378	0,02
10.000	BAT Capital Corp 3.734% 25-Sep-2040	7.383	0,01
20.000	BAT Capital Corp 3.984% 25-Sep-2050	14.180	0,02
10.000	BAT Capital Corp 4.390% 15-Aug-2037	8.414	0,01
45.000	BAT Capital Corp 4.540% 15-Aug-2047	34.740	0,05
30.000	BAT Capital Corp 4.742% 16-Mar-2032	28.863	0,04
30.000	BAT Capital Corp 4.906% 02-Apr-2030	29.553	0,04
50.000	BAT Capital Corp 6.421% 02-Aug-2033	52.524	0,07
30.000	BAT International Finance Plc 1.668% 25-Mar-2026	27.888	0,04
20.000	Baxter International Inc 1.915% 01-Feb-2027	18.337	0,02
20.000	Baxter International Inc 2.272% 01-Dec-2028	17.910	0,02
100.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.250% 15-Dec-2025	97.507	0,13
35.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.375% 15-Dec-2028	33.330	0,05
10.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.625% 25-Jun-2038	8.669	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.875% 25-Jun-2048	16.948	0,02
50.000	Bayer US Finance LLC '144A' 6.375% 21-Nov-2030	51.453	0,07
10.000	Becton Dickinson & Co 3.700% 06-Jun-2027	9.702	0,01
10.000	Becton Dickinson & Co 4.669% 06-Jun-2047	9.389	0,01
15.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 3.650% 15-Aug-2052	11.641	0,02
10.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 4.464% 01-Apr-2048	9.030	0,01
50.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.250% 15-Apr-2028	47.523	0,06
5.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.700% 15-Jul-2030	4.738	0,01
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 01-Apr-2036	10.875	0,01
5.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.850% 12-Mar-2030	4.359	0,01
10.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 5.750% 15-Jan-2040	11.350	0,02
50.000	Berry Global Inc 1.570% 15-Jan-2026	46.487	0,06
20.000	Berry Global Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2026	19.666	0,03
20.000	Berry Global Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2028	20.276	0,03
5.000	BG Energy Capital Plc '144A' 5.125% 15-Oct-2041	4.783	0,01
15.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS' 4.375% 10-Jun-2025	14.798	0,02
10.000	BHP Billiton Finance USA Ltd 4.900% 28-Feb-2033	10.250	0,01
10.000	BHP Billiton Finance USA Ltd 6.420% 01-Mar-2026	10.349	0,01
10.000	Bimbo Bakeries USA Inc 'REGS' 4.000% 17-May-2051	8.082	0,01
20.000	Biogen Inc 3.250% 15-Feb-2051	14.401	0,02
10.000	Biogen Inc 4.050% 15-Sep-2025	9.844	0,01
5.000	Black Hills Corp 3.050% 15-Oct-2029	4.503	0,01
10.000	Black Hills Corp 3.150% 15-Jan-2027	9.479	0,01
5.000	BlackRock Inc 2.400% 30-Apr-2030	4.476	0,01
10.000	BlackRock Inc 3.200% 15-Mar-2027	9.700	0,01
20.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A' 1.625% 05-Aug-2028	17.434	0,02
20.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A' 3.150% 02-Oct-2027	18.838	0,03
20.000	Blackstone Private Credit Fund 3.250% 15-Mar-2027	18.373	0,02
20.000	Blackstone Private Credit Fund 4.000% 15-Jan-2029	18.222	0,02
50.000	Blackstone Private Credit Fund '144A' 7.300% 27-Nov-2028	52.079	0,07
20.000	Blackstone Secured Lending Fund 2.850% 30-Sep-2028	17.353	0,02
10.000	Blackstone Secured Lending Fund 3.625% 15-Jan-2026	9.547	0,01
10.000	Block Financial LLC 3.875% 15-Aug-2030	9.162	0,01
20.000	Blue Owl Capital Corp 3.750% 22-Jul-2025	19.170	0,03
10.000	Blue Owl Credit Income Corp 3.125% 23-Sep-2026	9.142	0,01
20.000	Blue Owl Credit Income Corp '144A' 7.950% 13-Jun-2028	20.768	0,03
10.000	Blue Owl Finance LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2032	8.750	0,01
10.000	BMW US Capital LLC '144A' 1.950% 12-Aug-2031	8.258	0,01
30.000	BMW US Capital LLC '144A' 5.150% 11-Aug-2033	31.028	0,04
20.000	BNP Paribas SA '144A' 3.375% 09-Jan-2025	19.596	0,03
20.000	BNP Paribas SA '144A' 4.400% 14-Aug-2028	19.521	0,03
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 1.323% 13-Jan-2027	4.616	0,01
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.219% 09-Jun-2026	4.776	0,01
20.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.591% 20-Jan-2028	18.531	0,03
30.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.819% 19-Nov-2025	29.246	0,04
15.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 3.132% 20-Jan-2033	12.790	0,02
40.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 5.198% 10-Jan-2030	40.117	0,05
50.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 5.335% 12-Jun-2029	50.803	0,07
5.000	BNSF Funding Trust I FRN 6.613% 15-Dec-2055	4.893	0,01
10.000	Boardwalk Pipelines LP 4.450% 15-Jul-2027	9.823	0,01
40.000	Boeing Co/The 2.196% 04-Feb-2026	37.815	0,05
50.000	Boeing Co/The 2.250% 15-Jun-2026	46.888	0,06
5.000	Boeing Co/The 3.625% 01-Feb-2031	4.654	0,01
60.000	Boeing Co/The 3.825% 01-Mar-2059	44.765	0,06
50.000	Boeing Co/The 4.875% 01-May-2025	49.796	0,07
40.000	Boeing Co/The 5.040% 01-May-2027	40.397	0,05
10.000	Boeing Co/The 5.705% 01-May-2040	10.388	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Boeing Co/The 5.805% 01-May-2050	20.808	0,03
10.000	Boeing Co/The 5.930% 01-May-2060	10.417	0,01
25.000	Boeing Co/The 6.125% 15-Feb-2033	27.031	0,04
50.000	Boeing Co/The 6.625% 15-Feb-2038	55.863	0,08
10.000	Booking Holdings Inc 4.625% 13-Apr-2030	10.093	0,01
50.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	47.206	0,06
10.000	BorgWarner Inc 2.650% 01-Jul-2027	9.283	0,01
20.000	Boston Properties LP 2.750% 01-Oct-2026	18.578	0,03
10.000	Boston Properties LP 3.200% 15-Jan-2025	9.729	0,01
20.000	Boston Properties LP 3.400% 21-Jun-2029	17.967	0,02
20.000	BP Capital Markets America Inc 3.060% 17-Jun-2041	15.533	0,02
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.119% 04-May-2026	4.841	0,01
15.000	BP Capital Markets America Inc 3.379% 08-Feb-2061	10.926	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.410% 11-Feb-2026	4.886	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.633% 06-Apr-2030	4.796	0,01
50.000	BP Capital Markets America Inc 4.234% 06-Nov-2028	49.771	0,07
30.000	BP Capital Markets America Inc 4.812% 13-Feb-2033	30.320	0,04
5.000	BP Capital Markets Plc 3.279% 19-Sep-2027	4.815	0,01
5.000	BPCE SA '144A' 1.000% 20-Jan-2026	4.606	0,01
25.000	BPCE SA '144A' 2.700% 01-Oct-2029	22.094	0,03
10.000	BPCE SA '144A' 3.250% 11-Jan-2028	9.322	0,01
25.000	BPCE SA '144A' 3.500% 23-Oct-2027	23.442	0,03
20.000	BPCE SA '144A' 4.500% 15-Mar-2025	19.637	0,03
50.000	BPCE SA '144A' FRN 3.582% 19-Oct-2042	35.370	0,05
20.000	BPCE SA '144A' FRN 5.748% 19-Jul-2033	20.135	0,03
50.000	BPCE SA '144A' FRN 5.975% 18-Jan-2027	50.437	0,07
20.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030	15.550	0,02
20.000	Brighthouse Financial Global Funding '144A' 1.750% 13-Jan-2025	19.222	0,03
15.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.250% 01-Aug-2042	11.675	0,02
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.400% 26-Jul-2029	9.501	0,01
30.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.450% 15-Nov-2027	29.129	0,04
5.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.900% 15-Mar-2062	3.923	0,01
20.000	Bristol-Myers Squibb Co 5.900% 15-Nov-2033	21.840	0,03
50.000	Bristol-Myers Squibb Co 6.400% 15-Nov-2063	58.237	0,08
12.550	British Airways 2019-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Dec-2032	11.193	0,02
15.000	British Telecommunications Plc 9.625% 15-Dec-2030	18.597	0,03
5.000	British Telecommunications Plc '144A' 3.250% 08-Nov-2029	4.574	0,01
20.000	Brixmor Operating Partnership LP 4.125% 15-Jun-2026	19.394	0,03
60.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15-Jan-2027	58.584	0,08
30.000	Broadcom Inc 4.150% 15-Nov-2030	28.713	0,04
100.000	Broadcom Inc 4.300% 15-Nov-2032	96.097	0,13
35.000	Broadcom Inc 4.750% 15-Apr-2029	35.134	0,05
10.000	Broadcom Inc '144A' 1.950% 15-Feb-2028	8.987	0,01
40.000	Broadcom Inc '144A' 2.450% 15-Feb-2031	34.260	0,05
10.000	Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033	8.259	0,01
30.000	Broadcom Inc '144A' 3.137% 15-Nov-2035	24.704	0,03
10.000	Broadcom Inc '144A' 3.187% 15-Nov-2036	8.120	0,01
10.000	Broadcom Inc '144A' 3.469% 15-Apr-2034	8.720	0,01
20.000	Broadcom Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2041	15.925	0,02
20.000	Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051	15.815	0,02
20.000	Broadcom Inc '144A' 4.926% 15-May-2037	19.417	0,03
10.000	Broadridge Financial Solutions Inc 2.900% 01-Dec-2029	8.971	0,01
100.000	Brookfield Finance Inc 4.850% 29-Mar-2029	99.583	0,13
50.000	Brookfield Finance Inc 6.350% 05-Jan-2034	53.349	0,07
15.000	Brown & Brown Inc 2.375% 15-Mar-2031	12.329	0,02
10.000	Brown & Brown Inc 4.500% 15-Mar-2029	9.699	0,01
10.000	Brown & Brown Inc 4.950% 17-Mar-2052	8.926	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Brunswick Corp/DE 2.400% 18-Aug-2031	8.109	0,01
10.000	Brunswick Corp/DE 5.100% 01-Apr-2052	7.823	0,01
10.000	Bunge Ltd Finance Corp 1.630% 17-Aug-2025	9.458	0,01
30.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 5.400% 01-Jun-2041	31.561	0,04
15.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 6.150% 01-May-2037	16.906	0,02
10.000	Burlington Resources LLC 7.400% 01-Dec-2031	11.692	0,02
20.000	CaixaBank SA '144A' FRN 6.208% 18-Jan-2029	20.436	0,03
5.000	California Institute of Technology 4.700% 01-Nov-2111	4.470	0,01
5.000	Camden Property Trust 2.800% 15-May-2030	4.473	0,01
40.000	Cameron LNG LLC '144A' 3.302% 15-Jan-2035	34.142	0,05
10.000	Campbell Soup Co 3.300% 19-Mar-2025	9.766	0,01
10.000	Campbell Soup Co 4.150% 15-Mar-2028	9.811	0,01
50.000	Campbell Soup Co 4.800% 15-Mar-2048	45.825	0,06
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.250% 28-Jan-2025	19.384	0,03
5.000	Canadian Natural Resources Ltd 3.850% 01-Jun-2027	4.864	0,01
10.000	Canadian Natural Resources Ltd 3.900% 01-Feb-2025	9.847	0,01
20.000	Canadian Natural Resources Ltd 6.250% 15-Mar-2038	21.015	0,03
10.000	Canadian Natural Resources Ltd 'GMTN' 4.950% 01-Jun-2047	9.088	0,01
20.000	Canadian Pacific Railway Co 3.100% 02-Dec-2051	14.537	0,02
15.000	Canadian Pacific Railway Co 6.125% 15-Sep-2115	16.861	0,02
50.000	Cantor Fitzgerald LP '144A' 7.200% 12-Dec-2028	51.363	0,07
10.000	Capital One Financial Corp 3.200% 05-Feb-2025	9.767	0,01
10.000	Capital One Financial Corp 3.750% 09-Mar-2027	9.560	0,01
60.000	Capital One Financial Corp 3.800% 31-Jan-2028	57.060	0,08
10.000	Capital One Financial Corp 4.200% 29-Oct-2025	9.814	0,01
20.000	Capital One Financial Corp FRN 3.273% 01-Mar-2030	17.897	0,02
20.000	Capital One Financial Corp FRN 4.985% 24-Jul-2026	19.783	0,03
10.000	Capital One Financial Corp FRN 5.817% 01-Feb-2034	9.975	0,01
20.000	Capital One Financial Corp FRN 6.312% 08-Jun-2029	20.555	0,03
20.000	Capital One Financial Corp FRN 6.377% 08-Jun-2034	20.628	0,03
30.000	Capital One Financial Corp FRN 7.624% 30-Oct-2031	33.043	0,04
10.000	Cardinal Health Inc 3.410% 15-Jun-2027	9.608	0,01
15.000	Cardinal Health Inc 3.750% 15-Sep-2025	14.670	0,02
10.000	Cardinal Health Inc 4.900% 15-Sep-2045	9.174	0,01
10.000	Cargill Inc '144A' 2.125% 23-Apr-2030	8.715	0,01
10.000	Cargill Inc '144A' 3.625% 22-Apr-2027	9.742	0,01
10.000	Cargill Inc '144A' 4.000% 22-Jun-2032	9.530	0,01
50.000	Cargill Inc '144A' 5.125% 11-Oct-2032	51.455	0,07
5.000	Carlisle Cos Inc 2.750% 01-Mar-2030	4.439	0,01
50.000	Carrier Global Corp 2.242% 15-Feb-2025	48.495	0,07
5.000	Carrier Global Corp 2.700% 15-Feb-2031	4.379	0,01
5.000	Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030	4.482	0,01
10.000	Carrier Global Corp 3.377% 05-Apr-2040	8.058	0,01
15.000	Carrier Global Corp 3.577% 05-Apr-2050	11.758	0,02
10.000	Caterpillar Inc 4.750% 15-May-2064	9.734	0,01
10.000	Choe Global Markets Inc 3.650% 12-Jan-2027	9.712	0,01
50.000	CBRE Services Inc 2.500% 01-Apr-2031	42.419	0,06
20.000	CBRE Services Inc 4.875% 01-Mar-2026	20.002	0,03
20.000	CBRE Services Inc 5.950% 15-Aug-2034	20.997	0,03
10.000	CCL Industries Inc '144A' 3.050% 01-Jun-2030	8.791	0,01
10.000	CCL Industries Inc '144A' 3.250% 01-Oct-2026	9.491	0,01
20.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 2.670% 01-Dec-2026	18.720	0,03
10.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 3.250% 15-Feb-2029	9.155	0,01
5.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 4.125% 01-May-2025	4.898	0,01
3.000	Celanese US Holdings LLC 6.050% 15-Mar-2025	3.021	0,00
40.000	Celanese US Holdings LLC 6.165% 15-Jul-2027	41.035	0,06
20.000	Celanese US Holdings LLC 6.330% 15-Jul-2029	20.999	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Celanese US Holdings LLC 6.379% 15-Jul-2032	10.583	0,01
50.000	Celanese US Holdings LLC 6.550% 15-Nov-2030	52.991	0,07
10.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 3.875% 02-Nov-2027	9.367	0,01
5.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 5.500% 02-Nov-2047	4.324	0,01
10.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 4.200% 29-Jan-2030	9.248	0,01
10.000	Cencora Inc 2.700% 15-Mar-2031	8.790	0,01
20.000	Cencosud SA 'REGS' 4.375% 17-Jul-2027	19.309	0,03
5.000	Cencosud SA 'REGS' 6.625% 12-Feb-2045	5.081	0,01
15.000	Cenovus Energy Inc 3.750% 15-Feb-2052	11.095	0,02
6.000	Cenovus Energy Inc 6.750% 15-Nov-2039	6.573	0,01
20.000	Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028	17.862	0,02
30.000	Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031	25.028	0,03
10.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	8.981	0,01
40.000	Centene Corp 4.250% 15-Dec-2027	38.588	0,05
35.000	Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	33.602	0,05
10.000	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 4.450% 01-Oct-2032	9.858	0,01
10.000	CenterPoint Energy Resources Corp 1.750% 01-Oct-2030	8.320	0,01
10.000	CenterPoint Energy Resources Corp 4.000% 01-Apr-2028	9.755	0,01
10.000	CF Industries Inc 4.950% 01-Jun-2043	9.200	0,01
15.000	CGI Inc 1.450% 14-Sep-2026	13.594	0,02
20.000	Charles Schwab Corp/The 1.150% 13-May-2026	18.330	0,02
10.000	Charles Schwab Corp/The 1.950% 01-Dec-2031	8.034	0,01
30.000	Charles Schwab Corp/The 2.450% 03-Mar-2027	27.960	0,04
10.000	Charles Schwab Corp/The 3.000% 10-Mar-2025	9.752	0,01
10.000	Charles Schwab Corp/The 3.200% 25-Jan-2028	9.454	0,01
15.000	Charles Schwab Corp/The 3.250% 22-May-2029	14.094	0,02
10.000	Charles Schwab Corp/The FRN 5.853% 19-May-2034	10.342	0,01
20.000	Charles Schwab Corp/The FRN 6.136% 24-Aug-2034	21.085	0,03
50.000	Charles Schwab Corp/The FRN 6.196% 17-Nov-2029	52.512	0,07
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.800% 01-Apr-2031	16.912	0,02
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.500% 01-Jun-2041	14.196	0,02
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.200% 15-Mar-2028	19.236	0,03
30.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.400% 01-Dec-2061	20.852	0,03
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.800% 01-Mar-2050	7.763	0,01
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.125% 01-Jul-2049	16.313	0,02
40.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.250% 01-Apr-2053	33.703	0,05
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 01-Apr-2038	18.148	0,02
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 01-May-2047	8.541	0,01
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.500% 01-Apr-2063	8.387	0,01
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.384% 23-Oct-2035	20.365	0,03
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 23-Oct-2045	19.738	0,03
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.650% 01-Feb-2034	21.148	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3.700% 15-Nov-2029	9.458	0,01
20.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30-Jun-2027	20.125	0,03
30.000	Cheniere Energy Partners LP '144A' 5.950% 30-Jun-2033	30.815	0,04
10.000	Chevron Corp 1.995% 11-May-2027	9.294	0,01
20.000	Chevron Corp 2.236% 11-May-2030	17.755	0,02
30.000	Chevron USA Inc 6.000% 01-Mar-2041	34.203	0,05
10.000	Choice Hotels International Inc 3.700% 15-Jan-2031	8.641	0,01
20.000	Chubb Corp/The 6.000% 11-May-2037	22.206	0,03
10.000	Chubb INA Holdings Inc 3.050% 15-Dec-2061	7.204	0,01
10.000	Chubb INA Holdings Inc 3.350% 03-May-2026	9.721	0,01
5.000	CI Financial Corp 3.200% 17-Dec-2030	3.961	0,01
20.000	CI Financial Corp 4.100% 15-Jun-2051	11.884	0,02
20.000	Cigna Group/The 2.375% 15-Mar-2031	17.128	0,02
10.000	Cigna Group/The 2.400% 15-Mar-2030	8.773	0,01
30.000	Cigna Group/The 3.400% 01-Mar-2027	28.937	0,04
20.000	Cigna Group/The 3.400% 15-Mar-2051	14.875	0,02
5.000	Cigna Group/The 3.875% 15-Oct-2047	4.091	0,01
20.000	Cigna Group/The 4.125% 15-Nov-2025	19.753	0,03
15.000	Cigna Group/The 4.800% 15-Aug-2038	14.554	0,02
10.000	Cigna Group/The 4.800% 15-Jul-2046	9.351	0,01
10.000	Cigna Group/The 4.900% 15-Dec-2048	9.527	0,01
30.000	Cigna Group/The 5.400% 15-Mar-2033	31.268	0,04
50.000	Cincinnati Financial Corp 6.920% 15-May-2028	53.745	0,07
15.000	Cintas Corp No 2 3.700% 01-Apr-2027	14.679	0,02
10.000	Cisco Systems Inc 5.500% 15-Jan-2040	10.687	0,01
10.000	Cisco Systems Inc 5.900% 15-Feb-2039	11.132	0,02
10.000	Citadel Finance LLC '144A' 3.375% 09-Mar-2026	9.273	0,01
10.000	Citigroup Inc 4.125% 25-Jul-2028	9.616	0,01
20.000	Citigroup Inc 4.400% 10-Jun-2025	19.763	0,03
50.000	Citigroup Inc 4.450% 29-Sep-2027	48.863	0,07
10.000	Citigroup Inc 4.600% 09-Mar-2026	9.880	0,01
20.000	Citigroup Inc 5.300% 06-May-2044	19.285	0,03
10.000	Citigroup Inc 6.125% 25-Aug-2036	10.702	0,01
45.000	Citigroup Inc FRN 1.122% 28-Jan-2027	41.376	0,06
10.000	Citigroup Inc FRN 2.014% 25-Jan-2026	9.615	0,01
50.000	Citigroup Inc FRN 2.520% 03-Nov-2032	41.316	0,06
15.000	Citigroup Inc FRN 2.561% 01-May-2032	12.541	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 2.666% 29-Jan-2031	8.692	0,01
10.000	Citigroup Inc FRN 3.070% 24-Feb-2028	9.433	0,01
50.000	Citigroup Inc FRN 3.290% 17-Mar-2026	48.708	0,07
60.000	Citigroup Inc FRN 3.520% 27-Oct-2028	56.829	0,08
25.000	Citigroup Inc FRN 3.785% 17-Mar-2033	22.534	0,03
30.000	Citigroup Inc FRN 3.887% 10-Jan-2028	29.053	0,04
30.000	Citigroup Inc FRN 3.980% 20-Mar-2030	28.506	0,04
10.000	Citigroup Inc FRN 4.075% 23-Apr-2029	9.642	0,01
30.000	Citigroup Inc FRN 4.412% 31-Mar-2031	28.757	0,04
20.000	Citigroup Inc FRN 4.658% 24-May-2028	19.884	0,03
45.000	Citigroup Inc FRN 5.316% 26-Mar-2041	45.317	0,06
15.000	Citigroup Inc FRN 5.610% 29-Sep-2026	15.124	0,02
28.000	Citigroup Inc FRN 6.174% 25-May-2034	29.036	0,04
20.000	Citizens Bank NA/Providence RI 'BKNT' 2.250% 28-Apr-2025	19.133	0,03
5.000	CK Hutchison International 16 Ltd '144A' 2.750% 03-Oct-2026	4.725	0,01
10.000	CK Hutchison International 21 Ltd '144A' 1.500% 15-Apr-2026	9.268	0,01
20.000	CK Hutchison International 21 Ltd '144A' 3.125% 15-Apr-2041	15.771	0,02
40.000	CK Hutchison International 23 Ltd '144A' 4.875% 21-Apr-2033	40.162	0,05
5.000	Claremont McKenna College 3.775% 01-Jan-2122	3.432	0,00
5.000	Cleveland Electric Illuminating Co/The 5.950% 15-Dec-2036	5.132	0,01
10.000	CMS Energy Corp FRN 4.750% 01-Jun-2050	9.056	0,01
20.000	CNH Industrial Capital LLC 4.550% 10-Apr-2028	19.761	0,03
20.000	CNO Global Funding '144A' 2.650% 06-Jan-2029	17.369	0,02
10.000	Coca-Cola Co/The 1.650% 01-Jun-2030	8.582	0,01
10.000	Coca-Cola Co/The 2.500% 01-Jun-2040	7.592	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Coca-Cola Co/The 2.750% 01-Jun-2060	3.481	0,00
20.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV 2.750% 22-Jan-2030	17.937	0,02
10.000	Colgate-Palmolive Co 4.600% 01-Mar-2033	10.311	0,01
5.000	Colonial Enterprises Inc '144A' 3.250% 15-May-2030	4.552	0,01
10.000	Colonial Pipeline Co '144A' 3.750% 01-Oct-2025	9.703	0,01
10.000	Colonial Pipeline Co '144A' 7.630% 15-Apr-2032	11.549	0,02
10.000	Columbia Pipeline Group Inc 4.500% 01-Jun-2025	9.883	0,01
20.000	Columbia Pipelines Operating Co LLC '144A' 6.544% 15-Nov-2053	22.146	0,03
10.000	Comcast Corp 1.500% 15-Feb-2031	8.210	0,01
100.000	Comcast Corp 2.937% 01-Nov-2056	66.174	0,09
30.000	Comcast Corp 2.987% 01-Nov-2063	19.465	0,03
20.000	Comcast Corp 3.150% 15-Feb-2028	19.090	0,03
30.000	Comcast Corp 3.300% 01-Feb-2027	28.977	0,04
40.000	Comcast Corp 4.150% 15-Oct-2028	39.512	0,05
50.000	Comcast Corp 4.200% 15-Aug-2034	47.949	0,06
50.000	Comcast Corp 4.250% 15-Jan-2033	48.702	0,07
20.000	Comcast Corp 4.650% 15-Jul-2042	18.858	0,03
35.000	Comcast Corp 4.950% 15-Oct-2058	34.492	0,05
10.000	Comcast Corp 5.500% 15-May-2064	10.585	0,01
20.000	Comcast Corp 6.550% 01-Jul-2039	22.942	0,03
8.020	Cometa Energia SA de CV 'REGS' 6.375% 24-Apr-2035	7.784	0,01
10.000	CommonSpirit Health 3.347% 01-Oct-2029	9.147	0,01
10.000	CommonSpirit Health 4.350% 01-Nov-2042	8.687	0,01
10.000	CommonSpirit Health 6.073% 01-Nov-2027	10.302	0,01
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 1.875% 15-Sep-2031	8.150	0,01
5.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.625% 06-Sep-2026	4.745	0,01
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.688% 11-Mar-2031	8.246	0,01
35.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.150% 19-Sep-2027	33.201	0,04
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.305% 11-Mar-2041	7.285	0,01
20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.743% 12-Sep-2039	15.788	0,02
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.900% 16-Mar-2028	9.748	0,01
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' FRN 3.610% 12-Sep-2034	8.945	0,01
20.000	Commonwealth Edison Co 3.150% 15-Mar-2032	17.872	0,02
40.000	Conagra Brands Inc 1.375% 01-Nov-2027	35.143	0,05
20.000	Conagra Brands Inc 4.600% 01-Nov-2025	19.820	0,03
10.000	Conagra Brands Inc 4.850% 01-Nov-2028	10.004	0,01
5.000	Conagra Brands Inc 5.300% 01-Nov-2038	4.913	0,01
5.000	Conagra Brands Inc 5.400% 01-Nov-2048	4.863	0,01
10.000	Concentrix Corp 6.600% 02-Aug-2028	10.302	0,01
10.000	Concentrix Corp 6.650% 02-Aug-2026	10.259	0,01
10.000	Concentrix Corp 6.850% 02-Aug-2033	10.309	0,01
10.000	Connecticut Light and Power Co/The 2.050% 01-Jul-2031	8.320	0,01
10.000	Connecticut Light and Power Co/The 3.200% 15-Mar-2027	9.625	0,01
50.000	Conoco Funding Co 7.250% 15-Oct-2031	57.795	0,08
10.000	ConocoPhillips 5.900% 15-May-2038	10.824	0,01
10.000	ConocoPhillips 6.500% 01-Feb-2039	11.608	0,02
15.000	ConocoPhillips Co 4.025% 15-Mar-2062	12.257	0,02
10.000	ConocoPhillips Co 5.550% 15-Mar-2054	10.671	0,01
10.000	ConocoPhillips Co 5.700% 15-Sep-2063	10.891	0,01
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 2.400% 15-Jun-2031	8.650	0,01
15.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.125% 15-Nov-2027	14.331	0,02
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.600% 15-Jun-2061	7.553	0,01
60.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 4.200% 15-Mar-2042	52.220	0,07
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 4.625% 01-Dec-2054	9.048	0,01
40.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 15-Mar-2034	42.078	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 01-Dec-2039	10.140	0,01
20.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.900% 15-Nov-2053	22.128	0,03
30.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 6.300% 15-Aug-2037	33.001	0,04
40.000	Constellation Brands Inc 2.250% 01-Aug-2031	33.685	0,05
10.000	Constellation Brands Inc 3.150% 01-Aug-2029	9.310	0,01
20.000	Constellation Brands Inc 3.600% 15-Feb-2028	19.228	0,03
30.000	Constellation Brands Inc 3.700% 06-Dec-2026	29.252	0,04
5.000	Constellation Energy Generation LLC 5.600% 15-Jun-2042	5.019	0,01
10.000	Constellation Energy Generation LLC 6.250% 01-Oct-2039	10.745	0,01
3.000	Consumers Energy Co 2.500% 01-May-2060	1.846	0,00
20.000	Continental Resources Inc/OK 4.375% 15-Jan-2028	19.398	0,03
25.000	Continental Resources Inc/OK '144A' 5.750% 15-Jan-2031	24.872	0,03
15.000	Coöperatieve Rabobank UA 4.375% 04-Aug-2025	14.742	0,02
20.000	Coöperatieve Rabobank UA 5.250% 04-Aug-2045	19.984	0,03
20.000	Coöperatieve Rabobank UA '144A' FRN 1.106% 24-Feb-2027	18.332	0,02
50.000	Coöperatieve Rabobank UA '144A' FRN 3.649% 06-Apr-2028	47.723	0,06
50.000	Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 3.750% 21-Jul-2026	47.932	0,06
5.000	Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 5.250% 24-May-2041	5.298	0,01
52.000	Corebridge Financial Inc 5.750% 15-Jan-2034	53.449	0,07
5.000	Corning Inc 4.750% 15-Mar-2042	4.690	0,01
10.000	Corning Inc 5.450% 15-Nov-2079	9.713	0,01
5.000	Corning Inc 5.750% 15-Aug-2040	5.152	0,01
10.000	Corning Inc 5.850% 15-Nov-2068	10.028	0,01
20.000	Corn Inmobiliaria Vesta SAB de CV 'REGS' 3.625% 13-May-2031	17.198	0,02
8.000	Costco Wholesale Corp 1.600% 20-Apr-2030	6.868	0,01
10.000	Costco Wholesale Corp 1.750% 20-Apr-2032	8.377	0,01
20.000	Coterra Energy Inc 3.900% 15-May-2027	19.375	0,03
10.000	Cox Communications Inc '144A' 2.600% 15-Jun-2031	8.492	0,01
10.000	Cox Communications Inc '144A' 3.500% 15-Aug-2027	9.531	0,01
10.000	Cox Communications Inc '144A' 3.600% 15-Jun-2051	7.321	0,01
10.000	Crane Holdings Co 4.200% 15-Mar-2048	7.522	0,01
20.000	Credicorp Ltd 'REGS' 2.750% 17-Jun-2025	19.086	0,03
5.000	Credit Agricole SA '144A' 3.250% 14-Jan-2030	4.425	0,01
15.000	Credit Agricole SA '144A' 4.375% 17-Mar-2025	14.765	0,02
20.000	Credit Agricole SA '144A' 5.514% 05-Jul-2033	20.787	0,03
10.000	Credit Agricole SA '144A' 5.589% 05-Jul-2026	10.180	0,01
10.000	Credit Agricole SA '144A' FRN 4.000% 10-Jan-2033	9.281	0,01
20.000	Credit Agricole SA '144A' FRN 6.316% 03-Oct-2029	20.999	0,03
20.000	Credit Agricole SA/London '144A' 2.375% 22-Jan-2025	19.375	0,03
20.000	Credit Agricole SA/London '144A' FRN 1.907% 16-Jun-2026	18.988	0,03
50.000	Credit Suisse AG/New York NY 1.250% 07-Aug-2026	45.367	0,06
35.000	Credit Suisse AG/New York NY 'MTN' 3.700% 21-Feb-2025	34.313	0,05
10.000	CRH America Finance Inc '144A' 3.400% 09-May-2027	9.582	0,01
10.000	CRH America Finance Inc '144A' 4.400% 09-May-2047	9.020	0,01
50.000	CRH America Inc '144A' 3.875% 18-May-2025	48.966	0,07
20.000	Crown Castle Inc 1.050% 15-Jul-2026	18.063	0,02
25.000	Crown Castle Inc 2.100% 01-Apr-2031	20.398	0,03
10.000	Crown Castle Inc 2.250% 15-Jan-2031	8.298	0,01
20.000	Crown Castle Inc 2.900% 15-Mar-2027	18.723	0,03
10.000	Crown Castle Inc 2.900% 01-Apr-2041	7.176	0,01
15.000	Crown Castle Inc 4.150% 01-Jul-2050	12.172	0,02
50.000	Crown Castle Inc 5.800% 01-Mar-2034	51.898	0,07
10.000	CSL Finance Plc '144A' 4.250% 27-Apr-2032	9.772	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	CSL Finance Plc '144A' 4.625% 27-Apr-2042	4.781	0,01
10.000	CSX Corp 4.300% 01-Mar-2048	8.957	0,01
20.000	CSX Corp 4.500% 15-Nov-2052	18.667	0,03
10.000	CSX Corp 4.650% 01-Mar-2068	9.238	0,01
10.000	CSX Corp 6.000 % 01-Oct-2036	11.027	0,02
20.000	CSX Corp 6.220% 30-Apr-2040	22.598	0,03
10.000	CubeSmart LP 2.500% 15-Feb-2032	8.329	0,01
40.000	CVS Health Corp 1.300% 21-Aug-2027	35.574	0,05
20.000	CVS Health Corp 1.875% 28-Feb-2031	16.496	0,02
10.000	CVS Health Corp 2.875% 01-Jun-2026	9.558	0,01
45.000	CVS Health Corp 3.250% 15-Aug-2029	41.978	0,06
50.000	CVS Health Corp 4.250% 01-Apr-2050	41.987	0,06
30.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	29.545	0,04
10.000	CVS Health Corp 4.780% 25-Mar-2038	9.505	0,01
30.000	CVS Health Corp 5.125% 20-Jul-2045	28.510	0,04
30.000	CVS Health Corp 5.250% 21-Feb-2033	30.733	0,04
20.000	CVS Health Corp 5.625% 21-Feb-2053	20.388	0,03
33.000	CVS Health Corp 5.875% 01-Jun-2053	34.880	0,05
30.000	CVS Health Corp 6.125% 15-Sep-2039	31.992	0,04
20.000	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The '144A' FRN (Perpetual) 4.000% 24-Jul-2026	19.187	0,03
40.000	Daimler Truck Finance North America LLC '144A' 2.000% 14-Dec-2026	36.804	0,05
10.000	Daimler Truck Finance North America LLC '144A' 5.200% 17-Jan-2025	10.002	0,01
10.000	Daimler Truck Finance North America LLC '144A' 5.500% 20-Sep-2033	10.217	0,01
50.000	Danske Bank A/S '144A' FRN 1.549% 10-Sep-2027	45.158	0,06
20.000	Danske Bank A/S '144A' FRN 1.621% 11-Sep-2026	18.679	0,03
15.000	Danske Bank A/S '144A' FRN 4.298% 01-Apr-2028	14.558	0,02
20.000	Darden Restaurants Inc 6.300% 10-Oct-2033	21.553	0,03
10.000	DBS Group Holdings Ltd '144A' 1.194% 15-Mar-2027	9.011	0,01
10.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037	11.033	0,02
10.000	Deere & Co 3.900% 09-Jun-2042	9.028	0,01
50.000	Delmarva Power & Light Co 4.150% 15-May-2045	41.888	0,06
10.000	Denso Corp '144A' 1.239% 16-Sep-2026	9.078	0,01
5.000	DENTSPLY SIRONA Inc 3.250% 01-Jun-2030	4.430	0,01
10.000	Deutsche Telekom AG '144A' 3.625% 21-Jan-2050	8.047	0,01
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 8.750% 15-Jun-2030	12.079	0,02
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 9.250% 01-Jun-2032	12.990	0,02
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 4.750% 21-Jun-2038	9.727	0,01
10.000	Devon Energy Corp 4.750% 15-May-2042	8.783	0,01
10.000	Devon Energy Corp 5.000% 15-Jun-2045	8.878	0,01
5.000	Diageo Capital Plc 2.375% 24-Oct-2029	4.501	0,01
20.000	Diageo Capital Plc 5.625% 05-Oct-2033	21.620	0,03
10.000	Diageo Investment Corp 7.450% 15-Apr-2035	12.215	0,02
10.000	Diamondback Energy Inc 3.250% 01-Dec-2026	9.702	0,01
10.000	Diamondback Energy Inc 6.250% 15-Mar-2053	10.721	0,01
10.000	Dick's Sporting Goods Inc 4.100% 15-Jan-2052	7.171	0,01
20.000	Digital Realty Trust LP 5.550% 15-Jan-2028	20.382	0,03
10.000	Discover Bank 'BKNT' 3.450% 27-Jul-2026	9.463	0,01
5.000	Discover Bank 'BKNT' 4.650% 13-Sep-2028	4.774	0,01
10.000	Discover Financial Services 3.950% 06-Nov-2024	9.832	0,01
10.000	Discover Financial Services 4.100% 09-Feb-2027	9.607	0,01
20.000	Discover Financial Services 6.700% 29-Nov-2032	20.997	0,03
10.000	Discovery Communications LLC 5.000% 20-Sep-2037	8.965	0,01
8.000	Discovery Communications LLC 5.200% 20-Sep-2047	6.926	0,01
20.000	Discovery Communications LLC 5.300% 15-May-2049	17.254	0,02
20.000	DNB Bank ASA '144A' FRN 1.127% 16-Sep-2026	18.568	0,03
5.000	Dollar General Corp 3.875% 15-Apr-2027	4.852	0,01
5.000	Dollar General Corp 4.125% 03-Apr-2050	3.982	0,01
10.000	Dollar Tree Inc 3.375% 01-Dec-2051	6.970	0,01
20.000	Dollar Tree Inc 4.200% 15-May-2028	19.600	0,03
10.000	Dominion Energy Inc 3.600% 15-Mar-2027	9.622	0,01
20.000	Dominion Energy Inc 7.000% 15-Jun-2038	22.652	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc 5.100% 01-Jun-2065	9.510	0,01
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc 6.050% 15-Jan-2038	10.875	0,01
10.000	Dow Chemical Co/The 4.250% 01-Oct-2034	9.608	0,01
10.000	Dow Chemical Co/The 4.375% 15-Nov-2042	8.881	0,01
5.000	Dow Chemical Co/The 4.625% 01-Oct-2044	4.610	0,01
10.000	Dow Chemical Co/The 4.800% 15-May-2049	9.220	0,01
5.000	Dow Chemical Co/The 5.250% 15-Nov-2041	4.936	0,01
2.000	DTE Energy Co 3.400% 15-Jun-2029	1.873	0,00
50.000	Duke Energy Carolinas LLC 3.950% 15-Nov-2028	49.235	0,07
10.000	Duke Energy Carolinas LLC 5.300% 15-Feb-2040	10.147	0,01
15.000	Duke Energy Corp 2.550% 15-Jun-2031	12.831	0,02
10.000	Duke Energy Corp 2.650% 01-Sep-2026	9.502	0,01
10.000	Duke Energy Corp 3.150% 15-Aug-2027	9.466	0,01
10.000	Duke Energy Corp 3.300% 15-Jun-2041	7.694	0,01
10.000	Duke Energy Corp 3.750% 01-Sep-2046	7.762	0,01
50.000	Duke Energy Corp 4.300% 15-Mar-2028	49.382	0,07
10.000	Duke Energy Corp 4.800% 15-Dec-2045	9.158	0,01
85.000	Duke Energy Florida LLC 2.500% 01-Dec-2029	75.957	0,10
50.000	Duke Energy Florida LLC 6.400% 15-Jun-2038	56.186	0,08
30.000	Duke Energy Progress LLC 2.000% 15-Aug-2031	24.853	0,03
20.000	Duke Energy Progress LLC 3.700% 15-Oct-2046	15.774	0,02
5.000	E.ON International Finance BV '144A' 6.650% 30-Apr-2038	5.568	0,01
10.000	Eagle Materials Inc 2.500% 01-Jul-2031	8.518	0,01
10.000	East Ohio Gas Co/The '144A' 1.300% 15-Jun-2025	9.461	0,01
10.000	Eastern Gas Transmission & Storage Inc 3.000% 15-Nov-2029	9.004	0,01
25.000	Eastman Chemical Co 3.800% 15-Mar-2025	24.574	0,03
50.000	Eastman Chemical Co 4.500% 01-Dec-2028	48.962	0,07
10.000	Eastman Chemical Co 4.650% 15-Oct-2044	8.833	0,01
10.000	Eaton Corp 4.150% 15-Mar-2033	9.804	0,01
10.000	Eaton Corp 4.150% 02-Nov-2042	9.215	0,01
10.000	eBay Inc 2.700% 11-Mar-2030	8.912	0,01
5.000	eBay Inc 3.650% 10-May-2051	3.822	0,01
5.000	eBay Inc 4.000% 15-Jul-2042	4.178	0,01
30.000	Ecolab Inc 2.125% 01-Feb-2032	25.598	0,03
10.000	Ecolab Inc 5.500% 08-Dec-2041	10.525	0,01
15.000	Edison International 4.125% 15-Mar-2028	14.511	0,02
10.000	Edison International 4.700% 15-Aug-2025	9.884	0,01
10.000	Edison International 4.950% 15-Apr-2025	9.940	0,01
10.000	Edison International 5.750% 15-Jun-2027	10.227	0,01
20.000	EDP Finance BV '144A' 1.710% 24-Jan-2028	17.800	0,02
20.000	EIDP Inc 4.800 % 15-May-2033	20.262	0,03
10.000	El Puerto de Liverpool SAB de CV 'REGS' 3.875% 06-Oct-2026	9.636	0,01
15.000	Electronic Arts Inc 1.850% 15-Feb-2031	12.547	0,02
10.000	Element Fleet Management Corp '144A' 3.850% 15-Jun-2025	9.727	0,01
20.000	Element Fleet Management Corp '144A' 6.271% 26-Jun-2026	20.389	0,03
20.000	Element Fleet Management Corp '144A' 6.319% 04-Dec-2028	20.654	0,03
10.000	Elevance Health Inc 3.650% 01-Dec-2027	9.693	0,01
20.000	Elevance Health Inc 4.101% 01-Mar-2028	19.693	0,03
10.000	Elevance Health Inc 4.375% 01-Dec-2047	9.859	0,01
10.000	Elevance Health Inc 4.550% 01-Mar-2048	9.161	0,01
5.000	Elevance Health Inc 4.650% 15-Jan-2043	4.638	0,01
20.000	Elevance Health Inc 5.500% 15-Oct-2032	20.958	0,03
10.000	Elevance Health Inc 6.100% 15-Oct-2052	11.353	0,02
10.000	Eli Lilly & Co 4.150% 15-Mar-2059	9.167	0,01
10.000	EMD Finance LLC '144A' 3.250% 19-Mar-2025	9.769	0,01
1.000	Emera US Finance LP 3.550% 15-Jun-2026	964	0,00
20.000	Emera US Finance LP 4.750% 15-Jun-2046	16.567	0,02
10.000	Emerson Electric Co 1.800% 15-Oct-2027	9.140	0,01
15.000	Emerson Electric Co 2.200% 21-Dec-2031	12.850	0,02
50.000	Empower Finance 2020 LP '144A' 1.776% 17-Mar-2031	40.420	0,05
10.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	7.989	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 4.750% 01-Aug-2026	9.827	0,01
10.000	ENA Master Trust 'REGS' 4.000% 19-May-2048	7.027	0,01
15.000	Enbridge Energy Partners LP 5.875% 15-Oct-2025	15.169	0,02
10.000	Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15-Oct-2045	11.820	0,02
10.000	Enbridge Energy Partners LP 7.500% 15-Apr-2038	11.689	0,02
5.000	Enbridge Inc 4.500% 10-Jun-2044	4.298	0,01
30.000	Enbridge Inc 5.700% 08-Mar-2033	31.258	0,04
20.000	Enbridge Inc 6.700% 15-Nov-2053	23.379	0,03
10.000	Enel Finance America LLC '144A' 7.100% 14-Oct-2027	10.685	0,01
20.000	Enel Finance International NV '144A' 1.375% 12-Jul-2026	18.235	0,02
10.000	Enel Finance International NV '144A' 1.875% 12-Jul-2028	8.749	0,01
5.000	Enel Finance International NV '144A' 2.250% 12-Jul-2031	4.074	0,01
20.000	Enel Finance International NV '144A' 3.625% 25-May-2027	19.119	0,03
15.000	Enel Finance International NV '144A' 4.625% 15-Jun-2027	14.867	0,02
10.000	Enel Finance International NV '144A' 4.750% 25-May-2047	8.757	0,01
30.000	Enel Finance International NV '144A' 4.875% 14-Jun-2029	29.802	0,04
20.000	Enel Finance International NV '144A' 6.000% 07-Oct-2039	20.427	0,03
50.000	Enel Finance International NV '144A' 6.800% 14-Oct-2025	51.294	0,07
10.000	Energy Transfer LP 3.900% 15-Jul-2026	9.727	0,01
10.000	Energy Transfer LP 4.950% 15-Jun-2028	9.980	0,01
10.000	Energy Transfer LP 5.000% 15-May-2050	8.975	0,01
25.000	Energy Transfer LP 5.150% 01-Feb-2043	22.362	0,03
20.000	Energy Transfer LP 5.250% 15-Apr-2029	20.188	0,03
40.000	Energy Transfer LP 5.500% 01-Jun-2027	40.545	0,05
10.000	Energy Transfer LP 5.550% 15-Feb-2028	10.207	0,01
20.000	Energy Transfer LP 6.125% 15-Dec-2045	20.244	0,03
20.000	Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049	20.777	0,03
46.000	Energy Transfer LP 6.400% 01-Dec-2030	49.235	0,07
10.000	Energy Transfer LP 6.500% 01-Feb-2042	10.612	0,01
10.000	Energy Transfer LP 6.550% 01-Dec-2033	10.867	0,01
10.000	Energy Transfer LP 7.500% 01-Jul-2038	11.627	0,02
20.000	Engie Energia Chile SA 'REGS' 3.400% 28-Jan-2030	17.232	0,02
10.000	Eni SpA '144A' 4.750% 12-Sep-2028	10.016	0,01
5.000	Eni SpA '144A' 5.700% 01-Oct-2040	4.880	0,01
5.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS' 4.625% 17-May-2027	4.963	0,01
20.000	Enstar Group Ltd 3.100% 01-Sep-2031	16.361	0,02
20.000	Enstar Group Ltd 4.950% 01-Jun-2029	19.543	0,03
10.000	Entegris Escrow Corp '144A' 4.750% 15-Apr-2029	9.642	0,01
15.000	Entergy Corp 2.950% 01-Sep-2026	14.260	0,02
10.000	Entergy Louisiana LLC 2.350% 15-Jun-2032	8.341	0,01
10.000	Entergy Louisiana LLC 3.100% 15-Jun-2041	7.597	0,01
50.000	Entergy Louisiana LLC 3.250% 01-Apr-2028	47.095	0,06
10.000	Entergy Louisiana LLC 4.000% 15-Mar-2033	9.341	0,01
10.000	Entergy Mississippi LLC 5.000% 01-Sep-2033	10.104	0,01
10.000	Enterprise Products Operating LLC 3.950% 15-Feb-2027	9.852	0,01
20.000	Enterprise Products Operating LLC 3.950% 31-Jan-2060	16.313	0,02
50.000	Enterprise Products Operating LLC 5.950% 01-Feb-2041	53.837	0,07
10.000	Enterprise Products Operating LLC 6.125% 15-Oct-2039	10.964	0,01
10.000	Enterprise Products Operating LLC 7.550% 15-Apr-2038	12.289	0,02
20.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.250% 16-Aug-2077	19.169	0,03
10.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.375% 15-Feb-2078	8.987	0,01
10.000	EPR Properties 3.600% 15-Nov-2031	8.317	0,01
10.000	EPR Properties 3.750% 15-Aug-2029	8.820	0,01
10.000	EPR Properties 4.750% 15-Dec-2026	9.578	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
30.000	EQT Corp 3.900% 01-Oct-2027	28.748	0,04
10.000	Equifax Inc 2.600% 01-Dec-2024	9.740	0,01
10.000	Equifax Inc 3.100% 15-May-2030	8.964	0,01
50.000	Equifax Inc 5.100% 01-Jun-2028	50.516	0,07
50.000	Equinix Inc 1.000% 15-Sep-2025	46.671	0,06
30.000	Equinix Inc 1.450% 15-May-2026	27.741	0,04
30.000	Equinix Inc 1.800% 15-Jul-2027	27.208	0,04
10.000	Equinix Inc 2.500% 15-May-2031	8.506	0,01
10.000	Equinix Inc 3.200% 18-Nov-2029	9.207	0,01
30.000	Equinix Inc 3.900% 15-Apr-2032	27.927	0,04
20.000	Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1.300% 12-Jul-2026	18.049	0,02
20.000	Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1.400% 07-Jul-2025	18.936	0,03
20.000	Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1.800% 08-Mar-2028	17.566	0,02
10.000	Equitable Holdings Inc 4.350% 20-Apr-2028	9.679	0,01
10.000	Equitable Holdings Inc 5.000% 20-Apr-2048	9.340	0,01
10.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 3.300% 01-Dec-2026	9.585	0,01
10.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 4.200% 01-Nov-2046	8.779	0,01
10.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 4.900% 01-May-2033	10.015	0,01
20.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 6.700% 01-Jun-2034	22.634	0,03
10.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 7.000% 15-Oct-2037	11.726	0,02
10.000	ERP Operating LP 2.850% 01-Nov-2026	9.508	0,01
30.000	ERP Operating LP 4.150% 01-Dec-2028	29.481	0,04
20.000	Essential Utilities Inc 2.704% 15-Apr-2030	17.522	0,02
10.000	Essential Utilities Inc 3.351% 15-Apr-2050	7.113	0,01
10.000	Essex Portfolio LP 1.700% 01-Mar-2028	8.762	0,01
10.000	Essex Portfolio LP 2.650% 01-Sep-2050	6.082	0,01
10.000	Estee Lauder Cos Inc/The 4.375% 15-Jun-2045	9.110	0,01
20.000	Everest Reinsurance Holdings Inc 3.500% 15-Oct-2050	14.807	0,02
10.000	Evergy Inc 2.900% 15-Sep-2029	9.065	0,01
100.000	Evergy Kansas Central Inc 2.550% 01-Jul-2026	94.809	0,13
20.000	Evergy Kansas Central Inc 5.700% 15-Mar-2053	21.025	0,03
50.000	Evergy Kansas Central Inc 5.900% 15-Nov-2033	53.619	0,07
20.000	Eversource Energy 1.400% 15-Aug-2026	18.268	0,02
10.000	Eversource Energy 2.900% 01-Mar-2027	9.478	0,01
10.000	Eversource Energy 3.300% 15-Jan-2028	9.491	0,01
10.000	Eversource Energy 5.125% 15-May-2033	10.078	0,01
45.000	Eversource Energy 5.950% 01-Feb-2029	47.193	0,06
15.000	Exelon Corp 4.950% 15-Jun-2035	14.471	0,02
15.000	Exelon Corp 5.100% 15-Jun-2045	14.281	0,02
10.000	Exelon Corp 5.300% 15-Mar-2033	10.233	0,01
25.000	Expedia Group Inc '144A' 6.250% 01-May-2025	25.259	0,03
10.000	Extra Space Storage LP 3.900% 01-Apr-2029	9.480	0,01
20.000	Exxon Mobil Corp 3.482% 19-Mar-2030	19.028	0,03
100.000	Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040	93.242	0,13
50.000	F&G Global Funding '144A' 1.750% 30-Jun-2026	45.303	0,06
10.000	FactSet Research Systems Inc 2.900% 01-Mar-2027	9.381	0,01
10.000	Fairfax Financial Holdings Ltd 3.375% 03-Mar-2031	8.807	0,01
5.000	Falabella SA 'REGS' 3.375% 15-Jan-2032	3.721	0,01
20.000	Falabella SA 'REGS' 3.750% 30-Oct-2027	17.660	0,02
10.000	Farmers Insurance Exchange '144A' FRN 4.747% 01-Nov-2057	7.713	0,01
25.000	Federal Realty OP LP 1.250% 15-Feb-2026	23.089	0,03
10.000	Federal Realty OP LP 5.375% 01-May-2028	10.128	0,01
5.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 2.050% 10-Feb-2025	4.826	0,01
5.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 4.400% 23-Aug-2025	4.941	0,01
20.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 5.700% 14-Mar-2028	20.615	0,03
5.000	FedEx Corp 2.400% 15-May-2031	4.313	0,01
20.000	FedEx Corp 3.875% 01-Aug-2042	16.696	0,02
10.000	FedEx Corp 4.050% 15-Feb-2048	8.378	0,01
20.000	FedEx Corp 4.550% 01-Apr-2046	18.007	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	FedEx Corp 4.750% 15-Nov-2045	4.632	0,01
20.000	FedEx Corp 5.100% 15-Jan-2044	19.478	0,03
5.000	FedEx Corp 5.250% 15-May-2050	5.004	0,01
50.000	Fells Point Funding Trust '144A' 3.046% 31-Jan-2027	47.186	0,06
10.000	Ferguson Finance Plc '144A' 4.250% 20-Apr-2027	9.820	0,01
10.000	Ferguson Finance Plc '144A' 4.650% 20-Apr-2032	9.684	0,01
5.000	Fidelis Insurance Holdings Ltd '144A' 4.875% 30-Jun-2030	4.569	0,01
10.000	Fidelity National Financial Inc 2.450% 15-Mar-2031	8.307	0,01
20.000	Fidelity National Information Services Inc 1.650% 01-Mar-2028	17.856	0,02
10.000	Fidelity National Information Services Inc 4.500% 15-Aug-2046	8.510	0,01
10.000	Fifth Third Bancorp 2.375% 28-Jan-2025	9.677	0,01
5.000	Fifth Third Bancorp 8.250% 01-Mar-2038	5.933	0,01
10.000	Fifth Third Bancorp FRN 6.361% 27-Oct-2028	10.387	0,01
10.000	Fifth Third Bank NA 'BKNT' 3.850% 15-Mar-2026	9.626	0,01
10.000	Fifth Third Bank NA 'BKNT' 3.950% 28-Jul-2025	9.792	0,01
10.000	First American Financial Corp 2.400% 15-Aug-2031	7.936	0,01
20.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044	19.455	0,03
20.000	Fiserv Inc 2.650% 01-Jun-2030	17.623	0,02
20.000	Fiserv Inc 3.200% 01-Jul-2026	19.268	0,03
20.000	Fiserv Inc 3.500% 01-Jul-2029	18.848	0,03
30.000	Fiserv Inc 3.850% 01-Jun-2025	29.463	0,04
10.000	Fiserv Inc 4.400% 01-Jul-2049	8.859	0,01
10.000	Fiserv Inc 5.450% 02-Mar-2028	10.314	0,01
50.000	Fiserv Inc 5.625% 21-Aug-2033	52.503	0,07
20.000	Five Corners Funding Trust II '144A' 2.850% 15-May-2030	17.724	0,02
10.000	Flex Intermediate Holdco LLC '144A' 4.317% 30-Dec-2039	7.335	0,01
20.000	Flex Ltd 3.750% 01-Feb-2026	19.374	0,03
10.000	Flex Ltd 6.000% 15-Jan-2028	10.347	0,01
8.441	FLNG Liquefaction 2 LLC '144A' 4.125% 31-Mar-2038	7.418	0,01
8.846	FLNG Liquefaction 3 LLC '144A' 5.550% 31-Mar-2039	8.553	0,01
10.000	Florida Gas Transmission Co LLC '144A' 2.550% 01-Jul-2030	8.582	0,01
20.000	Florida Power & Light Co 2.450% 03-Feb-2032	17.217	0,02
25.000	Florida Power & Light Co 5.950% 01-Feb-2038	27.476	0,04
10.000	FMC Corp 3.450 % 01-Oct-2029	9.053	0,01
10.000	FMC Corp 4.500 % 01-Oct-2049	7.853	0,01
20.000	FMC Corp 5.150% 18-May-2026	19.992	0,03
20.000	FMR LLC '144A' 6.500% 14-Dec-2040	21.469	0,03
5.000	FMR LLC '144A' 7.570% 15-Jun-2029	5.605	0,01
10.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 3.500% 16-Jan-2050	7.746	0,01
5.000	Ford Foundation/The 2.815% 01-Jun-2070	3.198	0,00
50.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	41.652	0,06
80.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	87.578	0,12
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.300 % 10-Feb-2025	48.124	0,07
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	43.872	0,06
4.000	Fortis Inc/Canada 3.055% 04-Oct-2026	3.794	0,01
15.000	Fortive Corp 3.150% 15-Jun-2026	14.370	0,02
10.000	Fortune Brands Innovations Inc 4.000% 15-Jun-2025	9.834	0,01
30.000	Fortune Brands Innovations Inc 5.875% 01-Jun-2033	31.424	0,04
10.000	Foundry JV Holdco LLC '144A' 5.875% 25-Jan-2034	10.303	0,01
10.000	Fox Corp 4.709% 25-Jan-2029	9.956	0,01
10.000	Fox Corp 5.476% 25-Jan-2039	9.759	0,01
10.000	Fox Corp 5.576% 25-Jan-2049	9.701	0,01
10.000	Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-Aug-2028	9.607	0,01
20.000	Freeport-McMoRan Inc 5.000% 01-Sep-2027	19.772	0,03
10.000	Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043	9.743	0,01
5.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 2.375% 16-Feb-2031	3.876	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 3.750% 15-Jun-2029	8.790	0,01
20.000	FS KKR Capital Corp 3.125% 12-Oct-2028	17.465	0,02
20.000	FS KKR Capital Corp 7.875% 15-Jan-2029	21.233	0,03
10.000	GA Global Funding Trust '144A' 1.625% 15-Jan-2026	9.214	0,01
20.000	GA Global Funding Trust '144A' 1.950% 15-Sep-2028	17.127	0,02
25.000	GATX Corp 3.500% 01-Jun-2032	21.851	0,03
5.000	GATX Corp 5.200% 15-Mar-2044	4.716	0,01
50.000	GATX Corp 6.900% 01-May-2034	55.194	0,07
10.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.300% 18-Mar-2051	7.496	0,01
10.000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4.418% 15-Nov-2035	9.732	0,01
20.000	GE HealthCare Technologies Inc '144A' 5.550% 15-Nov-2024	20.015	0,03
20.000	GE HealthCare Technologies Inc '144A' 5.650% 15-Nov-2027	20.728	0,03
20.000	GE HealthCare Technologies Inc '144A' 6.377% 22-Nov-2052	23.355	0,03
10.000	General Dynamics Corp 2.850% 01-Jun-2041	7.713	0,01
10.000	General Dynamics Corp 3.625% 01-Apr-2030	9.623	0,01
14.000	General Mills Inc 4.950% 29-Mar-2033	14.208	0,02
50.000	General Motors Financial Co Inc 5.800% 07-Jan-2029	51.223	0,07
150.000	General Motors Financial Co Inc 6.100% 07-Jan-2034	154.573	0,21
5.000	GENM Capital Labuan Ltd 'REGS' 3.882% 19-Apr-2031	4.277	0,01
5.000	Genpact Luxembourg Sarl 3.375% 01-Dec-2024	4.874	0,01
20.000	Genuine Parts Co 2.750% 01-Feb-2032	16.760	0,02
20.000	Genuine Parts Co 6.500% 01-Nov-2028	21.274	0,03
20.000	Genuine Parts Co 6.875% 01-Nov-2033	22.262	0,03
10.000	Georgetown University/The 5.215% 01-Oct-2118	9.631	0,01
15.000	Georgia Power Co 3.250% 30-Mar-2027	14.350	0,02
20.000	Georgia Power Co 4.950% 17-May-2033	20.212	0,03
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.100% 30-Apr-2027	4.616	0,01
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.300% 30-Apr-2030	4.338	0,01
20.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 3.600% 01-Mar-2025	19.669	0,03
40.000	Gilead Sciences Inc 1.650% 01-Oct-2030	33.579	0,05
20.000	Gilead Sciences Inc 2.950% 01-Mar-2027	19.060	0,03
40.000	Gilead Sciences Inc 3.650% 01-Mar-2026	39.161	0,05
20.000	Gilead Sciences Inc 4.500% 01-Feb-2045	18.579	0,03
10.000	Gilead Sciences Inc 4.600% 01-Sep-2035	9.911	0,01
30.000	Gilead Sciences Inc 4.750% 01-Mar-2046	28.717	0,04
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3.875% 15-May-2028	4.937	0,01
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 4.200% 18-Mar-2043	4.688	0,01
30.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 6.375% 15-May-2038	34.963	0,05
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3.375% 01-Jun-2029	4.824	0,01
10.000	Glencore Finance Canada Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2041	10.237	0,01
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 3.875% 27-Oct-2027	9.672	0,01
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 3.875% 27-Apr-2051	7.787	0,01
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.875% 12-Mar-2029	10.013	0,01
20.000	Glencore Funding LLC '144A' 5.700% 08-May-2033	20.806	0,03
15.000	Global Atlantic Fin Co '144A' 4.400% 15-Oct-2029	13.842	0,02
10.000	Global Payments Inc 1.200% 01-Mar-2026	9.195	0,01
30.000	Global Payments Inc 2.650% 15-Feb-2025	29.089	0,04
20.000	Global Payments Inc 2.900% 15-May-2030	17.629	0,02
20.000	Global Payments Inc 3.200% 15-Aug-2029	18.163	0,02
50.000	Global Payments Inc 4.450% 01-Jun-2028	48.765	0,07
20.000	Global Payments Inc 5.400% 15-Aug-2032	20.249	0,03
10.000	Global Payments Inc 5.950% 15-Aug-2052	10.245	0,01
10.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 3.250% 15-Jan-2032	8.453	0,01
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2031	4.509	0,01
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.250% 01-Jun-2025	4.982	0,01
10.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.300% 15-Jan-2029	9.939	0,01
20.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026	19.889	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
50.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.750% 01-Jun-2028	50.436	0,07
50.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 6.750% 01-Dec-2033	53.997	0,07
4.942	GNL Quintero SA 'REGS' 4.634% 31-Jul-2029	4.872	0,01
5.000	Goldman Sachs Capital I 6.345% 15-Feb-2034	5.275	0,01
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 23-Jan-2025	39.265	0,05
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 16-Nov-2026	96.373	0,13
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.800% 15-Mar-2030	9.413	0,01
25.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.150% 22-May-2045	24.276	0,03
35.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.125% 15-Feb-2033	38.547	0,05
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.250% 01-Feb-2041	11.180	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.450% 01-May-2036	5.419	0,01
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.750% 01-Oct-2037	33.132	0,04
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.615% 22-Apr-2032	8.412	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.650% 21-Oct-2032	8.350	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.102% 24-Feb-2033	8.600	0,01
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.210% 22-Apr-2042	11.534	0,02
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.436% 24-Feb-2043	23.536	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.814% 23-Apr-2029	9.506	0,01
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.017% 31-Oct-2038	35.032	0,05
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.223% 01-May-2029	29.071	0,04
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.411% 23-Apr-2039	4.543	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 6.484% 24-Oct-2029	10.629	0,01
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 6.561% 24-Oct-2034	22.055	0,03
10.000	Golub Capital BDC Inc 2.050% 15-Feb-2027	8.797	0,01
5.000	Goodman US Finance Five LLC '144A' 4.625% 04-May-2032	4.668	0,01
5.000	Goodman US Finance Three LLC '144A' 3.700% 15-Mar-2028	4.662	0,01
20.000	GPS Blue Financing DAC '144A' 5.645% 09-Nov-2041	19.818	0,03
10.000	Gruma SAB de CV '144A' 4.875% 01-Dec-2024	9.965	0,01
10.000	Guardian Life Global Funding '144A' 1.625% 16-Sep-2028	8.759	0,01
20.000	Guardian Life Insurance Co of America/The '144A' 4.850% 24-Jan-2077	17.146	0,02
5.000	GUSAP III LP 'REGS' 7.250% 16-Apr-2044	5.489	0,01
10.000	GXO Logistics Inc 1.650% 15-Jul-2026	9.024	0,01
10.000	GXO Logistics Inc 2.650% 15-Jul-2031	8.229	0,01
10.000	Haleon UK Capital Plc '144A' 3.125% 24-Mar-2025	9.774	0,01
50.000	Haleon US Capital LLC 3.625% 24-Mar-2032	46.224	0,06
15.000	Halliburton Co 4.500% 15-Nov-2041	13.623	0,02
10.000	Halliburton Co 5.000% 15-Nov-2045	9.748	0,01
10.000	Halliburton Co 7.450% 15-Sep-2039	12.526	0,02
10.000	Hana Bank 'REGS' 3.250% 30-Mar-2027	9.565	0,01
20.000	Hanover Insurance Group Inc/The 4.500% 15-Apr-2026	19.669	0,03
5.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd 'REGS' FRN 3.379% 04-Feb-2032	4.613	0,01
10.000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 3.350% 08-Jun-2025	9.658	0,01
20.000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 6.500% 10-Mar-2028	20.795	0,03
10.000	Hartford Financial Services Group Inc/The 4.400% 15-Mar-2048	8.807	0,01
50.000	Hasbro Inc 3.550% 19-Nov-2026	47.478	0,06
5.000	Hasbro Inc 5.100% 15-May-2044	4.508	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	HBOS Plc '144A' 6.000% 01-Nov-2033	4.896	0,01
20.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	18.152	0,02
5.000	HCA Inc 3.500% 15-Jul-2051	3.540	0,00
20.000	HCA Inc 3.625% 15-Mar-2032	17.915	0,02
10.000	HCA Inc 4.125% 15-Jun-2029	9.567	0,01
40.000	HCA Inc 4.500% 15-Feb-2027	39.499	0,05
30.000	HCA Inc 4.625% 15-Mar-2052	25.654	0,03
20.000	HCA Inc 5.125% 15-Jun-2039	19.137	0,03
35.000	HCA Inc 5.250% 15-Apr-2025	34.988	0,05
20.000	HCA Inc 5.250% 15-Jun-2026	20.086	0,03
25.000	HCA Inc 5.250% 15-Jun-2049	23.358	0,03
65.000	HCA Inc 5.375% 01-Feb-2025	64.945	0,09
20.000	HCA Inc 5.500% 01-Jun-2033	20.355	0,03
5.000	HCA Inc 5.500% 15-Jun-2047	4.831	0,01
15.000	HCA Inc 5.625% 01-Sep-2028	15.374	0,02
5.000	Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co '144A' 2.200% 01-Jun-2030	4.268	0,01
60.000	Healthcare Realty Holdings LP 2.000% 15-Mar-2031	48.144	0,07
5.000	Healthcare Realty Holdings LP 3.100% 15-Feb-2030	4.384	0,01
10.000	Healthcare Realty Holdings LP 3.750% 01-Jul-2027	9.474	0,01
5.000	Healthpeak OP LLC 2.125% 01-Dec-2028	4.399	0,01
10.000	Healthpeak OP LLC 3.400% 01-Feb-2025	9.774	0,01
20.000	Healthpeak OP LLC 3.500% 15-Jul-2029	18.694	0,03
20.000	HEICO Corp 5.250% 01-Aug-2028	20.452	0,03
5.000	Heineken NV '144A' 3.500% 29-Jan-2028	4.853	0,01
15.000	Hercules Capital Inc 2.625% 16-Sep-2026	13.553	0,02
10.000	Hess Corp 4.300% 01-Apr-2027	9.909	0,01
10.000	Hess Corp 5.600% 15-Feb-2041	10.553	0,01
10.000	Hess Corp 6.000% 15-Jan-2040	10.921	0,01
10.000	Hewlett Packard Enterprise Co 5.250% 01-Jul-2028	10.239	0,01
10.000	Hewlett Packard Enterprise Co 6.200% 15-Oct-2035	10.998	0,02
10.000	Hewlett Packard Enterprise Co 6.350% 15-Oct-2045	10.839	0,01
20.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	19.894	0,03
10.000	Highwoods Realty LP 2.600% 01-Feb-2031	7.795	0,01
10.000	Highwoods Realty LP 4.125% 15-Mar-2028	9.232	0,01
50.000	Highwoods Realty LP 7.650% 01-Feb-2034	54.095	0,07
5.000	Home Depot Inc/The 3.500% 15-Sep-2056	3.965	0,01
20.000	Honeywell International Inc 1.750% 01-Sep-2031	16.730	0,02
5.000	Honeywell International Inc 1.950% 01-Jun-2030	4.339	0,01
10.000	Honeywell International Inc 4.500% 15-Jan-2034	10.078	0,01
10.000	Honeywell International Inc 5.700% 15-Mar-2037	10.986	0,01
5.000	Hormel Foods Corp 1.800% 11-Jun-2030	4.262	0,01
10.000	Host Hotels & Resorts LP 3.375% 15-Dec-2029	9.008	0,01
10.000	Host Hotels & Resorts LP 3.500% 15-Sep-2030	8.938	0,01
10.000	Host Hotels & Resorts LP 4.000% 15-Jun-2025	9.776	0,01
10.000	HP Inc 2.650% 17-Jun-2031	8.534	0,01
20.000	HP Inc 3.000% 17-Jun-2027	18.913	0,03
10.000	HP Inc 6.000% 15-Sep-2041	10.572	0,01
25.000	HSBC Bank USA NA 'BKNT' 7.000% 15-Jan-2039	29.017	0,04
35.000	HSBC Holdings Plc 6.500% 02-May-2036	36.547	0,05
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.871% 22-Nov-2032	8.329	0,01
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.762% 29-Mar-2033	9.338	0,01
50.000	HSBC Holdings Plc FRN 5.402% 11-Aug-2033	50.336	0,07
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.332% 09-Mar-2044	21.643	0,03
25.000	Hubbell Inc 3.350% 01-Mar-2026	24.229	0,03
20.000	Humana Inc 1.350% 03-Feb-2027	18.059	0,02
50.000	Humana Inc 3.700% 23-Mar-2029	48.111	0,07
10.000	Humana Inc 3.950% 15-Mar-2027	9.787	0,01
10.000	Humana Inc 5.500% 15-Mar-2053	10.404	0,01
30.000	Huntington Bancshares Inc/OH FRN 4.443% 04-Aug-2028	29.117	0,04
10.000	Huntington Ingalls Industries Inc 3.483% 01-Dec-2027	9.469	0,01
10.000	Huntington Ingalls Industries Inc 3.844% 01-May-2025	9.802	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
25.000	Huntington National Bank/The FRN 4.552% 17-May-2028	24.180	0,03
20.000	Huntington National Bank/The FRN 5.699% 18-Nov-2025	19.786	0,03
10.000	Huntsman International LLC 4.500% 01-May-2029	9.648	0,01
5.000	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033	5.924	0,01
10.000	Hyatt Hotels Corp 5.750% 30-Jan-2027	10.223	0,01
20.000	Hyundai Capital America '144A' 1.300% 08-Jan-2026	18.478	0,03
40.000	Hyundai Capital America '144A' 1.650% 17-Sep-2026	36.387	0,05
20.000	Hyundai Capital America '144A' 1.800% 10-Jan-2028	17.565	0,02
20.000	Hyundai Capital America '144A' 2.000% 15-Jun-2028	17.498	0,02
20.000	Hyundai Capital America '144A' 5.500% 30-Mar-2026	20.121	0,03
50.000	Hyundai Capital America '144A' 5.800% 26-Jun-2025	50.293	0,07
20.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS' 1.250% 08-Feb-2026	18.392	0,02
10.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS' 3.625% 29-Aug-2027	9.487	0,01
10.000	ICL Group Ltd '144A' 6.375% 31-May-2038	9.482	0,01
10.000	Illinois Tool Works Inc 4.875% 15-Sep-2041	10.073	0,01
10.000	Illumina Inc 5.750% 13-Dec-2027	10.269	0,01
10.000	Illumina Inc 5.800% 12-Dec-2025	10.043	0,01
100.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 4.250% 21-Jul-2025	98.309	0,13
20.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 6.125% 27-Jul-2027	20.564	0,03
20.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS' 4.750% 06-Aug-2050	16.160	0,02
10.000	Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV 'REGS' 4.750% 15-Jan-2051	7.863	0,01
10.000	ING Groep NV 3.950% 29-Mar-2027	9.688	0,01
50.000	ING Groep NV 4.550% 02-Oct-2028	49.425	0,07
5.000	ING Groep NV '144A' 4.625% 06-Jan-2026	4.970	0,01
10.000	ING Groep NV '144A' FRN 1.400% 01-Jul-2026	9.415	0,01
20.000	ING Groep NV FRN 4.252% 28-Mar-2033	18.806	0,03
50.000	ING Groep NV FRN 6.114% 11-Sep-2034	52.578	0,07
10.000	Intact Financial Corp '144A' 5.459% 22-Sep-2032	10.048	0,01
20.000	Intel Corp 3.100% 15-Feb-2060	13.872	0,02
10.000	Intel Corp 3.200% 12-Aug-2061	6.934	0,01
10.000	Intel Corp 4.800% 01-Oct-2041	9.819	0,01
10.000	Intel Corp 5.625% 10-Feb-2043	10.735	0,01
10.000	Intel Corp 5.900% 10-Feb-2063	11.212	0,02
15.000	Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032	12.020	0,02
25.000	Intercontinental Exchange Inc 3.000% 15-Sep-2060	16.933	0,02
5.000	Intercontinental Exchange Inc 3.100% 15-Sep-2027	4.756	0,01
10.000	Intercontinental Exchange Inc 3.750% 21-Sep-2028	9.706	0,01
20.000	Intercontinental Exchange Inc 4.600% 15-Mar-2033	19.921	0,03
10.000	Intercorp Financial Services Inc 'REGS' 4.125% 19-Oct-2027	9.149	0,01
30.000	International Business Machines Corp 1.700% 15-May-2027	27.433	0,04
20.000	International Business Machines Corp 1.950% 15-May-2030	17.219	0,02
20.000	International Business Machines Corp 3.300% 15-May-2026	19.414	0,03
20.000	International Business Machines Corp 3.300% 27-Jan-2027	19.296	0,03
20.000	International Business Machines Corp 3.500% 15-May-2029	19.104	0,03
50.000	International Business Machines Corp 4.000% 20-Jun-2042	43.734	0,06
45.000	International Business Machines Corp 4.150% 15-May-2039	41.027	0,06
10.000	International Business Machines Corp 4.400% 27-Jul-2032	9.843	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	International Business Machines Corp 4.750% 06-Feb-2033	10.148	0,01
10.000	International Business Machines Corp 5.875% 29-Nov-2032	10.964	0,01
5.000	International Business Machines Corp 7.125% 01-Dec-2096	6.341	0,01
10.000	International Flavors & Fragrances Inc 4.375% 01-Jun-2047	7.730	0,01
20.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A' 1.230% 01-Oct-2025	18.529	0,03
10.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A' 1.832% 15-Oct-2027	8.780	0,01
10.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A' 3.468% 01-Dec-2050	6.875	0,01
10.000	International Paper Co 5.150% 15-May-2046	9.567	0,01
10.000	International Paper Co 6.000% 15-Nov-2041	10.631	0,01
50.000	Interpublic Group of Cos Inc/The 5.400% 01-Oct-2048	47.641	0,06
10.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.250% 23-Sep-2024	9.820	0,01
10.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.875% 14-Jul-2027	9.325	0,01
20.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 7.000% 21-Nov-2025	20.510	0,03
25.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 7.200% 28-Nov-2033	26.721	0,04
25.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 7.800% 28-Nov-2053	27.573	0,04
5.000	Intuit Inc 1.650% 15-Jul-2030	4.210	0,01
60.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 2.300% 15-Nov-2028	53.295	0,07
50.000	IQVIA Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	52.305	0,07
10.000	ITC Holdings Corp 3.350% 15-Nov-2027	9.504	0,01
10.000	ITC Holdings Corp '144A' 2.950% 14-May-2030	8.813	0,01
10.000	ITR Concession Co LLC '144A' 5.183% 15-Jul-2035	9.062	0,01
10.000	J M Smucker Co/The 2.375% 15-Mar-2030	8.651	0,01
10.000	J M Smucker Co/The 3.550% 15-Mar-2050	7.411	0,01
51.000	J M Smucker Co/The 6.200% 15-Nov-2033	55.769	0,08
30.000	J M Smucker Co/The 6.500% 15-Nov-2053	34.802	0,05
5.000	JAB Holdings BV '144A' 4.500 % 08-Apr-2052	3.928	0,01
20.000	Jabil Inc 3.950% 12-Jan-2028	19.125	0,03
20.000	Jackson National Life Global Funding '144A' 1.750% 12-Jan-2025	19.189	0,03
20.000	Jackson National Life Global Funding '144A' 3.050% 29-Apr-2026	18.879	0,03
10.000	Jackson National Life Global Funding '144A' 3.875% 11-Jun-2025	9.724	0,01
10.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 2.500% 15-Jan-2027	9.215	0,01
30.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 3.000% 02-Feb-2029	26.406	0,04
40.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 5.750% 01-Apr-2033	39.874	0,05
10.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 6.500% 01-Dec-2052	10.080	0,01
15.000	Jefferies Financial Group Inc 2.625% 15-Oct-2031	12.457	0,02
10.000	Jefferies Financial Group Inc 4.150% 23-Jan-2030	9.415	0,01
50.000	Jefferies Financial Group Inc 4.850% 15-Jan-2027	49.831	0,07
5.000	Jefferies Financial Group Inc 6.500% 20-Jan-2043	5.242	0,01
50.000	Jersey Central Power & Light Co '144A' 4.300% 15-Jan-2026	48.966	0,07
40.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 1.700% 11-Jan-2027	36.973	0,05
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 2.000% 17-Jun-2031	8.507	0,01
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 3.450% 07-Mar-2029	9.602	0,01
20.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 4.150% 15-Sep-2027	19.895	0,03
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 4.850% 11-Oct-2029	10.320	0,01
8.125	John Sevier Combined Cycle Generation LLC 4.626% 15-Jan-2042	7.697	0,01
5.000	Johnson & Johnson 3.400% 15-Jan-2038	4.448	0,01
5.000	Johnson & Johnson 3.550% 01-Mar-2036	4.638	0,01
5.000	Johnson & Johnson 3.625% 03-Mar-2037	4.612	0,01
5.000	Johnson & Johnson 5.950% 15-Aug-2037	5.779	0,01
10.000	Johnson Controls International plc 3.900% 14-Feb-2026	9.777	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Johnson Controls International plc Step-Up Coupon 4.950% 02-Jul-2064	9.159	0,01
30.000	JPMorgan Chase & Co 2.950% 01-Oct-2026	28.602	0,04
10.000	JPMorgan Chase & Co 3.300% 01-Apr-2026	9.688	0,01
60.000	JPMorgan Chase & Co 3.625% 01-Dec-2027	57.689	0,08
40.000	JPMorgan Chase & Co 4.125% 15-Dec-2026	39.255	0,05
50.000	JPMorgan Chase & Co 4.950% 01-Jun-2045	47.992	0,06
15.000	JPMorgan Chase & Co 5.400% 06-Jan-2042	15.605	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co 5.500% 15-Oct-2040	10.449	0,01
5.000	JPMorgan Chase & Co 8.750% 01-Sep-2030	6.020	0,01
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.040% 04-Feb-2027	45.990	0,06
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.045% 19-Nov-2026	9.270	0,01
25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.470% 22-Sep-2027	22.664	0,03
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.561% 10-Dec-2025	48.154	0,07
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.578% 22-Apr-2027	9.235	0,01
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032	8.145	0,01
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	19.167	0,03
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.182% 01-Jun-2028	13.735	0,02
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.739% 15-Oct-2030	17.826	0,02
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.956% 13-May-2031	35.225	0,05
220.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.963% 25-Jan-2033	188.975	0,25
30.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.109% 22-Apr-2041	23.193	0,03
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.509% 23-Jan-2029	18.984	0,03
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.540% 01-May-2028	14.334	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030	9.417	0,01
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.882% 24-Jul-2038	8.895	0,01
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.960% 29-Jan-2027	9.776	0,01
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.005% 23-Apr-2029	9.638	0,01
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.080% 26-Apr-2026	19.688	0,03
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.203% 23-Jul-2029	48.667	0,07
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.493% 24-Mar-2031	19.545	0,03
25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.565% 14-Jun-2030	24.508	0,03
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.851% 25-Jul-2028	15.023	0,02
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.912% 25-Jul-2033	19.813	0,03
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	101.585	0,14
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.546% 15-Dec-2025	20.017	0,03
90.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.717% 14-Sep-2033	93.251	0,13
150.000	JT International Financial Services BV '144A' 6.875% 24-Oct-2032	167.925	0,23
10.000	Kaiser Foundation Hospitals 2.810% 01-Jun-2041	7.553	0,01
50.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.125% 16-Aug-2027	47.830	0,06
20.000	KBC Group NV '144A' FRN 5.796% 19-Jan-2029	20.372	0,03
15.000	Kellanova 4.300% 15-May-2028	14.876	0,02
5.000	Kellanova 4.500% 01-Apr-2046	4.492	0,01
20.000	Kentucky Power Co '144A' 7.000% 15-Nov-2033	21.593	0,03
5.000	Kenvue Inc 5.100% 22-Mar-2043	5.209	0,01
5.000	Kenvue Inc 5.200% 22-Mar-2063	5.259	0,01
40.000	Keurig Dr Pepper Inc 3.200% 01-May-2030	36.849	0,05
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4.420% 15-Dec-2046	8.930	0,01
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 5.085% 25-May-2048	9.923	0,01
5.000	Keysight Technologies Inc 3.000% 30-Oct-2029	4.554	0,01
40.000	KeySpan Gas East Corp '144A' 2.742% 15-Aug-2026	37.347	0,05
20.000	KeySpan Gas East Corp '144A' 5.819% 01-Apr-2041	19.550	0,03
20.000	Kia Corp 'REGS' 1.750% 16-Oct-2026	18.268	0,02
10.000	Kia Corp 'REGS' 2.375% 14-Feb-2025	9.690	0,01
60.000	Kilroy Realty LP 3.450% 15-Dec-2024	58.557	0,08
5.000	Kimberly-Clark Corp 3.100% 26-Mar-2030	4.676	0,01
5.000	Kimberly-Clark Corp 5.300% 01-Mar-2041	5.240	0,01
10.000	Kimberly-Clark Corp 6.625% 01-Aug-2037	11.948	0,02
10.000	Kimco Realty OP LLC 2.800% 01-Oct-2026	9.447	0,01
10.000	Kimco Realty OP LLC 3.200% 01-Apr-2032	8.720	0,01
5.000	Kimco Realty OP LLC 3.700% 01-Oct-2049	3.772	0,01
5.000	Kimco Realty OP LLC 4.125% 01-Dec-2046	3.869	0,01
10.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.000% 01-Mar-2043	8.980	0,01
20.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 6.550% 15-Sep-2040	21.207	0,03
20.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 'MTN' 6.950% 15-Jan-2038	22.039	0,03
20.000	Kinder Morgan Inc 1.750% 15-Nov-2026	18.420	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Kinder Morgan Inc 4.300% 01-Jun-2025	9.885	0,01
20.000	Kinder Morgan Inc 5.050% 15-Feb-2046	17.947	0,02
20.000	Kinder Morgan Inc 5.200% 01-Jun-2033	19.928	0,03
20.000	Kinder Morgan Inc 5.450% 01-Aug-2052	19.242	0,03
20.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN' 7.750% 15-Jan-2032	22.814	0,03
10.000	Kinross Gold Corp '144A' 6.250% 15-Jul-2033	10.507	0,01
10.000	Kirby Corp 4.200% 01-Mar-2028	9.662	0,01
20.000	KLA Corp 4.650% 15-Jul-2032	20.481	0,03
25.000	KLA Corp 5.250% 15-Jul-2062	26.238	0,04
10.000	Koninklijke KPN NV 8.375% 01-Oct-2030	11.825	0,02
10.000	Kookmin Bank 'REGS' 1.750% 04-May-2025	9.581	0,01
15.000	Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026	14.424	0,02
50.000	Kraft Heinz Foods Co 3.750% 01-Apr-2030	47.878	0,06
40.000	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	35.081	0,05
20.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042	19.379	0,03
30.000	Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045	29.499	0,04
5.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039	5.950	0,01
10.000	Kroger Co/The 2.200% 01-May-2030	8.573	0,01
40.000	Kroger Co/The 3.700% 01-Aug-2027	38.755	0,05
5.000	Kroger Co/The 3.950% 15-Jan-2050	4.112	0,01
5.000	Kroger Co/The 4.450% 01-Feb-2047	4.435	0,01
20.000	Kroger Co/The 5.000% 15-Apr-2042	18.857	0,03
20.000	Kroger Co/The 6.900% 15-Apr-2038	22.703	0,03
20.000	L3Harris Technologies Inc 4.400% 15-Jun-2028	19.799	0,03
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.400% 15-Jun-2028	9.899	0,01
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.854% 27-Apr-2035	9.902	0,01
10.000	L3Harris Technologies Inc 5.054% 27-Apr-2045	9.913	0,01
30.000	Laboratory Corp of America Holdings 1.550% 01-Jun-2026	27.739	0,04
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 2.950% 01-Dec-2029	4.506	0,01
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 4.700% 01-Feb-2045	4.632	0,01
5.000	Lam Research Corp 3.125% 15-Jun-2060	3.459	0,00
10.000	Lazard Group LLC 3.625% 01-Mar-2027	9.475	0,01
5.000	Lazard Group LLC 3.750% 13-Feb-2025	4.894	0,01
10.000	Lazard Group LLC 4.375% 11-Mar-2029	9.748	0,01
35.000	LBJ Infrastructure Group LLC '144A' 3.797% 31-Dec-2057	24.149	0,03
10.000	Lear Corp 3.800% 15-Sep-2027	9.649	0,01
5.000	Lear Corp 5.250% 15-May-2049	4.638	0,01
5.000	Leidos Inc 2.300% 15-Feb-2031	4.193	0,01
20.000	Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027	20.000	0,03
20.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 5.831% 27-Jan-2028	20.412	0,03
10.000	LG Chem Ltd 'REGS' 2.375% 07-Jul-2031	8.291	0,01
20.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 3.950% 15-May-2060	14.509	0,02
17.770	Lima Metro Line 2 Finance Ltd 'REGS' 5.875% 05-Jul-2034	17.603	0,02
50.000	LKQ Corp 6.250% 15-Jun-2033	52.227	0,07
20.000	Lloyds Banking Group Plc 4.344% 09-Jan-2048	16.157	0,02
10.000	Lloyds Banking Group Plc 4.550% 16-Aug-2028	9.856	0,01
20.000	Lloyds Banking Group Plc 4.582% 10-Dec-2025	19.595	0,03
10.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.369% 14-Dec-2046	6.979	0,01
20.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.511% 18-Mar-2026	19.547	0,03
20.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 4.716% 11-Aug-2026	19.755	0,03
10.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 4.976% 11-Aug-2033	9.764	0,01
50.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 5.871% 06-Mar-2029	51.311	0,07
10.000	Lockheed Martin Corp 4.070% 15-Dec-2042	9.055	0,01
20.000	Lockheed Martin Corp 5.250% 15-Jan-2033	21.263	0,03
15.000	Lockheed Martin Corp 5.900% 15-Nov-2063	17.623	0,02
39.000	Louisville Gas and Electric Co 5.450% 15-Apr-2033	40.726	0,06
15.000	Lowe's Cos Inc 2.625% 01-Apr-2031	13.146	0,02
10.000	Lowe's Cos Inc 3.100% 03-May-2027	9.587	0,01
10.000	Lowe's Cos Inc 3.700% 15-Apr-2046	7.933	0,01
20.000	Lowe's Cos Inc 4.050% 03-May-2047	16.544	0,02
10.000	Lowe's Cos Inc 4.250% 01-Apr-2052	8.508	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Lowe's Cos Inc 4.450% 01-Apr-2062	8.439	0,01
20.000	Lowe's Cos Inc 4.650% 15-Apr-2042	18.696	0,03
15.000	Lowe's Cos Inc 4.800% 01-Apr-2026	15.021	0,02
20.000	Lowe's Cos Inc 5.150% 01-Jul-2033	20.600	0,03
10.000	Lowe's Cos Inc 5.625% 15-Apr-2053	10.535	0,01
10.000	Lowe's Cos Inc 5.800% 15-Sep-2062	10.647	0,01
5.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029	4.628	0,01
25.000	LSEGA Financing Plc '144A' 2.500% 06-Apr-2031	21.467	0,03
10.000	LYB Finance Co BV '144A' 8.100% 15-Mar-2027	10.784	0,01
10.000	LYB International Finance III LLC 1.250% 01-Oct-2025	9.345	0,01
20.000	LYB International Finance III LLC 3.375% 01-Oct-2040	15.414	0,02
25.000	LYB International Finance III LLC 3.625% 01-Apr-2051	18.285	0,02
10.000	LyondellBasell Industries NV 4.625% 26-Feb-2055	8.750	0,01
20.000	M&T Bank Corp FRN 4.553% 16-Aug-2028	19.292	0,03
5.000	Macquarie Bank Ltd '144A' 3.624% 03-Jun-2030	4.357	0,01
20.000	Macquarie Bank Ltd '144A' 6.798% 18-Jan-2033	21.325	0,03
20.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 1.340% 12-Jan-2027	18.390	0,02
10.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 1.629% 23-Sep-2027	9.007	0,01
10.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 2.691% 23-Jun-2032	8.228	0,01
40.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 2.871% 14-Jan-2033	32.984	0,04
30.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 4.098% 21-Jun-2028	28.849	0,04
5.000	Magellan Midstream Partners LP 3.950% 01-Mar-2050	3.843	0,01
5.000	Magellan Midstream Partners LP 4.200% 03-Oct-2047	3.982	0,01
10.000	Magna International Inc 2.450% 15-Jun-2030	8.783	0,01
20.000	Manufacturers & Traders Trust Co 4.650% 27-Jan-2026	19.594	0,03
40.000	Manufacturers & Traders Trust Co 4.700% 27-Jan-2028	38.921	0,05
10.000	Manulife Financial Corp FRN 4.061% 24-Feb-2032	9.434	0,01
20.000	Marathon Oil Corp 4.400% 15-Jul-2027	19.507	0,03
5.000	Marathon Oil Corp 6.800% 15-Mar-2032	5.425	0,01
10.000	Marathon Petroleum Corp 4.500% 01-Apr-2048	8.441	0,01
10.000	Marathon Petroleum Corp 6.500% 01-Mar-2041	10.787	0,01
20.000	Markel Group Inc 5.000% 05-Apr-2046	18.285	0,02
10.000	Marriott International Inc/MD 2.750% 15-Oct-2033	8.262	0,01
25.000	Marriott International Inc/MD 2.850% 15-Apr-2031	21.682	0,03
10.000	Marriott International Inc/MD 4.625% 15-Jun-2030	9.833	0,01
5.000	Marriott International Inc/MD 4.650% 01-Dec-2028	4.973	0,01
20.000	Marriott International Inc/MD 5.000% 15-Oct-2027	20.262	0,03
15.000	Mars Inc '144A' 3.200% 01-Apr-2030	13.881	0,02
10.000	Mars Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2039	8.813	0,01
10.000	Mars Inc '144A' 4.200% 01-Apr-2059	8.657	0,01
50.000	Mars Inc '144A' 4.750% 20-Apr-2033	50.562	0,07
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15-Mar-2029	9.974	0,01
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.750% 15-Mar-2039	9.763	0,01
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc 5.750% 01-Nov-2032	10.780	0,01
20.000	Marsh & McLennan Cos Inc 5.875% 01-Aug-2033	21.921	0,03
30.000	Martin Marietta Materials Inc 2.400% 15-Jul-2031	25.574	0,03
10.000	Martin Marietta Materials Inc 3.200% 15-Jul-2051	7.490	0,01
50.000	Marvell Technology Inc 4.875% 22-Jun-2028	49.958	0,07
10.000	Masco Corp 4.500% 15-May-2047	8.674	0,01
5.000	Mass General Brigham Inc 3.342% 01-Jul-2060	3.605	0,01
25.000	Massachusetts Institute of Technology 3.885% 01-Jul-2116	19.778	0,03
30.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 3.200% 01-Dec-2061	19.631	0,03
5.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 3.729% 15-Oct-2070	3.465	0,00
10.000	MassMutual Global Funding II '144A' 1.550% 09-Oct-2030	8.094	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
50.000	MassMutual Global Funding II '144A' 4.150% 26-Aug-2025	49.520	0,07
20.000	MasTec Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	18.822	0,03
20.000	Mastercard Inc 1.900% 15-Mar-2031	17.115	0,02
10.000	Mastercard Inc 2.950% 01-Jun-2029	9.404	0,01
50.000	Mattel Inc 5.450% 01-Nov-2041	44.858	0,06
10.000	Mattel Inc '144A' 3.375% 01-Apr-2026	9.520	0,01
20.000	Mattel Inc '144A' 5.875% 15-Dec-2027	19.987	0,03
15.000	McCormick & Co Inc/MD 0.900% 15-Feb-2026	13.820	0,02
15.000	McCormick & Co Inc/MD 1.850% 15-Feb-2031	12.358	0,02
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 1.450% 01-Sep-2025	4.735	0,01
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 2.625% 01-Sep-2029	18.339	0,02
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.500% 01-Mar-2027	19.492	0,03
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.700% 15-Feb-2042	16.910	0,02
10.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050	8.862	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.450% 01-Sep-2048	4.664	0,01
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.600% 09-Sep-2032	20.231	0,03
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.600% 26-May-2045	4.715	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.875% 09-Dec-2045	4.929	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 6.300% 15-Oct-2037	5.682	0,01
30.000	Medtronic Global Holdings SCA 4.250% 30-Mar-2028	29.919	0,04
10.000	Medtronic Global Holdings SCA 4.500% 30-Mar-2033	10.026	0,01
5.000	Medtronic Inc 4.375% 15-Mar-2035	4.893	0,01
10.000	Meiji Yasuda Life Insurance Co '144A' FRN 5.100% 26-Apr-2048	9.790	0,01
10.000	Meiji Yasuda Life Insurance Co '144A' FRN 5.200% 20-Oct-2045	9.858	0,01
20.000	Meituan 'REGS' 2.125% 28-Oct-2025	18.828	0,03
10.000	Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030	8.450	0,01
20.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC 8.500% 18-Jan-2031	25.130	0,03
10.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A' 3.100% 15-Aug-2029	9.271	0,01
20.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A' 4.800% 30-Mar-2028	20.224	0,03
10.000	Merck & Co Inc 2.150% 10-Dec-2031	8.558	0,01
10.000	Merck & Co Inc 2.900% 10-Dec-2061	6.728	0,01
10.000	Merck & Co Inc 3.400% 07-Mar-2029	9.626	0,01
20.000	Merck & Co Inc 3.900% 07-Mar-2039	18.254	0,02
50.000	Merck & Co Inc 4.500% 17-May-2033	50.476	0,07
10.000	Merck & Co Inc 5.150% 17-May-2063	10.488	0,01
10.000	Met Tower Global Funding '144A' 3.700% 13-Jun-2025	9.841	0,01
10.000	Meta Platforms Inc 3.850% 15-Aug-2032	9.529	0,01
5.000	Meta Platforms Inc 4.650% 15-Aug-2062	4.683	0,01
52.000	Meta Platforms Inc 4.950% 15-May-2033	53.811	0,07
15.000	Meta Platforms Inc 5.750% 15-May-2063	16.507	0,02
30.000	MetLife Capital Trust IV '144A' 7.875% 15-Dec-2037	32.297	0,04
20.000	MetLife Inc 4.550% 23-Mar-2030	20.144	0,03
10.000	MetLife Inc 5.250% 15-Jan-2054	10.335	0,01
50.000	MetLife Inc 5.700% 15-Jun-2035	53.948	0,07
5.000	MetLife Inc 10.750% 01-Aug-2039	6.703	0,01
5.000	MetLife Inc '144A' 9.250% 08-Apr-2038	5.622	0,01
5.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 2.950% 09-Apr-2030	4.451	0,01
30.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 3.000% 19-Sep-2027	28.181	0,04
30.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 4.300% 25-Aug-2029	29.276	0,04
30.000	Michael Kors USA Inc '144A' 4.250% 01-Nov-2024	29.362	0,04
10.000	Microchip Technology Inc 4.250% 01-Sep-2025	9.856	0,01
2.000	Micron Technology Inc 3.366% 01-Nov-2041	1.500	0,00
20.000	Micron Technology Inc 4.185% 15-Feb-2027	19.639	0,03
50.000	Micron Technology Inc 5.327% 06-Feb-2029	51.090	0,07
30.000	Micron Technology Inc 5.875% 09-Feb-2033	31.257	0,04
10.000	Microsoft Corp 3.041% 17-Mar-2062	7.264	0,01
25.000	Microsoft Corp 4.500% 06-Feb-2057	24.707	0,03
10.000	Mid-America Apartments LP 3.950% 15-Mar-2029	9.734	0,01
5.000	MidAmerican Energy Co 3.100% 01-May-2027	4.788	0,01
5.000	MidAmerican Energy Co 3.650% 15-Apr-2029	4.787	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC '144A' 4.100% 15-May-2028	19.347	0,03
10.000	Minejesa Capital BV 'REGS' 4.625% 10-Aug-2030	9.513	0,01
10.000	Minera Mexico SA de CV 'REGS' 4.500% 26-Jan-2050	8.078	0,01
10.000	Mississippi Power Co 3.950% 30-Mar-2028	9.738	0,01
10.000	Mitsubishi Corp '144A' 1.125% 15-Jul-2026	9.120	0,01
10.000	Mitsubishi HC Capital Inc '144A' 3.637% 13-Apr-2025	9.778	0,01
50.000	Mitsubishi HC Capital Inc '144A' 5.080% 15-Sep-2027	50.034	0,07
15.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 1.412% 17-Jul-2025	14.161	0,02
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.193% 25-Feb-2025	9.666	0,01
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.559% 25-Feb-2030	8.783	0,01
30.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.741% 07-Mar-2029	28.764	0,04
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.850% 01-Mar-2026	19.543	0,03
30.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1.538% 20-Jul-2027	27.438	0,04
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 2.309% 20-Jul-2032	16.639	0,02
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 4.080% 19-Apr-2028	9.735	0,01
50.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 5.354% 13-Sep-2028	50.735	0,07
50.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 5.441% 22-Feb-2034	51.801	0,07
20.000	Mitsui Fudosan Co Ltd '144A' 2.572% 21-Jan-2032	16.886	0,02
20.000	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd '144A' FRN (Perpetual) 4.950% 06-Mar-2029	19.334	0,03
35.000	Mizuho Financial Group Inc 4.018% 05-Mar-2028	34.018	0,05
35.000	Mizuho Financial Group Inc '144A' 3.477% 12-Apr-2026	33.856	0,05
15.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 1.234% 22-May-2027	13.678	0,02
20.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 2.226% 25-May-2026	19.126	0,03
15.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 3.153% 16-Jul-2030	13.528	0,02
20.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 5.669% 13-Sep-2033	20.660	0,03
15.000	Molson Coors Beverage Co 3.000% 15-Jul-2026	14.382	0,02
10.000	Molson Coors Beverage Co 4.200% 15-Jul-2046	8.567	0,01
15.000	Molson Coors Beverage Co 5.000% 01-May-2042	14.509	0,02
10.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV '144A' 4.250% 15-Sep-2025	9.883	0,01
15.000	Mondelez International Inc 2.750% 13-Apr-2030	13.575	0,02
10.000	Moody's Corp 3.750% 24-Mar-2025	9.850	0,01
10.000	Moody's Corp 3.750% 25-Feb-2052	8.227	0,01
5.000	Moody's Corp 4.250% 01-Feb-2029	4.960	0,01
5.000	Morgan Stanley 3.625% 20-Jan-2027	4.853	0,01
50.000	Morgan Stanley Bank NA 'BKNT' 5.882% 30-Oct-2026	51.442	0,07
20.000	Morgan Stanley FRN 1.593% 04-May-2027	18.443	0,03
20.000	Morgan Stanley FRN 2.188% 28-Apr-2026	19.224	0,03
50.000	Morgan Stanley FRN 2.475% 21-Jan-2028	46.474	0,06
30.000	Morgan Stanley FRN 2.484% 16-Sep-2036	23.850	0,03
20.000	Morgan Stanley FRN 2.943% 21-Jan-2033	17.060	0,02
45.000	Morgan Stanley FRN 3.217% 22-Apr-2042	34.722	0,05
10.000	Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028	9.561	0,01
10.000	Morgan Stanley FRN 3.971% 22-Jul-2038	8.777	0,01
50.000	Morgan Stanley FRN 4.889% 20-Jul-2033	48.868	0,07
30.000	Morgan Stanley FRN 5.123% 01-Feb-2029	30.179	0,04
30.000	Morgan Stanley FRN 5.297% 20-Apr-2037	29.262	0,04
16.000	Morgan Stanley FRN 6.138% 16-Oct-2026	16.304	0,02
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3.875% 27-Jan-2026	49.012	0,07
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031	43.779	0,06
60.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 4.431% 23-Jan-2030	58.545	0,08
55.000	Morgan Stanley 'MTN' 3.125% 27-Jul-2026	52.699	0,07
15.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 1.928% 28-Apr-2032	12.094	0,02
40.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 2.630% 18-Feb-2026	38.736	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 3.622% 01-Apr-2031	18.446	0,03
50.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 5.250% 21-Apr-2034	50.140	0,07
20.000	Mosaic Co/The 5.375% 15-Nov-2028	20.449	0,03
10.000	Motorola Solutions Inc 2.750% 24-May-2031	8.567	0,01
20.000	Motorola Solutions Inc 4.600% 23-Feb-2028	19.922	0,03
10.000	Motorola Solutions Inc 4.600% 23-May-2029	9.942	0,01
20.000	Motorola Solutions Inc 5.600% 01-Jun-2032	20.653	0,03
50.000	MPLX LP 2.650% 15-Aug-2030	43.240	0,06
10.000	MPLX LP 4.000% 15-Mar-2028	9.659	0,01
20.000	MPLX LP 4.250% 01-Dec-2027	19.586	0,03
5.000	MPLX LP 4.500% 15-Apr-2038	4.470	0,01
40.000	MPLX LP 4.950% 14-Mar-2052	35.797	0,05
10.000	MPLX LP 5.500% 15-Feb-2049	9.726	0,01
20.000	MSCI Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2031	18.295	0,02
40.000	Mylan Inc 4.550% 15-Apr-2028	38.844	0,05
5.000	Narragansett Electric Co/The '144A' 5.638% 15-Mar-2040	5.056	0,01
10.000	Nasdaq Inc 3.850% 30-Jun-2026	9.752	0,01
20.000	Nasdaq Inc 5.350% 28-Jun-2028	20.603	0,03
20.000	Nasdaq Inc 5.550% 15-Feb-2034	20.832	0,03
15.000	Nasdaq Inc 5.950% 15-Aug-2053	16.205	0,02
30.000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.332% 21-Aug-2030	24.505	0,03
20.000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.648% 14-Jan-2041	13.090	0,02
10.000	National Australia Bank Ltd '144A' 3.500% 10-Jan-2027	9.686	0,01
10.000	National Australia Bank Ltd '144A' FRN 3.933% 02-Aug-2034	9.087	0,01
30.000	National Australia Bank Ltd/New York 'BKNT' 2.500% 12-Jul-2026	28.547	0,04
15.000	National Fuel Gas Co 2.950% 01-Mar-2031	12.600	0,02
5.000	National Fuel Gas Co 3.950% 15-Sep-2027	4.769	0,01
10.000	National Fuel Gas Co 5.200% 15-Jul-2025	9.965	0,01
50.000	National Grid Plc 5.809% 12-Jun-2033	52.690	0,07
10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 2.400% 15-Mar-2030	8.710	0,01
10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 4.023% 01-Nov-2032	9.359	0,01
20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 4.150% 15-Dec-2032	19.026	0,03
5.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp FRN 5.250% 20-Apr-2046	4.809	0,01
10.000	National Securities Clearing Corp '144A' 0.750% 07-Dec-2025	9.266	0,01
25.000	Nationwide Building Society '144A' 3.900% 21-Jul-2025	24.540	0,03
10.000	Nationwide Building Society '144A' 4.850% 27-Jul-2027	9.983	0,01
10.000	Nationwide Building Society '144A' FRN 3.960% 18-Jul-2030	9.344	0,01
10.000	Nationwide Building Society '144A' FRN 4.125% 18-Oct-2032	9.050	0,01
20.000	Nationwide Building Society '144A' FRN 4.302% 08-Mar-2029	19.194	0,03
5.000	Nationwide Financial Services Inc 6.750% 15-May-2037	4.934	0,01
5.000	Nationwide Financial Services Inc '144A' 5.300% 18-Nov-2044	4.577	0,01
20.000	Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 8.250% 01-Dec-2031	22.820	0,03
5.000	Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 9.375% 15-Aug-2039	6.634	0,01
10.000	NatWest Markets Plc '144A' 3.479% 22-Mar-2025	9.803	0,01
10.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.900% 24-Sep-2038	9.209	0,01
20.000	Nestle Holdings Inc '144A' 4.300% 01-Oct-2032	20.139	0,03
10.000	NetApp Inc 2.700% 22-Jun-2030	8.850	0,01
30.000	Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028	30.429	0,04
20.000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029	20.685	0,03
10.000	Nevada Power Co 6.750% 01-Jul-2037	11.401	0,02
5.000	New York and Presbyterian Hospital/The 3.954% 01-Aug-2119	3.680	0,01
20.000	New York Life Global Funding '144A' 1.200% 07-Aug-2030	16.082	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	New York Life Global Funding '144A' 2.350% 14-Jul-2026	37.734	0,05
15.000	New York Life Insurance Co '144A' 6.750% 15-Nov-2039	17.333	0,02
10.000	New York State Electric & Gas Corp '144A' 3.250% 01-Dec-2026	9.440	0,01
5.000	Newmont Corp 2.600% 15-Jul-2032	4.286	0,01
5.000	Newmont Corp 4.875% 15-Mar-2042	4.880	0,01
5.000	Newmont Corp 5.450% 09-Jun-2044	5.118	0,01
5.000	Newmont Corp 6.250% 01-Oct-2039	5.572	0,01
15.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 2.750% 01-Nov-2029	13.471	0,02
20.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.550% 01-May-2027	19.286	0,03
30.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 4.625% 15-Jul-2027	29.980	0,04
50.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 4.900% 28-Feb-2028	50.499	0,07
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 5.000% 15-Jul-2032	10.078	0,01
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 5.250% 28-Feb-2053	9.884	0,01
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 5.650% 01-May-2079	9.434	0,01
10.000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15-Aug-2027	9.826	0,01
5.000	NGPL PipeCo LLC '144A' 7.768% 15-Dec-2037	5.576	0,01
14.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 2.750% 21-Jan-2051	11.634	0,02
10.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 3.400% 23-Jan-2050	8.852	0,01
20.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 4.700% 20-Jan-2046	19.582	0,03
20.000	NiSource Inc 3.600% 01-May-2030	18.644	0,03
5.000	NiSource Inc 4.375% 15-May-2047	4.339	0,01
10.000	NiSource Inc 5.000% 15-Jun-2052	9.420	0,01
10.000	NiSource Inc 5.650% 01-Feb-2045	10.112	0,01
10.000	NiSource Inc 5.950% 15-Jun-2041	10.483	0,01
15.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 3.522% 17-Sep-2025	14.451	0,02
40.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.345% 17-Sep-2027	38.325	0,05
10.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.810% 17-Sep-2030	9.370	0,01
10.000	NNN REIT Inc 3.000% 15-Apr-2052	6.558	0,01
10.000	NNN REIT Inc 3.500% 15-Oct-2027	9.455	0,01
50.000	NNN REIT Inc 5.600% 15-Oct-2033	51.759	0,07
20.000	Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027	19.382	0,03
10.000	Nordea Bank Abp '144A' 0.750% 28-Aug-2025	9.333	0,01
10.000	Nordea Bank Abp '144A' 1.500% 30-Sep-2026	9.125	0,01
10.000	Nordea Bank Abp '144A' FRN 4.625% 13-Sep-2033	9.423	0,01
10.000	Norfolk Southern Corp 3.942% 01-Nov-2047	8.389	0,01
15.000	Norfolk Southern Corp 4.050% 15-Aug-2052	12.756	0,02
20.000	Norfolk Southern Corp 4.100% 15-May-2121	15.189	0,02
5.000	Norfolk Southern Corp 4.837% 01-Oct-2041	4.840	0,01
20.000	Norfolk Southern Corp 5.050% 01-Aug-2030	20.538	0,03
62.000	Norfolk Southern Corp 5.550% 15-Mar-2034	65.644	0,09
20.000	Norfolk Southern Corp 5.950% 15-Mar-2064	22.446	0,03
10.000	Norinchukin Bank/The '144A' 2.080% 22-Sep-2031	8.215	0,01
25.000	Northern Trust Corp 4.000% 10-May-2027	24.697	0,03
15.000	Northrop Grumman Corp 3.250% 15-Jan-2028	14.350	0,02
30.000	Northrop Grumman Corp 4.030% 15-Oct-2047	25.833	0,03
20.000	Northrop Grumman Corp 5.150% 01-May-2040	20.337	0,03
20.000	Northwestern Mutual Global Funding '144A' 4.350% 15-Sep-2027	19.755	0,03
10.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 3.625% 30-Sep-2059	7.470	0,01
10.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 6.063% 30-Mar-2040	10.704	0,01
2.000	Northwestern University 3.662% 01-Dec-2057	1.618	0,00
5.000	NOV Inc 3.950 % 01-Dec-2042	3.880	0,01
15.000	Novant Health Inc 2.637% 01-Nov-2036	11.614	0,02
10.000	Novartis Capital Corp 3.700% 21-Sep-2042	8.742	0,01
60.000	NRG Energy Inc '144A' 2.450% 02-Dec-2027	54.163	0,07
30.000	NTT Finance Corp '144A' 1.162% 03-Apr-2026	27.689	0,04
20.000	NTT Finance Corp '144A' 4.239% 25-Jul-2025	19.794	0,03
20.000	Nucor Corp 2.979% 15-Dec-2055	13.602	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Nucor Corp 4.300% 23-May-2027	19.830	0,03
20.000	Nutrien Ltd 4.900% 27-Mar-2028	20.211	0,03
10.000	Nutrien Ltd 5.000% 01-Apr-2049	9.529	0,01
10.000	Nutrien Ltd 5.250% 15-Jan-2045	9.779	0,01
10.000	Nuveen LLC '144A' 4.000% 01-Nov-2028	9.786	0,01
10.000	nVent Finance Sarl 4.550% 15-Apr-2028	9.735	0,01
10.000	nVent Finance Sarl 5.650% 15-May-2033	10.174	0,01
15.000	NVR Inc 3.000 % 15-May-2030	13.395	0,02
10.000	NXP BV / NXP Funding LLC 5.350% 01-Mar-2026	10.059	0,01
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 3.150% 01-May-2027	19.012	0,03
10.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 3.250% 11-May-2041	7.654	0,01
30.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 5.000% 15-Jan-2033	30.130	0,04
5.000	NYU Langone Hospitals 3.380% 01-Jul-2055	3.595	0,01
30.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	30.236	0,04
20.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	21.242	0,03
10.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	10.841	0,01
15.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	17.083	0,02
32.000	Occidental Petroleum Corp 8.875 % 15-Jul-2030	37.484	0,05
10.000	Oglethorpe Power Corp 5.050% 01-Oct-2048	9.259	0,01
10.000	Oglethorpe Power Corp 5.375% 01-Nov-2040	9.677	0,01
10.000	Oglethorpe Power Corp '144A' 6.191% 01-Jan-2031	10.210	0,01
20.000	Oglethorpe Power Corp '144A' 6.200% 01-Dec-2053	21.542	0,03
10.000	Omega Healthcare Investors Inc 3.375% 01-Feb-2031	8.516	0,01
15.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 15-Jan-2025	14.759	0,02
20.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 01-Apr-2027	19.212	0,03
25.000	Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc 3.600% 15-Apr-2026	24.373	0,03
10.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 2.750% 15-May-2030	8.962	0,01
15.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 5.250% 30-Sep-2040	15.433	0,02
10.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 7.250% 15-Jan-2033	11.693	0,02
40.000	ONEOK Inc 3.400% 01-Sep-2029	36.924	0,05
20.000	ONEOK Inc 4.000% 13-Jul-2027	19.460	0,03
5.000	ONEOK Inc 4.950% 13-Jul-2047	4.502	0,01
10.000	ONEOK Inc 5.850% 15-Jan-2026	10.158	0,01
50.000	ONEOK Inc 6.050% 01-Sep-2033	53.013	0,07
20.000	ONEOK Inc 7.150% 15-Jan-2051	23.066	0,03
5.000	ONEOK Partners LP 6.125% 01-Feb-2041	5.245	0,01
5.000	ONEOK Partners LP 6.200% 15-Sep-2043	5.263	0,01
5.000	ONEOK Partners LP 6.850% 15-Oct-2037	5.542	0,01
20.000	Open Text Corp '144A' 6.900% 01-Dec-2027	20.808	0,03
15.000	Oracle Corp 2.300% 25-Mar-2028	13.684	0,02
20.000	Oracle Corp 2.500% 01-Apr-2025	19.348	0,03
50.000	Oracle Corp 2.650% 15-Jul-2026	47.453	0,06
10.000	Oracle Corp 2.800% 01-Apr-2027	9.442	0,01
10.000	Oracle Corp 2.875% 25-Mar-2031	8.875	0,01
30.000	Oracle Corp 2.950% 15-May-2025	29.142	0,04
20.000	Oracle Corp 2.950% 01-Apr-2030	18.074	0,02
70.000	Oracle Corp 3.250% 15-Nov-2027	66.559	0,09
10.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2040	8.013	0,01
10.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2050	7.448	0,01
30.000	Oracle Corp 3.650% 25-Mar-2041	23.975	0,03
10.000	Oracle Corp 3.800% 15-Nov-2037	8.530	0,01
30.000	Oracle Corp 3.850% 01-Apr-2060	21.895	0,03
10.000	Oracle Corp 3.900% 15-May-2035	8.947	0,01
20.000	Oracle Corp 3.950% 25-Mar-2051	15.758	0,02
20.000	Oracle Corp 4.000% 15-Jul-2046	16.125	0,02
10.000	Oracle Corp 4.000% 15-Nov-2047	7.941	0,01
20.000	Oracle Corp 4.100% 25-Mar-2061	15.343	0,02
50.000	Oracle Corp 4.900% 06-Feb-2033	49.882	0,07
20.000	Oracle Corp 5.550% 06-Feb-2053	20.110	0,03
10.000	Oracle Corp 6.125% 08-Jul-2039	10.679	0,01
50.000	Oracle Corp 6.250% 09-Nov-2032	54.497	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Oracle Corp 6.500% 15-Apr-2038	22.153	0,03
10.000	Orange SA 5.375% 13-Jan-2042	10.214	0,01
10.000	Orange SA 9.000% 01-Mar-2031	12.360	0,02
20.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 4.000% 04-Oct-2027	19.004	0,03
10.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044	9.084	0,01
10.000	O'Reilly Automotive Inc 3.600% 01-Sep-2027	9.653	0,01
10.000	ORIX Corp 2.250% 09-Mar-2031	8.534	0,01
10.000	ORIX Corp 3.250% 04-Dec-2024	9.807	0,01
15.000	ORIX Corp 3.700% 18-Jul-2027	14.546	0,02
10.000	Otis Worldwide Corp 2.293% 05-Apr-2027	9.331	0,01
10.000	Otis Worldwide Corp 2.565% 15-Feb-2030	8.924	0,01
10.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd '144A' FRN 1.832% 10-Sep-2030	9.411	0,01
50.000	Ovintiv Inc 6.250% 15-Jul-2033	51.824	0,07
10.000	Ovintiv Inc 6.625% 15-Aug-2037	10.409	0,01
20.000	Ovintiv Inc 8.125% 15-Sep-2030	22.627	0,03
10.000	Owens Corning 4.300% 15-Jul-2047	8.806	0,01
10.000	Owens Corning 7.000% 01-Dec-2036	11.535	0,02
60.000	Pacific Gas and Electric Co 2.100% 01-Aug-2027	54.161	0,07
50.000	Pacific Gas and Electric Co 3.150% 01-Jan-2026	47.984	0,06
20.000	Pacific Gas and Electric Co 3.250% 01-Jun-2031	17.368	0,02
10.000	Pacific Gas and Electric Co 3.300% 01-Dec-2027	9.350	0,01
10.000	Pacific Gas and Electric Co 3.300% 01-Aug-2040	7.360	0,01
15.000	Pacific Gas and Electric Co 4.500% 01-Jul-2040	12.747	0,02
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.550% 01-Jul-2030	9.532	0,01
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.600% 15-Jun-2043	8.285	0,01
25.000	Pacific Gas and Electric Co 4.950% 08-Jun-2025	24.858	0,03
50.000	Pacific Gas and Electric Co 5.250% 01-Mar-2052	44.730	0,06
15.000	Pacific Gas and Electric Co 5.900% 15-Jun-2032	15.298	0,02
20.000	Pacific Gas and Electric Co 6.400% 15-Jun-2033	21.103	0,03
20.000	Pacific Life Global Funding II '144A' 1.600% 21-Sep-2028	17.186	0,02
30.000	Pacific LifeCorp '144A' 6.600% 15-Sep-2033	32.891	0,04
10.000	PacifiCorp 5.350% 01-Dec-2053	9.650	0,01
20.000	PacifiCorp 5.500% 15-May-2054	19.729	0,03
30.000	PacifiCorp 5.750% 01-Apr-2037	30.801	0,04
10.000	PacifiCorp 6.000% 15-Jan-2039	10.495	0,01
10.000	PacifiCorp 6.100% 01-Aug-2036	10.732	0,01
10.000	PacifiCorp 7.700% 15-Nov-2031	11.720	0,02
20.000	Packaging Corp of America 5.700% 01-Dec-2033	21.063	0,03
30.000	Palomino Funding Trust I '144A' 7.233% 17-May-2028	31.608	0,04
20.000	Paramount Global 6.875% 30-Apr-2036	20.366	0,03
20.000	Parker-Hannifin Corp 3.250% 01-Mar-2027	19.210	0,03
20.000	Parker-Hannifin Corp 4.100% 01-Mar-2047	17.337	0,02
10.000	PartnerRe Finance B LLC 3.700% 02-Jul-2029	9.487	0,01
10.000	PayPal Holdings Inc 5.250% 01-Jun-2062	9.967	0,01
30.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 1.700% 15-Jun-2026	27.601	0,04
15.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.350% 01-Nov-2029	13.460	0,02
30.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 4.400% 01-Jul-2027	29.295	0,04
15.000	Pentair Finance Sarl 4.500% 01-Jul-2029	14.444	0,02
10.000	PepsiCo Inc 1.950% 21-Oct-2031	8.499	0,01
10.000	PepsiCo Inc 2.750% 19-Mar-2030	9.203	0,01
10.000	PepsiCo Inc 3.500% 19-Mar-2040	8.552	0,01
10.000	PepsiCo Inc 3.875% 19-Mar-2060	8.708	0,01
15.000	PepsiCo Inc 3.900% 18-Jul-2032	14.654	0,02
10.000	PepsiCo Inc 5.500% 15-Jan-2040	10.833	0,01
10.000	Pernod Ricard SA '144A' 5.500% 15-Jan-2042	10.476	0,01
55.000	Pfizer Inc 2.550% 28-May-2040	40.534	0,05
50.000	Pfizer Inc 3.900% 15-Mar-2039	44.390	0,06
10.000	Pfizer Inc 7.200% 15-Mar-2039	12.464	0,02
100.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 4.450% 19-May-2028	100.087	0,14
100.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 4.750% 19-May-2033	100.281	0,14
30.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.110% 19-May-2043	30.005	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
30.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.340% 19-May-2063	30.454	0,04
50.000	Pharmacia LLC 6.600% 01-Dec-2028	54.560	0,07
20.000	Philip Morris International Inc 0.875% 01-May-2026	18.338	0,02
40.000	Philip Morris International Inc 1.750% 01-Nov-2030	33.046	0,04
10.000	Philip Morris International Inc 2.100% 01-May-2030	8.597	0,01
20.000	Philip Morris International Inc 3.125% 17-Aug-2027	19.044	0,03
20.000	Philip Morris International Inc 3.375% 11-Aug-2025	19.525	0,03
40.000	Philip Morris International Inc 3.375% 15-Aug-2029	37.587	0,05
5.000	Philip Morris International Inc 4.375% 15-Nov-2041	4.452	0,01
15.000	Philip Morris International Inc 4.500% 20-Mar-2042	13.505	0,02
30.000	Philip Morris International Inc 4.875% 15-Feb-2028	30.366	0,04
67.000	Philip Morris International Inc 5.125% 15-Feb-2030	68.286	0,09
130.000	Philip Morris International Inc 5.375% 15-Feb-2033	133.552	0,18
10.000	Philip Morris International Inc 5.625% 17-Nov-2029	10.504	0,01
50.000	Philip Morris International Inc 5.625% 07-Sep-2033	52.336	0,07
50.000	Philip Morris International Inc 5.750% 17-Nov-2032	52.578	0,07
25.000	Philip Morris International Inc 6.375% 16-May-2038	28.060	0,04
50.000	Phillips 66 3.900% 15-Mar-2028	48.693	0,07
20.000	Phillips 66 4.650% 15-Nov-2034	19.502	0,03
5.000	Phillips 66 4.875% 15-Nov-2044	4.814	0,01
10.000	Phillips 66 5.875% 01-May-2042	10.838	0,01
10.000	Phillips 66 Co 4.900% 01-Oct-2046	9.393	0,01
5.000	Physicians Realty LP 3.950% 15-Jan-2028	4.772	0,01
20.000	Piedmont Natural Gas Co Inc 3.640% 01-Nov-2046	14.943	0,02
20.000	Piedmont Natural Gas Co Inc 5.400% 15-Jun-2033	20.619	0,03
30.000	Pilgrim's Pride Corp 3.500% 01-Mar-2032	25.401	0,03
20.000	Pine Street Trust I '144A' 4.572% 15-Feb-2029	19.072	0,03
10.000	Pioneer Natural Resources Co 1.125% 15-Jan-2026	9.291	0,01
10.000	Pioneer Natural Resources Co 5.100% 29-Mar-2026	10.079	0,01
20.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 3.550% 15-Dec-2029	18.450	0,03
5.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.300% 31-Jan-2043	4.005	0,01
20.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.900% 15-Feb-2045	17.317	0,02
25.000	PNC Bank NA 'BKNT' 4.200% 01-Nov-2025	24.511	0,03
30.000	PNC Financial Services Group Inc/The 2.550% 22-Jan-2030	26.289	0,04
20.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 4.626% 06-Jun-2033	18.903	0,03
50.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.875% 20-Oct-2034	55.632	0,08
18.696	Polar Tankers Inc '144A' 5.951% 10-May-2037	19.385	0,03
50.000	Polaris Inc 6.950% 15-Mar-2029	53.190	0,07
50.000	Potomac Electric Power Co 4.150% 15-Mar-2043	44.831	0,06
10.000	Principal Financial Group Inc 3.700% 15-May-2029	9.444	0,01
30.000	Principal Financial Group Inc 6.050% 15-Oct-2036	32.273	0,04
10.000	Principal Life Global Funding II '144A' 1.375% 10-Jan-2025	9.609	0,01
5.000	Principal Life Global Funding II '144A' 1.500% 27-Aug-2030	3.980	0,01
10.000	Procter & Gamble Co/The 5.550% 05-Mar-2037	11.233	0,02
10.000	Progress Energy Inc 7.000% 30-Oct-2031	11.325	0,02
10.000	Progress Energy Inc 7.750% 01-Mar-2031	11.565	0,02
5.000	Progressive Corp/The 4.000% 01-Mar-2029	4.945	0,01
50.000	Progressive Corp/The 4.950% 15-Jun-2033	51.438	0,07
50.000	Prologis LP 1.625% 15-Mar-2031	40.586	0,05
10.000	Prologis LP 1.750% 01-Feb-2031	8.323	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Prologis LP 3.375% 15-Dec-2027	9.564	0,01
10.000	Prologis LP 4.375% 01-Feb-2029	9.857	0,01
10.000	Prologis LP 4.625% 15-Jan-2033	10.071	0,01
10.000	Prospect Capital Corp 3.706% 22-Jan-2026	9.366	0,01
10.000	Prosus NV 'REGS' 3.061% 13-Jul-2031	8.097	0,01
10.000	Prosus NV 'REGS' 3.257% 19-Jan-2027	9.241	0,01
10.000	Prosus NV 'REGS' 3.680% 21-Jan-2030	8.775	0,01
10.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	8.643	0,01
20.000	Prosus NV 'REGS' 4.987% 19-Jan-2052	15.070	0,02
10.000	Protective Life Corp '144A' 3.400% 15-Jan-2030	8.861	0,01
5.000	Protective Life Corp '144A' 5.350% 10-Aug-2052	4.562	0,01
10.000	Protective Life Global Funding '144A' 1.303% 20-Sep-2026	9.073	0,01
20.000	Protective Life Global Funding '144A' 5.467% 08-Dec-2028	20.584	0,03
10.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.532% 01-Oct-2029	8.769	0,01
50.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.746% 01-Oct-2026	47.069	0,06
10.000	Prudential Financial Inc FRN 3.700% 01-Oct-2050	8.654	0,01
20.000	Prudential Financial Inc FRN 4.500% 15-Sep-2047	18.575	0,03
10.000	Prudential Financial Inc FRN 5.375% 15-May-2045	9.875	0,01
25.000	Prudential Financial Inc FRN 6.000% 01-Sep-2052	24.942	0,03
5.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 1.500% 10-Mar-2026	4.664	0,01
5.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 2.100% 10-Mar-2030	4.391	0,01
10.000	Prudential Funding Asia Plc 3.125% 14-Apr-2030	9.097	0,01
10.000	Public Service Co of Colorado 1.875% 15-Jun-2031	8.254	0,01
40.000	Public Service Co of Colorado 4.500% 01-Jun-2052	35.246	0,05
10.000	Public Service Co of Colorado 6.500% 01-Aug-2038	11.217	0,02
15.000	Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 3.650% 01-Sep-2042	12.582	0,02
10.000	Public Service Enterprise Group Inc 1.600% 15-Aug-2030	8.218	0,01
10.000	Public Service Enterprise Group Inc 6.125% 15-Oct-2033	10.779	0,01
10.000	Public Storage Operating Co 3.385% 01-May-2029	9.553	0,01
5.000	Public Storage Operating Co 5.100% 01-Aug-2033	51.900	0,07
5.000	Puget Energy Inc 3.650% 15-May-2025	4.877	0,01
10.000	Puget Energy Inc 4.100% 15-Jun-2030	9.192	0,01
11.000	Puget Sound Energy Inc 5.757% 01-Oct-2039	11.349	0,02
30.000	PulteGroup Inc 6.375% 15-May-2033	32.882	0,04
35.000	Qorvo Inc 1.750% 15-Dec-2024	33.570	0,05
20.000	Qorvo Inc 4.375% 15-Oct-2029	18.997	0,03
20.000	QUALCOMM Inc 4.250% 20-May-2032	19.901	0,03
15.000	Quanta Services Inc 2.350% 15-Jan-2032	12.392	0,02
10.000	Quest Diagnostics Inc 2.800% 30-Jun-2031	8.734	0,01
5.000	Quest Diagnostics Inc 2.950% 30-Jun-2030	4.484	0,01
50.000	Radian Group Inc 4.875% 15-Mar-2027	48.375	0,07
30.000	Realty Income Corp 3.400% 15-Jan-2028	28.554	0,04
10.000	Realty Income Corp 3.650% 15-Jan-2028	9.608	0,01
10.000	Realty Income Corp 4.850% 15-Mar-2030	10.066	0,01
10.000	Realty Income Corp 4.875% 01-Jun-2026	10.018	0,01
40.000	Realty Income Corp 5.625% 13-Oct-2032	42.183	0,06
20.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc '144A' 3.000% 26-Jun-2027	19.016	0,03
100.000	Regal Rexnord Corp '144A' 6.050% 15-Feb-2026	101.170	0,14
10.000	Regency Centers LP 3.700% 15-Jun-2030	9.316	0,01
15.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 1.750% 15-Sep-2030	12.360	0,02
5.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 2.800% 15-Sep-2050	3.315	0,00
50.000	Regions Financial Corp 1.800% 12-Aug-2028	42.897	0,06
20.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 2.875% 12-Jan-2032	17.156	0,02
10.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 3.750% 12-Jan-2062	7.261	0,01
15.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 4.125% 28-Jan-2025	14.818	0,02
10.000	Reliance Standard Life Global Funding II '144A' 2.750% 21-Jan-2027	9.203	0,01
10.000	Reliance Standard Life Global Funding II '144A' 5.243% 02-Feb-2026	9.923	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	RELX Capital Inc 4.750% 20-May-2032	5.064	0,01
16.000	RenaissanceRe Holdings Ltd 5.750% 05-Jun-2033	16.177	0,02
5.000	Republic Services Inc 2.300% 01-Mar-2030	4.411	0,01
10.000	Republic Services Inc 2.900% 01-Jul-2026	9.610	0,01
15.000	Republic Services Inc 3.375% 15-Nov-2027	14.431	0,02
150.000	Republic Services Inc 4.875% 01-Apr-2029	153.039	0,21
10.000	Republic Services Inc 6.200% 01-Mar-2040	11.240	0,02
10.000	Rewity Inc 3.300% 15-Sep-2029	9.090	0,01
7.000	Reynolds American Inc 4.450% 12-Jun-2025	6.927	0,01
5.000	Reynolds American Inc 5.850% 15-Aug-2045	4.702	0,01
5.000	Reynolds American Inc 7.250% 15-Jun-2037	5.460	0,01
10.000	RGA Global Funding '144A' 2.000% 30-Nov-2026	9.158	0,01
20.000	Rio Tinto Alcan Inc 5.750% 01-Jun-2035	21.292	0,03
50.000	Rio Tinto Alcan Inc 6.125% 15-Dec-2033	54.956	0,07
25.000	Rio Tinto Finance USA Ltd 5.200% 02-Nov-2040	25.864	0,04
10.000	Roche Holdings Inc '144A' 1.930% 13-Dec-2028	8.944	0,01
15.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.076% 13-Dec-2031	12.659	0,02
20.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.314% 10-Mar-2027	18.839	0,03
10.000	Roche Holdings Inc '144A' 7.000% 01-Mar-2039	12.341	0,02
50.000	Rockwell Automation Inc 2.800% 15-Aug-2061	32.565	0,04
10.000	Rogers Communications Inc 2.900% 15-Nov-2026	9.493	0,01
30.000	Rogers Communications Inc 4.300% 15-Feb-2048	25.145	0,03
10.000	Rogers Communications Inc 4.500% 15-Mar-2043	8.852	0,01
20.000	Rogers Communications Inc 5.450% 01-Oct-2043	19.508	0,03
10.000	Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	9.621	0,01
20.000	Roper Technologies Inc 1.750% 15-Feb-2031	16.516	0,02
10.000	Roper Technologies Inc 2.950% 15-Sep-2029	9.181	0,01
10.000	Royal Bank of Canada 1.200% 27-Apr-2026	9.246	0,01
20.000	Royal Bank of Canada 3.375% 14-Apr-2025	19.611	0,03
30.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 1.600% 21-Jan-2025	28.962	0,04
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2.300% 03-Nov-2031	42.234	0,06
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.240% 03-Aug-2027	49.487	0,07
20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.650% 27-Jan-2026	19.850	0,03
120.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 5.000% 02-May-2033	122.640	0,17
70.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 5.200% 01-Aug-2028	71.527	0,10
15.000	Royal Bank of Canada 'MTN' 1.150% 10-Jun-2025	14.230	0,02
100.000	Royal Bank of Canada 'MTN' 6.000% 01-Nov-2027	104.911	0,14
20.000	Royalty Pharma Plc 1.200% 02-Sep-2025	18.680	0,03
10.000	Royalty Pharma Plc 2.200% 02-Sep-2030	8.430	0,01
10.000	Royalty Pharma Plc 3.550% 02-Sep-2050	7.123	0,01
15.000	RPM International Inc 4.550% 01-Mar-2029	14.807	0,02
5.000	RPM International Inc 5.250% 01-Jun-2045	4.741	0,01
20.000	RTX Corp 2.650% 01-Nov-2026	18.940	0,03
40.000	RTX Corp 3.030% 15-Mar-2052	27.750	0,04
20.000	RTX Corp 3.500% 15-Mar-2027	19.294	0,03
5.000	RTX Corp 4.150% 15-May-2045	4.295	0,01
30.000	RTX Corp 4.450% 16-Nov-2038	27.698	0,04
50.000	RTX Corp 4.500% 01-Jun-2042	45.613	0,06
10.000	RTX Corp 4.625% 16-Nov-2048	9.173	0,01
50.000	RTX Corp 4.700% 15-Dec-2041	46.463	0,06
5.000	RTX Corp 4.875% 15-Oct-2040	4.756	0,01
5.000	RTX Corp 5.700% 15-Apr-2040	5.205	0,01
5.000	Rush Obligated Group 3.922% 15-Nov-2029	4.759	0,01
20.000	Ryder System Inc 'MTN' 5.250% 01-Jun-2028	20.293	0,03
5.000	S&P Global Inc 2.300% 15-Aug-2060	3.016	0,00
20.000	S&P Global Inc 2.700% 01-Mar-2029	18.526	0,03
10.000	S&P Global Inc 2.900% 01-Mar-2032	8.943	0,01
20.000	S&P Global Inc 2.950% 22-Jan-2027	19.115	0,03
20.000	S&P Global Inc 4.750% 01-Aug-2028	20.364	0,03
10.000	Sabal Trail Transmission LLC '144A' 4.682% 01-May-2038	9.398	0,01
30.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.200% 15-Mar-2028	29.420	0,04
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.500% 15-May-2030	9.784	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.000% 15-Mar-2027	10.052	0,01
5.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30-Jun-2026	5.094	0,01
10.000	Sabra Health Care LP 5.125% 15-Aug-2026	9.835	0,01
5.000	Salesforce Inc 1.950% 15-Jul-2031	4.281	0,01
5.000	Salesforce Inc 2.700% 15-Jul-2041	3.836	0,01
10.000	Salesforce Inc 3.050% 15-Jul-2061	7.060	0,01
10.000	Sammons Financial Group Inc '144A' 3.350% 16-Apr-2031	8.051	0,01
50.000	Sammons Financial Group Inc '144A' 4.450% 12-May-2027	47.282	0,06
4.000	San Diego Gas & Electric Co 1.700% 01-Oct-2030	3.313	0,00
50.000	San Diego Gas & Electric Co 4.100% 15-Jun-2049	41.547	0,06
20.000	Sands China Ltd 3.500% 08-Aug-2031	16.776	0,02
50.000	Sands China Ltd 5.375% 08-Aug-2025	49.343	0,07
20.000	Santander Holdings USA Inc 3.450% 02-Jun-2025	19.432	0,03
10.000	Santander Holdings USA Inc 4.400% 13-Jul-2027	9.728	0,01
30.000	Santander Holdings USA Inc FRN 6.499% 09-Mar-2029	31.041	0,04
40.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 1.532% 21-Aug-2026	37.339	0,05
30.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 1.673% 14-Jun-2027	27.303	0,04
20.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 2.896% 15-Mar-2032	17.122	0,02
30.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 6.534% 10-Jan-2029	31.097	0,04
20.000	Santos Finance Ltd '144A' 3.649% 29-Apr-2031	17.449	0,02
20.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A' 3.500% 12-Feb-2025	19.582	0,03
10.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A' 4.375% 28-May-2030	9.521	0,01
20.000	Scentre Group Trust 2 '144A' FRN 4.750% 24-Sep-2080	18.753	0,03
20.000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 4.300% 01-May-2029	19.823	0,03
10.000	Sealed Air Corp '144A' 1.573% 15-Oct-2026	9.016	0,01
20.000	Securian Financial Group Inc '144A' 4.800% 15-Apr-2048	16.741	0,02
60.000	Sempra 3.250% 15-Jun-2027	56.947	0,08
5.000	Sempra 4.000% 01-Feb-2048	4.137	0,01
25.000	Sempra 6.000% 15-Oct-2039	26.478	0,04
10.000	ServiceNow Inc 1.400% 01-Sep-2030	8.242	0,01
100.000	Shell International Finance BV 6.375% 15-Dec-2038	115.569	0,16
10.000	Sherwin-Williams Co/The 3.800% 15-Aug-2049	8.033	0,01
10.000	Sherwin-Williams Co/The 4.550% 01-Aug-2045	9.012	0,01
10.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 3.750% 20-Sep-2027	9.438	0,01
20.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 3.875% 24-Mar-2026	19.279	0,03
20.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.200% 23-Sep-2026	19.251	0,03
5.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 1.200% 11-Mar-2026	4.652	0,01
20.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.150% 11-Mar-2031	17.089	0,02
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.350% 15-Oct-2026	9.454	0,01
5.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.875% 11-Mar-2041	3.931	0,01
45.000	Sigma Alimentos SA de CV 'REGS' 4.125% 02-May-2026	43.889	0,06
50.000	Simon Property Group LP 2.250% 15-Jan-2032	41.629	0,06
20.000	Simon Property Group LP 2.450% 13-Sep-2029	17.841	0,02
10.000	Simon Property Group LP 3.500% 01-Sep-2025	9.776	0,01
20.000	Simon Property Group LP 5.500% 08-Mar-2033	20.718	0,03
10.000	Simon Property Group LP 6.750% 01-Feb-2040	11.332	0,02
5.000	SiriusPoint Ltd '144A' 4.600% 01-Nov-2026	4.641	0,01
10.000	SITE Centers Corp 4.700% 01-Jun-2027	9.857	0,01
20.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV 'REGS' 5.375% 04-Apr-2032	18.602	0,03
200.000	SK Battery America Inc 2.125% 26-Jan-2026	184.972	0,25
20.000	SK Hynix Inc 'REGS' 1.500% 19-Jan-2026	18.426	0,03
20.000	SK Hynix Inc 'REGS' 6.375% 17-Jan-2028	20.672	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB '144A' 1.200% 09-Sep-2026	9.084	0,01
10.000	Skyworks Solutions Inc 1.800% 01-Jun-2026	9.283	0,01
10.000	Smithfield Foods Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2027	9.600	0,01
50.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 6.500% 07-Nov-2033	53.150	0,07
15.000	Societe Generale SA '144A' 4.250% 14-Apr-2025	14.669	0,02
40.000	Societe Generale SA '144A' 4.250% 19-Aug-2026	38.463	0,05
10.000	Societe Generale SA '144A' 4.677% 15-Jun-2027	9.920	0,01
12.000	Societe Generale SA '144A' 4.750% 14-Sep-2028	11.863	0,02
30.000	Societe Generale SA '144A' 5.625% 24-Nov-2045	26.594	0,04
40.000	Societe Generale SA '144A' FRN 1.488% 14-Dec-2026	36.860	0,05
30.000	Societe Generale SA '144A' FRN 6.221% 15-Jun-2033	30.018	0,04
10.000	Sodexo Inc '144A' 2.718% 16-Apr-2031	8.517	0,01
7.776	Solar Star Funding LLC '144A' 5.375% 30-Jun-2035	7.720	0,01
10.000	Sonoco Products Co 1.800% 01-Feb-2025	9.627	0,01
10.000	Sonoco Products Co 3.125% 01-May-2030	9.036	0,01
10.000	Southern California Edison Co 1.200% 01-Feb-2026	9.320	0,01
10.000	Southern California Edison Co 2.850% 01-Aug-2029	9.133	0,01
20.000	Southern California Edison Co 4.050% 15-Mar-2042	16.981	0,02
35.000	Southern California Edison Co 4.650% 01-Oct-2043	32.056	0,04
30.000	Southern California Edison Co 5.300% 01-Mar-2028	30.847	0,04
20.000	Southern California Edison Co 5.625% 01-Feb-2036	20.445	0,03
10.000	Southern California Edison Co 5.875% 01-Dec-2053	10.823	0,01
20.000	Southern California Edison Co 5.950% 01-Nov-2032	21.536	0,03
10.000	Southern California Edison Co 5.950% 01-Feb-2038	10.543	0,01
5.000	Southern California Gas Co 2.550% 01-Feb-2030	4.408	0,01
5.000	Southern California Gas Co 3.750% 15-Sep-2042	4.052	0,01
10.000	Southern California Gas Co 5.200% 01-Jun-2033	10.311	0,01
10.000	Southern Co Gas Capital Corp 1.750% 15-Jan-2031	8.196	0,01
10.000	Southern Co Gas Capital Corp 4.400% 01-Jun-2043	8.507	0,01
10.000	Southern Co/The 1.750% 15-Mar-2028	8.909	0,01
50.000	Southern Co/The 3.250% 01-Jul-2026	48.283	0,07
30.000	Southern Co/The 3.700% 30-Apr-2030	28.322	0,04
10.000	Southern Co/The 4.400% 01-Jul-2046	8.857	0,01
20.000	Southern Co/The 5.200% 15-Jun-2033	20.455	0,03
10.000	Southern Copper Corp 3.875% 23-Apr-2025	9.834	0,01
20.000	Southern Copper Corp 5.250% 08-Nov-2042	19.401	0,03
5.000	Southern Copper Corp 5.875% 23-Apr-2045	5.110	0,01
5.000	Southern Copper Corp 6.750% 16-Apr-2040	5.606	0,01
10.000	Southern Power Co 5.150% 15-Sep-2041	9.524	0,01
5.000	Southwest Gas Corp 3.180% 15-Aug-2051	3.314	0,00
10.000	Southwestern Electric Power Co 1.650% 15-Mar-2026	9.319	0,01
25.000	Southwestern Electric Power Co 3.900% 01-Apr-2045	19.354	0,03
10.000	Southwestern Electric Power Co 6.200% 15-Mar-2040	10.693	0,01
50.000	Southwestern Public Service Co 3.400% 15-Aug-2046	36.338	0,05
25.000	Spirit Realty LP 3.200% 15-Jan-2027	23.688	0,03
20.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	21.671	0,03
50.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	61.786	0,08
5.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20-Mar-2025	4.960	0,01
8.500	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 5.152% 20-Mar-2028	8.470	0,01
10.000	St Marys Cement Inc Canada '144A' 5.750% 28-Jan-2027	10.138	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Standard Chartered Bank '144A' 8.000% 30-May-2031	5.526	0,01
20.000	Standard Chartered Plc '144A' 4.050% 12-Apr-2026	19.490	0,03
5.000	Standard Chartered Plc '144A' 5.300% 09-Jan-2043	4.532	0,01
10.000	Standard Chartered Plc '144A' 5.700% 26-Mar-2044	9.822	0,01
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 1.822% 23-Nov-2025	9.634	0,01
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.678% 29-Jun-2032	8.139	0,01
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.819% 30-Jan-2026	19.348	0,03
30.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 3.265% 18-Feb-2036	24.607	0,03
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.644% 01-Apr-2031	18.904	0,03
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.866% 15-Mar-2033	18.847	0,03
30.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 6.301% 09-Jan-2029	30.782	0,04
5.000	Stanford Health Care 3.310% 15-Aug-2030	4.609	0,01
10.000	Stanley Black & Decker Inc 2.750% 15-Nov-2050	6.202	0,01
10.000	Stanley Black & Decker Inc 5.200% 01-Sep-2040	9.688	0,01
5.000	Starbucks Corp 3.750% 01-Dec-2047	4.045	0,01
10.000	Starbucks Corp 4.300% 15-Jun-2045	8.900	0,01
10.000	Starbucks Corp 4.500% 15-Nov-2048	9.177	0,01
20.000	State Street Corp FRN 3.031% 01-Nov-2034	17.922	0,02
50.000	State Street Corp FRN 5.684% 21-Nov-2029	51.765	0,07
50.000	State Street Corp FRN 6.123% 21-Nov-2034	53.181	0,07
45.000	Steel Dynamics Inc 1.650% 15-Oct-2027	40.115	0,05
20.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 1.711% 29-Jan-2027	18.183	0,02
20.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 6.375% 12-Sep-2032	21.601	0,03
50.000	STERIS Irish FinCo UnLtd Co 2.700% 15-Mar-2031	43.109	0,06
10.000	Stifel Financial Corp 4.000% 15-May-2030	9.099	0,01
5.000	STORE Capital Corp 4.500% 15-Mar-2028	4.606	0,01
5.000	Stryker Corp 3.375% 01-Nov-2025	4.870	0,01
5.000	Stryker Corp 3.500% 15-Mar-2026	4.881	0,01
20.000	Stryker Corp 3.650% 07-Mar-2028	19.373	0,03
10.000	Stryker Corp 4.625% 15-Mar-2046	9.617	0,01
10.000	Sumitomo Life Insurance Co '144A' FRN 3.375% 15-Apr-2081	8.559	0,01
30.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.402% 17-Sep-2026	27.346	0,04
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.474% 08-Jul-2025	9.468	0,01
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.130% 08-Jul-2030	8.446	0,01
85.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.472% 14-Jan-2029	75.778	0,10
13.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.040% 16-Jul-2029	11.841	0,02
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.364% 12-Jul-2027	9.537	0,01
50.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 5.520% 13-Jan-2028	51.251	0,07
50.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 5.766% 13-Jan-2033	52.908	0,07
20.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A' 1.050% 12-Sep-2025	18.668	0,03
10.000	Summit Digital Infrastructure Ltd 'REGS' 2.875% 12-Aug-2031	8.223	0,01
10.000	Sun Communities Operating LP 5.700% 15-Jan-2033	10.160	0,01
10.000	Suncor Energy Inc 4.000% 15-Nov-2047	7.975	0,01
20.000	Suncor Energy Inc 6.500% 15-Jun-2038	21.461	0,03
10.000	Suncor Energy Inc 6.800% 15-May-2038	10.981	0,01
10.000	Sutter Health 1.321% 15-Aug-2025	9.376	0,01
10.000	Sutter Health 2.294% 15-Aug-2030	8.588	0,01
10.000	Suzano Austria GmbH 2.500% 15-Sep-2028	8.786	0,01
7.000	Suzano Austria GmbH 3.750% 15-Jan-2031	6.146	0,01
20.000	Suzano Austria GmbH 6.000% 15-Jan-2029	20.462	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Suzano Austria GmbH 'REGS' 7.000% 16-Mar-2047	10.588	0,01
20.000	Svenska Handelsbanken AB '144A' 3.950% 10-Jun-2027	19.481	0,03
20.000	Svenska Handelsbanken AB '144A' 5.500% 15-Jun-2028	20.363	0,03
20.000	Swedbank AB '144A' 3.356% 04-Apr-2025	19.592	0,03
20.000	Swedbank AB '144A' 5.337% 20-Sep-2027	20.049	0,03
5.000	Swiss Re Treasury US Corp '144A' 4.250% 06-Dec-2042	4.311	0,01
10.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd '144A' 3.375% 30-Apr-2025	9.759	0,01
30.000	Synchrony Bank 5.625% 23-Aug-2027	29.535	0,04
10.000	Synchrony Financial 2.875% 28-Oct-2031	8.036	0,01
40.000	Synchrony Financial 3.950% 01-Dec-2027	37.452	0,05
20.000	Synchrony Financial 4.500% 23-Jul-2025	19.552	0,03
20.000	Sysco Corp 3.300% 15-Jul-2026	19.325	0,03
30.000	Sysco Corp 4.500% 01-Apr-2046	26.762	0,04
10.000	Sysco Corp 5.950% 01-Apr-2030	10.652	0,01
15.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.025% 09-Jul-2040	11.571	0,02
20.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.375% 09-Jul-2060	14.096	0,02
15.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 5.000% 26-Nov-2028	15.246	0,02
10.000	Take-Two Interactive Software Inc 4.000% 14-Apr-2032	9.519	0,01
10.000	Tanger Properties LP 2.750% 01-Sep-2031	8.071	0,01
10.000	Tanger Properties LP 3.125% 01-Sep-2026	9.344	0,01
10.000	Tapestry Inc 4.125% 15-Jul-2027	9.519	0,01
100.000	Tapestry Inc 7.350% 27-Nov-2028	105.071	0,14
36.000	Tapestry Inc 7.700% 27-Nov-2030	37.986	0,05
38.000	Tapestry Inc 7.850% 27-Nov-2033	40.653	0,05
20.000	Targa Resources Corp 5.200% 01-Jul-2027	20.113	0,03
10.000	Targa Resources Corp 6.500% 15-Feb-2053	10.871	0,01
20.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.000% 15-Jan-2032	18.320	0,02
40.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	41.346	0,06
10.000	TC PipeLines LP 4.375% 13-Mar-2025	9.866	0,01
20.000	TD SYNEX Corp 1.750% 09-Aug-2026	18.172	0,02
20.000	TD SYNEX Corp 2.650% 09-Aug-2031	16.214	0,02
50.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America '144A' 6.850% 16-Dec-2039	57.959	0,08
10.000	Teck Resources Ltd 5.400% 01-Feb-2043	9.597	0,01
50.000	Teledyne Technologies Inc 1.600% 01-Apr-2026	46.389	0,06
20.000	Teledyne Technologies Inc 2.250% 01-Apr-2028	18.125	0,02
20.000	Teledyne Technologies Inc 2.750% 01-Apr-2031	17.441	0,02
50.000	Telefonica Emisiones SA 5.213% 08-Mar-2047	46.526	0,06
50.000	TELLUS Corp 3.400% 13-May-2032	44.619	0,06
30.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 1.810% 26-Jan-2026	28.116	0,04
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2.390% 03-Jun-2030	8.537	0,01
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2.880% 22-Apr-2031	8.654	0,01
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.290% 03-Jun-2060	6.373	0,01
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.595% 19-Jan-2028	9.527	0,01
50.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.800% 11-Feb-2025	49.238	0,07
20.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.925% 19-Jan-2038	17.050	0,02
20.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	19.057	0,03
20.000	Tencent Music Entertainment Group 2.000% 03-Sep-2030	16.256	0,02
5.000	Texas Eastern Transmission LP 7.000% 15-Jul-2032	5.627	0,01
10.000	Texas Instruments Inc 1.750% 04-May-2030	8.645	0,01
10.000	Texas Instruments Inc 3.875% 15-Mar-2039	9.266	0,01
10.000	Texas Instruments Inc 5.050% 18-May-2063	10.309	0,01
10.000	Textron Inc 3.375% 01-Mar-2028	9.461	0,01
8.000	Textron Inc 3.650% 15-Mar-2027	7.688	0,01
20.000	Textron Inc 6.100% 15-Nov-2033	21.368	0,03
20.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.500% 18-Jun-2030	16.958	0,02
10.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 5.375% 20-Nov-2048	9.149	0,01
20.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.000% 15-Oct-2031	16.929	0,02
10.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.600% 01-Oct-2029	9.123	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Thomas Jefferson University 3.847% 01-Nov-2057	3.766	0,01
5.000	Thomson Reuters Corp 5.500% 15-Aug-2035	5.177	0,01
5.000	Thomson Reuters Corp 5.850% 15-Apr-2040	5.211	0,01
10.000	Time Warner Cable Enterprises LLC 8.375% 15-Jul-2033	11.599	0,02
15.000	Time Warner Cable LLC 5.500% 01-Sep-2041	13.033	0,02
5.000	Time Warner Cable LLC 5.875% 15-Nov-2040	4.547	0,01
30.000	Time Warner Cable LLC 6.550% 01-May-2037	29.658	0,04
40.000	T-Mobile USA Inc 1.500% 15-Feb-2026	37.268	0,05
50.000	T-Mobile USA Inc 2.050 % 15-Feb-2028	45.179	0,06
20.000	T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026	18.964	0,03
40.000	T-Mobile USA Inc 2.550% 15-Feb-2031	34.512	0,05
20.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Feb-2029	18.026	0,02
30.000	T-Mobile USA Inc 3.000% 15-Feb-2041	22.553	0,03
90.000	T-Mobile USA Inc 3.300 % 15-Feb-2051	65.389	0,09
20.000	T-Mobile USA Inc 3.600% 15-Nov-2060	14.578	0,02
60.000	T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027	58.277	0,08
10.000	T-Mobile USA Inc 4.375 % 15-Apr-2040	9.058	0,01
10.000	T-Mobile USA Inc 4.500% 15-Apr-2050	8.881	0,01
20.000	T-Mobile USA Inc 5.050% 15-Jul-2033	20.201	0,03
20.000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15-Mar-2027	19.930	0,03
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.250% 13-Dec-2024	9.628	0,01
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 3.766% 06-Jun-2025	19.691	0,03
15.000	Toronto-Dominion Bank/The 4.108% 08-Jun-2027	14.733	0,02
60.000	Toronto-Dominion Bank/The FRN 3.625% 15-Sep-2031	57.621	0,08
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 3.200% 10-Mar-2032	17.759	0,02
20.000	Toyota Motor Credit Corp 4.550% 17-May-2030	20.167	0,03
50.000	Toyota Motor Credit Corp 5.550% 20-Nov-2030	52.774	0,07
50.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 4.550% 20-Sep-2027	50.455	0,07
5.000	Trane Technologies Financing Ltd 4.650% 01-Nov-2044	4.655	0,01
5.000	Trane Technologies Global Holding Co Ltd 5.750% 15-Jun-2043	5.376	0,01
10.000	Trans-Allegheny Interstate Line Co '144A' 3.850% 01-Jun-2025	9.803	0,01
40.000	Transatlantic Holdings Inc 8.000% 30-Nov-2039	51.940	0,07
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.250% 15-May-2028	9.752	0,01
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.625% 01-Mar-2034	9.493	0,01
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.875% 15-May-2048	18.483	0,03
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 5.850% 15-Mar-2036	10.294	0,01
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 7.625% 15-Jan-2039	24.059	0,03
20.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.850% 01-Feb-2026	20.963	0,03
10.000	Transurban Finance Co Pty Ltd '144A' 3.375% 22-Mar-2027	9.495	0,01
10.000	Travelers Cos Inc/The 'MTN' 6.250% 15-Jun-2037	11.376	0,02
20.000	Trimble Inc 4.900% 15-Jun-2028	20.141	0,03
10.000	Trimble Inc 6.100% 15-Mar-2033	10.701	0,01
20.000	Trinity Acquisition Plc 4.400% 15-Mar-2026	19.768	0,03
5.000	Tri-State Generation and Transmission Association Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2040	4.798	0,01
10.000	Triton Container International Ltd / TAL International Container Corp 3.250% 15-Mar-2032	8.024	0,01
5.000	Triton Container International Ltd '144A' 2.050% 15-Apr-2026	4.577	0,01
15.000	Truist Bank 'BKNT' 2.250% 11-Mar-2030	12.424	0,02
50.000	Truist Financial Corp 4.000% 01-May-2025	49.187	0,07
25.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 4.260% 28-Jul-2026	24.505	0,03
20.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.122% 26-Jan-2034	19.457	0,03
50.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.047% 08-Jun-2027	50.921	0,07
10.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	10.406	0,01
20.000	TSMC Arizona Corp 1.750% 25-Oct-2026	18.424	0,03
5.000	TSMC Arizona Corp 3.125% 25-Oct-2041	4.020	0,01
10.000	TSMC Arizona Corp 3.875% 22-Apr-2027	9.792	0,01
10.000	TSMC Arizona Corp 4.125% 22-Apr-2029	9.822	0,01
30.000	TSMC Arizona Corp 4.250% 22-Apr-2032	29.686	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	TSMC Global Ltd 'REGS' 0.750% 28-Sep-2025	18.594	0,03
10.000	TSMC Global Ltd 'REGS' 1.375% 28-Sep-2030	8.129	0,01
50.000	TTX Co '144A' 5.750% 22-Nov-2033	53.546	0,07
10.000	Tucson Electric Power Co 1.500% 01-Aug-2030	8.124	0,01
20.000	TWDC Enterprises 18 Corp 7.000% 01-Mar-2032	23.394	0,03
10.000	Tyco Electronics Group SA 2.500% 04-Feb-2032	8.672	0,01
10.000	Tyco Electronics Group SA 3.700% 15-Feb-2026	9.801	0,01
45.000	Tyson Foods Inc 3.550% 02-Jun-2027	42.943	0,06
10.000	Tyson Foods Inc 4.350% 01-Mar-2029	9.733	0,01
10.000	Tyson Foods Inc 4.550% 02-Jun-2047	8.416	0,01
5.000	Tyson Foods Inc 5.100% 28-Sep-2048	4.561	0,01
50.000	UBS AG/London '144A' 1.375% 13-Jan-2025	48.084	0,06
50.000	UBS Group AG '144A' 4.125% 24-Sep-2025	48.959	0,07
10.000	UBS Group AG '144A' 4.125% 15-Apr-2026	9.766	0,01
10.000	UBS Group AG '144A' 4.253% 23-Mar-2028	9.665	0,01
50.000	UBS Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028	48.469	0,07
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 1.494% 10-Aug-2027	18.088	0,02
60.000	UBS Group AG '144A' FRN 2.746% 11-Feb-2033	49.343	0,07
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 3.126% 13-Aug-2030	17.884	0,02
15.000	UBS Group AG '144A' FRN 3.179% 11-Feb-2043	11.165	0,02
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.703% 05-Aug-2027	19.732	0,03
50.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.988% 05-Aug-2033	48.447	0,07
50.000	UBS Group AG '144A' FRN 6.442% 11-Aug-2028	51.987	0,07
50.000	UDR Inc 3.000 % 15-Aug-2031	44.304	0,06
5.000	UDR Inc 3.100% 01-Nov-2034	4.149	0,01
10.000	UDR Inc 'MTN' 2.950% 01-Sep-2026	9.504	0,01
10.000	UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	8.471	0,01
5.000	UMass Memorial Health Care Obligated Group 5.363% 01-Jul-2052	5.048	0,01
10.000	UniCredit SpA '144A' 4.625% 12-Apr-2027	9.772	0,01
10.000	UniCredit SpA '144A' FRN 1.982% 03-Jun-2027	9.154	0,01
10.000	UniCredit SpA '144A' FRN 2.569% 22-Sep-2026	9.411	0,01
5.000	Unilever Capital Corp 1.375% 14-Sep-2030	4.130	0,01
10.000	Unilever Capital Corp 1.750% 12-Aug-2031	8.329	0,01
10.000	Unilever Capital Corp 2.125% 06-Sep-2029	8.938	0,01
20.000	Unilever Capital Corp 3.500% 22-Mar-2028	19.432	0,03
10.000	Union Electric Co 8.450% 15-Mar-2039	13.181	0,02
50.000	Union Pacific Corp 2.800% 14-Feb-2032	44.468	0,06
30.000	Union Pacific Corp 2.973% 16-Sep-2062	20.256	0,03
15.000	Union Pacific Corp 3.839% 20-Mar-2060	12.315	0,02
10.000	Union Pacific Corp 3.850% 14-Feb-2072	8.004	0,01
40.000	Union Pacific Corp 4.100% 15-Sep-2067	33.395	0,05
30.000	Union Pacific Corp 'MTN' 3.550% 15-Aug-2039	25.829	0,03
20.000	United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust 5.800% 15-Jan-2036	20.396	0,03
10.000	United Overseas Bank Ltd '144A' FRN 3.863% 07-Oct-2032	9.575	0,01
5.000	United Parcel Service Inc 6.200% 15-Jan-2038	5.743	0,01
4.000	UnitedHealth Group Inc 2.950% 15-Oct-2027	3.802	0,01
20.000	UnitedHealth Group Inc 3.450% 15-Jan-2027	19.498	0,03
20.000	UnitedHealth Group Inc 3.850% 15-Jun-2028	19.594	0,03
40.000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15-Aug-2059	32.779	0,04
30.000	UnitedHealth Group Inc 5.350% 15-Feb-2033	31.789	0,04
20.000	UnitedHealth Group Inc 5.800% 15-Mar-2036	21.923	0,03
10.000	UnitedHealth Group Inc 6.050% 15-Feb-2063	11.599	0,02
40.000	UnitedHealth Group Inc 6.875% 15-Feb-2038	48.437	0,07
10.000	Universal Health Services Inc 1.650% 01-Sep-2026	9.106	0,01
10.000	Universal Health Services Inc 2.650% 15-Jan-2032	8.227	0,01
20.000	University of Southern California 3.028% 01-Oct-2039	16.555	0,02
5.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	3.115	0,00
10.000	Unum Group 4.125% 15-Jun-2051	7.538	0,01
10.000	Unum Group 5.750% 15-Aug-2042	9.787	0,01
20.000	UPMC 5.035% 15-May-2033	20.334	0,03
30.000	US Bancorp FRN 4.653% 01-Feb-2029	29.570	0,04
20.000	US Bancorp FRN 5.727% 21-Oct-2026	20.145	0,03
25.000	US Bancorp 'MTN' FRN 4.548% 22-Jul-2028	24.661	0,03
20.000	US Bancorp 'MTN' FRN 4.967% 22-Jul-2033	19.007	0,03
18.000	US Bank NA/Cincinnati OH 'BKNT' 2.800% 27-Jan-2025	17.532	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
50.000	Utah Acquisition Sub Inc 3.950% 15-Jun-2026	48.357	0,07
50.000	Vale Overseas Ltd 6.125% 12-Jun-2033	51.949	0,07
50.000	Vale Overseas Ltd 6.875% 21-Nov-2036	54.607	0,07
10.000	Vale Overseas Ltd 6.875% 10-Nov-2039	10.990	0,01
15.000	Valero Energy Corp 4.900% 15-Mar-2045	13.856	0,02
5.000	Valmont Industries Inc 5.000% 01-Oct-2044	4.530	0,01
10.000	Var Energi ASA '144A' 7.500% 15-Jan-2028	10.614	0,01
15.000	Ventas Realty LP 4.000% 01-Mar-2028	14.362	0,02
35.000	Ventas Realty LP 4.125% 15-Jan-2026	34.161	0,05
10.000	Ventas Realty LP 5.700% 30-Sep-2043	9.706	0,01
20.000	Verisk Analytics Inc 5.500% 15-Jun-2045	19.846	0,03
60.000	Verizon Communications Inc 1.750% 20-Jan-2031	49.310	0,07
30.000	Verizon Communications Inc 2.100% 22-Mar-2028	27.176	0,04
21.000	Verizon Communications Inc 2.550% 21-Mar-2031	18.139	0,02
20.000	Verizon Communications Inc 2.650% 20-Nov-2040	14.473	0,02
10.000	Verizon Communications Inc 2.875% 20-Nov-2050	6.824	0,01
20.000	Verizon Communications Inc 3.150% 22-Mar-2030	18.313	0,02
15.000	Verizon Communications Inc 3.400% 22-Mar-2041	11.992	0,02
50.000	Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051	38.624	0,05
50.000	Verizon Communications Inc 3.700% 22-Mar-2061	38.293	0,05
65.000	Verizon Communications Inc 4.125% 16-Mar-2027	64.119	0,09
20.000	Verizon Communications Inc 4.329% 21-Sep-2028	19.819	0,03
70.000	Verizon Communications Inc 5.500% 16-Mar-2047	73.285	0,10
50.000	Verizon Communications Inc 6.400% 15-Sep-2033	55.705	0,08
15.000	Verizon Communications Inc 6.550% 15-Sep-2043	17.371	0,02
10.000	Viatis Inc 1.650% 22-Jun-2025	9.474	0,01
20.000	Viatis Inc 2.700% 22-Jun-2030	16.935	0,02
10.000	Viatis Inc 3.850% 22-Jun-2040	7.470	0,01
30.000	Viatis Inc 4.000% 22-Jun-2050	21.220	0,03
20.000	VICI Properties LP 4.950% 15-Feb-2030	19.376	0,03
40.000	VICI Properties LP 5.125% 15-May-2032	39.038	0,05
5.000	VICI Properties LP 5.625% 15-May-2052	4.808	0,01
20.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.250% 01-Dec-2026	19.268	0,03
20.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2025	19.658	0,03
20.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029	18.871	0,03
55.000	Vinci SA '144A' 3.750% 10-Apr-2029	53.084	0,07
10.000	Virginia Electric and Power Co 2.400% 30-Mar-2032	8.444	0,01
20.000	Virginia Electric and Power Co 4.200% 15-May-2045	17.186	0,02
30.000	Virginia Electric and Power Co 5.450% 01-Apr-2053	31.076	0,04
50.000	Visa Inc 2.700% 15-Apr-2040	38.764	0,05
20.000	Visa Inc 2.750% 15-Sep-2027	19.070	0,03
5.000	Visa Inc 4.150% 14-Dec-2035	4.913	0,01
10.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.125% 13-May-2025	9.909	0,01
310.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 6.950% 15-Oct-2033	326.822	0,44
10.000	Viterra Finance BV '144A' 2.000% 21-Apr-2026	9.293	0,01
30.000	Viterra Finance BV '144A' 3.200% 21-Apr-2031	25.921	0,04
25.000	VMware LLC 1.400% 15-Aug-2026	22.886	0,03
20.000	VMware LLC 2.200% 15-Aug-2031	16.607	0,02
20.000	VMware LLC 3.900% 21-Aug-2027	19.383	0,03
40.000	VMware LLC 4.500% 15-May-2025	39.639	0,05
10.000	VMware LLC 4.650% 15-May-2027	9.927	0,01
20.000	Vodafone Group Plc 5.000% 30-May-2038	20.143	0,03
20.000	Vodafone Group Plc 5.125% 19-Jun-2059	18.446	0,03
10.000	Vodafone Group Plc 5.625% 10-Feb-2053	10.150	0,01
10.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.350% 08-Jun-2027	9.811	0,01
20.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.750% 13-Nov-2028	19.834	0,03
50.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 6.450% 16-Nov-2030	53.338	0,07
20.000	Vontier Corp 2.400% 01-Apr-2028	17.593	0,02
5.000	Voya Financial Inc FRN 4.700% 23-Jan-2048	4.120	0,01
15.000	Vulcan Materials Co 3.900% 01-Apr-2027	14.557	0,02
10.000	Vulcan Materials Co 4.500% 15-Jun-2047	9.026	0,01
10.000	W R Berkley Corp 4.750% 01-Aug-2044	9.036	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Walmart Inc 3.950% 28-Jun-2038	19.135	0,03
20.000	Walmart Inc 5.625% 01-Apr-2040	22.365	0,03
25.000	Walmart Inc 7.550% 15-Feb-2030	29.550	0,04
10.000	Walt Disney Co/The 2.650% 13-Jan-2031	8.915	0,01
50.000	Walt Disney Co/The 3.500% 13-May-2040	42.239	0,06
25.000	Walt Disney Co/The 3.800% 22-Mar-2030	24.321	0,03
35.000	Warnermedia Holdings Inc 5.050% 15-Mar-2042	30.987	0,04
50.000	Warnermedia Holdings Inc 5.141% 15-Mar-2052	43.173	0,06
20.000	Warnermedia Holdings Inc 5.391% 15-Mar-2062	17.252	0,02
20.000	Washington Gas Light Co 3.796% 15-Sep-2046	15.390	0,02
5.000	Washington University/The 3.524% 15-Apr-2054	4.004	0,01
10.000	Waste Connections Inc 2.600% 01-Feb-2030	8.993	0,01
5.000	Waste Connections Inc 2.950% 15-Jan-2052	3.542	0,00
10.000	Waste Management Inc 1.500% 15-Mar-2031	8.192	0,01
20.000	Waste Management Inc 2.000% 01-Jun-2029	17.832	0,02
5.000	Waste Management Inc 3.150% 15-Nov-2027	4.795	0,01
20.000	Waste Management Inc 4.625% 15-Feb-2033	20.113	0,03
5.000	WEA Finance LLC '144A' 2.875% 15-Jan-2027	4.456	0,01
10.000	WEC Energy Group Inc 1.375% 15-Oct-2027	8.853	0,01
10.000	WEC Energy Group Inc 4.750% 09-Jan-2026	9.968	0,01
50.000	Weir Group Plc/The '144A' 2.200% 13-May-2026	46.528	0,06
20.000	Wells Fargo & Co 3.000% 22-Apr-2026	19.173	0,03
25.000	Wells Fargo & Co 3.000% 23-Oct-2026	23.756	0,03
5.000	Wells Fargo & Co 7.950% 15-Nov-2029	5.592	0,01
20.000	Wells Fargo & Co FRN 2.188% 30-Apr-2026	19.180	0,03
15.000	Wells Fargo & Co FRN 3.068% 30-Apr-2041	11.385	0,02
50.000	Wells Fargo & Co FRN 5.389% 24-Apr-2034	50.335	0,07
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.000% 19-Feb-2025	9.786	0,01
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.550% 29-Sep-2025	9.779	0,01
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 4.100% 03-Jun-2026	9.788	0,01
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 4.400% 14-Jun-2046	25.338	0,03
50.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 4.650% 04-Nov-2044	44.117	0,06
50.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.164% 11-Feb-2026	48.150	0,07
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.393% 02-Jun-2028	18.339	0,02
70.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.879% 30-Oct-2030	62.361	0,08
50.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.196% 17-Jun-2027	47.817	0,06
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.526% 24-Mar-2028	28.652	0,04
40.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.908% 25-Apr-2026	39.235	0,05
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 4.897% 25-Jul-2033	19.522	0,03
25.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 5.557% 25-Jul-2034	25.520	0,03
20.000	Wells Fargo Bank NA 'BKNT' 6.600% 15-Jan-2038	22.327	0,03
30.000	Welltower OP LLC 2.750% 15-Jan-2032	25.598	0,03
20.000	Welltower OP LLC 4.000% 01-Jun-2025	19.654	0,03
30.000	Welltower OP LLC 4.250% 15-Apr-2028	29.459	0,04
20.000	Western & Southern Life Insurance Co/The '144A' 3.750% 28-Apr-2061	14.110	0,02
10.000	Western Digital Corp 3.100% 01-Feb-2032	7.977	0,01
20.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	19.642	0,03
10.000	Western Midstream Operating LP 3.100 % 01-Feb-2025	9.737	0,01
10.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	9.759	0,01
10.000	Western Midstream Operating LP 4.050 % 01-Feb-2030	9.388	0,01
20.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	19.672	0,03
5.000	Western Midstream Operating LP 5.250 % 01-Feb-2050	4.491	0,01
10.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	9.124	0,01
10.000	Western Union Co/The 1.350% 15-Mar-2026	9.185	0,01
10.000	Western Union Co/The 2.750% 15-Mar-2031	8.325	0,01
20.000	Western Union Co/The 2.850% 10-Jan-2025	19.448	0,03
10.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 3.200% 15-Jun-2025	9.679	0,01
10.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 3.450% 15-Nov-2026	9.576	0,01
5.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 4.700% 15-Sep-2028	4.952	0,01
10.000	Westlake Corp 2.875% 15-Aug-2041	7.064	0,01
10.000	Westlake Corp 5.000% 15-Aug-2046	9.157	0,01
5.000	Westpac Banking Corp 1.150% 03-Jun-2026	4.613	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Westpac Banking Corp 2.150% 03-Jun-2031	8.477	0,01
5.000	Westpac Banking Corp 3.350% 08-Mar-2027	4.829	0,01
15.000	Westpac Banking Corp 4.043% 26-Aug-2027	14.859	0,02
10.000	Westpac Banking Corp 4.421% 24-Jul-2039	8.723	0,01
10.000	Westpac Banking Corp FRN 2.668% 15-Nov-2035	8.159	0,01
40.000	Westpac Banking Corp FRN 2.894% 04-Feb-2030	38.545	0,05
10.000	Westpac Banking Corp FRN 3.020% 18-Nov-2036	8.147	0,01
20.000	Westpac Banking Corp FRN 4.110% 24-Jul-2034	18.331	0,02
10.000	Westpac Banking Corp 'GMTN' FRN 4.322% 23-Nov-2031	9.627	0,01
10.000	Weyerhaeuser Co 6.950% 01-Oct-2027	10.724	0,01
10.000	Whirlpool Corp 4.500% 01-Jun-2046	8.425	0,01
10.000	Williams Cos Inc/The 3.750% 15-Jun-2027	9.652	0,01
20.000	Williams Cos Inc/The 4.000% 15-Sep-2025	19.647	0,03
15.000	Williams Cos Inc/The 5.300% 15-Aug-2052	14.619	0,02
20.000	Williams Cos Inc/The 5.750% 24-Jun-2044	20.263	0,03
5.000	Williams Cos Inc/The 6.300% 15-Apr-2040	5.358	0,01
30.000	Williams Cos Inc/The 7.500% 15-Jan-2031	34.057	0,05
5.000	Willis North America Inc 2.950% 15-Sep-2029	4.482	0,01
5.000	Willis North America Inc 3.875% 15-Sep-2049	3.891	0,01
10.000	Willis North America Inc 4.650% 15-Jun-2027	9.907	0,01
15.000	Woodside Finance Ltd '144A' 3.650% 05-Mar-2025	14.682	0,02
40.000	Woodside Finance Ltd '144A' 3.700% 15-Mar-2028	37.628	0,05
10.000	Woori Bank 'REGS' 2.000% 20-Jan-2027	9.232	0,01
25.000	Workday Inc 3.500% 01-Apr-2027	24.219	0,03
5.000	Workday Inc 3.800% 01-Apr-2032	4.664	0,01
20.000	WRKCo Inc 4.000% 15-Mar-2028	19.323	0,03
10.000	WRKCo Inc 4.650% 15-Mar-2026	9.941	0,01
10.000	WRKCo Inc 4.900% 15-Mar-2029	10.061	0,01
50.000	WW Grainger Inc 3.750% 15-May-2046	42.014	0,06
5.000	Wyeth LLC 5.950% 01-Apr-2037	5.520	0,01
20.000	Wyeth LLC 6.500% 01-Feb-2034	22.585	0,03
2.000	Xcel Energy Inc 3.500% 01-Dec-2049	1.483	0,00
50.000	Xcel Energy Inc 4.000% 15-Jun-2028	48.886	0,07
20.000	Xcel Energy Inc 5.450% 15-Aug-2033	20.672	0,03
20.000	Xiaomi Best Time International Ltd 'REGS' 2.875% 14-Jul-2031	16.680	0,02
100.000	XL Group Ltd 5.250% 15-Dec-2043	96.554	0,13
10.000	XPO Inc '144A' 6.250% 01-Jun-2028	10.138	0,01
10.000	Yara International ASA '144A' 3.148% 04-Jun-2030	8.717	0,01
10.000	Yara International ASA '144A' 3.800% 06-Jun-2026	9.662	0,01
10.000	Yara International ASA '144A' 4.750% 01-Jun-2028	9.768	0,01
10.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.600% 24-Nov-2031	8.564	0,01
10.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 3.050% 15-Jan-2026	9.665	0,01
5.000	Zions Bancorp NA 3.250% 29-Oct-2029	4.095	0,01
5.000	Zoetis Inc 3.950% 12-Sep-2047	4.279	0,01
10.000	Zoetis Inc 4.500% 13-Nov-2025	9.952	0,01

Gesamtanlagen in Anleihen 71.869.799 96,85

Credit Default Swaps - 19.397			
(31. Dezember 2022: 36.702)			
(1.000.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	19.397	0,03

Credit Default Swaps insgesamt 19.397 0,03

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 287.984				
(31. Dezember 2022: 21.434)				
1	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2024	117.620	717	0,00
2	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	159.004	4.702	0,01
1	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	72.817	714	0,00

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
4	SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	415.688	3.376	0,00
2	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	225.781	934	0,00
6	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.235.484	11.178	0,02
23	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	3.072.656	266.363	0,36

Offene Terminkontrakte insgesamt 287.984 0,39

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 1.540.720 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 230.438) 1.540.720 2,08

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 73.717.900 99,35

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (195.100)				
(31. Dezember 2022: (24.305))				
1	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	93.717	(32)	(0,00)
(2)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(263.358)	(3.810)	(0,01)
(4)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(605.936)	(7.533)	(0,01)
(18)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.124.281)	(76.906)	(0,10)
(10)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.087.734)	(19.928)	(0,03)
(9)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.124.438)	(68.577)	(0,09)
(3)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(392.529)	(18.314)	(0,02)

Offene Terminkontrakte insgesamt (195.100) (0,26)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (495.643) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (716.228)) (495.643) (0,67)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (690.743) (0,93)

Nettoumlaufvermögen 1.177.333 1,58

Summe Nettovermögen 74.204.490 100,00

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist 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	95,81
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,38
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,08
Sonstiges Umlaufvermögen	1,73
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
US-Dollar	Kanadischer Dollar	68.266	90.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	334
US-Dollar	Euro	502.797	455.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	283
US-Dollar	Pfund Sterling	150.432	118.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	14
USD						631
US-Dollar	Euro	356.486	329.981	11. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(7.938)
US-Dollar	Euro	329.981	300.000	11. Jan. 24	Morgan Stanley	(1.333)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	95.580	130.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(2.543)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	2.140.729	2.899.700	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(47.961)
US-Dollar	Euro	648.363	600.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(14.293)
US-Dollar	Euro	15.566.722	14.425.700	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(365.397)
US-Dollar	Pfund Sterling	300.747	240.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(5.188)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.236.220	2.571.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(41.103)
USD						(485.756)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	162.628	178.982	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	629
Euro	US-Dollar	346.727	374.850	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8.084
Euro	US-Dollar	757	816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	13.215.933	14.218.177	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	377.844
Euro	US-Dollar	26.364	29.045	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	73
Euro	US-Dollar	18.234	20.065	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	73
Euro	US-Dollar	97.193	106.273	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.069
USD						387.792
EUR						351.277
US-Dollar	Euro	29.034	26.364	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(71)
Euro	US-Dollar	123.352	137.022	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(789)
US-Dollar	Euro	191.551	175.076	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.808)
US-Dollar	Euro	11.440	10.466	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(119)
US-Dollar	Euro	47.455	43.511	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(600)
US-Dollar	Euro	17.474	15.879	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Euro	11.195	10.276	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(155)
US-Dollar	Euro	4.167	3.854	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(90)
US-Dollar	Euro	1.339	1.242	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
USD						(3.728)
EUR						(3.377)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	175.542	191.943	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.931
Euro	US-Dollar	295.563	325.284	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.143
Euro	US-Dollar	24.447.603	26.301.612	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	698.958
USD						702.032
EUR						635.927
Euro	US-Dollar	225.068	250.010	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.439)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	307.597	282.035	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.890)
USD						(5.329)
EUR						(4.827)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	101	129	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.000	12.649	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99
USD						99
GBP						78
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	101	129	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.000	12.649	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99
USD						99
GBP						78
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	16.184	20.605	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	24
Pfund Sterling	US-Dollar	176.874	224.929	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	536
Pfund Sterling	US-Dollar	1.883.725	2.379.387	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21.848
Pfund Sterling	US-Dollar	20.606.659	25.874.800	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	393.065
Pfund Sterling	US-Dollar	1.776.800	2.230.341	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	34.594
USD						450.067
GBP						353.091
Pfund Sterling	US-Dollar	235.283	300.554	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(632)
Pfund Sterling	US-Dollar	272.845	347.922	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(120)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.450	5.083	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.494	1.975	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.606	16.184	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)
USD						(830)
GBP						(651)

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Grundstoffe - 15.417.268			
(31. Dezember 2022: 14.347.609)			
3.972.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	4.025.522	0,50
2.716.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	2.438.331	0,30
810.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	777.600	0,10
2.738.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	2.637.295	0,33
3.153.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	2.756.731	0,34
2.652.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	2.781.789	0,34
Investitionsgüter - 14.097.832			
(31. Dezember 2022: 18.481.210)			
14.759.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	14.097.832	1,74
Kommunikation - 117.637.073			
(31. Dezember 2022: 134.123.465)			
4.967.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	5.041.505	0,62
4.359.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	4.431.616	0,55
7.949.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	4.918.245	0,61
2.846.000	Frontier Florida LLC 6.860% 01-Feb-2028	2.756.173	0,34
1.375.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	1.313.262	0,16
7.844.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	7.301.862	0,90
9.262.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	7.744.375	0,96
5.144.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	2.180.893	0,27
2.935.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	1.294.247	0,16
1.852.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	527.098	0,07
1.655.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	473.338	0,06
1.494.000	Qwest Corp 7.250% 15-Sep-2025	1.465.577	0,18
17.269.000	Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	16.615.161	2,05
5.950.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	5.657.525	0,70
6.292.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	6.160.181	0,76
5.933.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	5.973.730	0,74
6.248.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	6.366.450	0,79
5.268.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	5.379.945	0,66
29.338.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	30.321.938	3,75
1.565.000	Warner Media LLC 7.625% 15-Apr-2031	1.713.952	0,21
Zyklische Konsumgüter - 177.418.766			
(31. Dezember 2022: 210.071.842)			
3.790.000	Advance Auto Parts Inc 1.750% 01-Oct-2027	3.258.510	0,40
5.105.000	Advance Auto Parts Inc 3.500% 15-Mar-2032	4.239.557	0,52
6.145.000	Advance Auto Parts Inc 3.900% 15-Apr-2030	5.523.580	0,68
3.085.000	Advance Auto Parts Inc 5.900% 09-Mar-2026	3.075.328	0,38
2.935.000	Advance Auto Parts Inc 5.950% 09-Mar-2028	2.924.300	0,36
3.995.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	3.997.034	0,49
3.050.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	3.114.934	0,38
382.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	366.438	0,05
197.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	206.360	0,03
3.715.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	3.386.905	0,42
3.796.000	Kohl's Corp 4.250% 17-Jul-2025	3.707.869	0,46
12.591.000	Kohl's Corp 4.625% 01-May-2031	9.925.863	1,23
9.136.000	Kohl's Corp 5.550% 17-Jul-2045	6.122.125	0,76
9.213.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	8.859.221	1,10
16.058.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	15.319.859	1,89
11.696.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	10.791.203	1,33
2.634.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	1.926.428	0,24
3.990.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	3.237.667	0,40
2.494.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	1.948.874	0,24
1.880.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	1.661.676	0,21
2.635.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.700% 15-Jul-2034	2.238.169	0,28
3.113.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	3.149.821	0,39
2.098.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	1.956.563	0,24
4.298.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	3.581.588	0,44
3.467.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	3.020.398	0,37
9.974.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	7.129.473	0,88
1.623.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	1.649.130	0,20
7132.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	6.702.935	0,83
7509.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	5.951.996	0,74
5.120.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	3.109.325	0,38

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
3.779.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	1.990.135	0,25
3.800.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	3.120.854	0,39
9.400.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	8.203.239	1,01
340.000	Rite Aid Corp (Defaulted) 7.700% 15-Feb-2027	8.877	0,00
7.027.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	7.010.016	0,87
3.749.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	3.756.007	0,46
1.540.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.200% 15-Apr-2030	1.359.344	0,17
3.910.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.450% 01-Jun-2026	3.719.233	0,46
1.116.000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.800% 18-Nov-2044	929.446	0,11
2.784.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	2.710.614	0,34
3.391.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	3.724.698	0,46
8.899.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	8.803.174	1,09
Nicht-zyklische Konsumgüter - 47.925.325			
(31. Dezember 2022: 67.640.988)			
9.496.000	Newell Brands Inc 5.200 % 01-Apr-2026	9.374.635	1,16
3.435.000	Newell Brands Inc 6.375 % 01-Apr-2036	3.146.989	0,39
4.965.000	Newell Brands Inc 6.500 % 01-Apr-2046	4.139.728	0,51
3.536.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	3.435.129	0,42
4.549.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	4.399.276	0,54
6.231.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.650 % 15-Jun-2030	5.675.267	0,70
2.918.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	2.303.302	0,29
3.468.000	Port of Newcastle Investments Financing Pty Ltd '144A' 5.900% 24-Nov-2031	3.139.734	0,39
2.249.000	Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031	2.350.239	0,29
1.096.000	Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	1.126.894	0,14
3.140.000	Toledo Hospital/The 4.982% 15-Nov-2045	2.115.575	0,26
3.809.000	Toledo Hospital/The 5.325% 15-Nov-2028	3.504.280	0,43
4.100.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	3.214.277	0,40
Energie - 100.045.928			
(31. Dezember 2022: 166.524.530)			
5.742.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	5.431.042	0,67
4.330.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	4.117.267	0,51
3.076.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	2.373.142	0,29
4.103.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	3.330.241	0,41
1.376.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	1.347.593	0,17
4.420.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	4.324.373	0,53
6.886.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	6.754.653	0,83
4.836.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	4.009.334	0,50
5.244.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	4.587.215	0,57
3.591.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	3.128.474	0,39
3.711.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	3.588.390	0,44
4.353.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	4.315.039	0,53
5.636.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	5.769.680	0,71
3.423.000	Global Marine Inc 7.000% 01-Jun-2028	2.978.695	0,37
3.551.000	Murphy Oil Corp 5.875 % 01-Dec-2042	3.134.012	0,39
2.260.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	2.329.633	0,29
4.227.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	4.094.357	0,51
3.481.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	3.189.606	0,39
5.781.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	5.529.934	0,68
5.389.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	5.299.467	0,66
2.481.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	2.508.514	0,31
7.024.000	Southwestern Energy Co 5.700 % 23-Jan-2025	6.999.084	0,87
8.565.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	6.877.866	0,85
2.127.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	1.874.876	0,23
2.402.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	2.153.441	0,27

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Finanzwerte - 145.366.875		
	(31. Dezember 2022: 133.532.741)	145.366.875	17,97
3.290.000	Associated Banc-Corp 4.250% 15-Jan-2025	3.234.903	0,40
10.710.000	Brandywine Operating Partnership LP 3.950% 15-Nov-2027	9.588.315	1,19
7.785.000	Brandywine Operating Partnership LP 4.550% 01-Oct-2029	6.822.465	0,84
8.216.000	Brandywine Operating Partnership LP 7.800% 15-Mar-2028	8.325.723	1,03
3.199.000	Brightsphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	3.070.483	0,38
3.102.000	Constellation Insurance Inc '144A' 6.625% 01-May-2031	2.983.916	0,37
6.453.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	4.963.859	0,61
10.040.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	11.131.850	1,38
2.820.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	2.582.238	0,32
4.257.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	4.254.050	0,53
5.908.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	4.843.349	0,60
3.339.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	1.875.382	0,23
3.514.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	2.183.788	0,27
6.581.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	3.287.486	0,41
9.462.000	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	7.434.420	0,92
5.431.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 6.800% 24-Jan-2030	5.160.039	0,64
4.474.000	Pacific Western Bank FRN 3.250% 01-May-2031	3.855.611	0,48
2.220.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	2.386.500	0,29
4.055.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	3.326.600	0,41
3.931.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	3.056.441	0,38
3.519.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	3.439.858	0,42
4.516.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	4.220.049	0,52
4.272.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	3.872.303	0,48
4.382.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	3.632.121	0,45
3.525.000	Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026	3.426.653	0,42
11.074.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	10.852.173	1,34
13.039.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	13.434.778	1,66
2.970.000	Vornado Realty LP 2.150% 01-Jun-2026	2.679.272	0,33
2.130.000	Vornado Realty LP 3.400% 01-Jun-2031	1.651.429	0,20
4.270.000	Wilton RE Ltd '144A' FRN (Perpetual) 6.000% 22-Oct-2030	3.790.821	0,47
Industrie - 60.590.848			
	(31. Dezember 2022: 79.077.067)	60.590.848	7,49
6.236.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	7.124.630	0,88
5.038.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	5.294.913	0,65
1.559.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	1.542.693	0,19
7.696.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	7.902.584	0,98
6.575.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	6.873.196	0,85
3.231.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	3.405.077	0,42
5.018.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	5.093.556	0,63
2.615.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	2.656.539	0,33
910.000	Pactiv LLC 8.375% 15-Apr-2027	937.306	0,12
9.393.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	9.057.200	1,12
3.563.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	3.783.047	0,47
322.000	Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026	309.845	0,04
3.866.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	3.423.776	0,42
3.112.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	3.186.486	0,39
Sonstige Industrie - 1.109.807			
	(31. Dezember 2022: 12.377.285)	1.109.807	0,14
1.169.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	1.109.807	0,14
Technologie - 72.409.437			
	(31. Dezember 2022: 46.473.988)	72.409.437	8,95
5.546.000	Crane Holdings Co 4.200% 15-Mar-2048	4.171.701	0,52
1.065.000	Crane NXT Co 6.550% 15-Nov-2036	1.088.939	0,13
3.773.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	3.494.476	0,43
2.807.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	2.512.953	0,31
3.194.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	3.170.637	0,39

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.			
Technologie Forts.			
3.263.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	3.203.826	0,40
5.274.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	5.074.297	0,63
45.218.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	44.408.969	5,49
2.502.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	1.946.189	0,24
3.817.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	3.337.450	0,41
Transport - 3.858.234			
(31. Dezember 2022: 16.949.723)		3.858.234	0,48
329.208	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	315.656	0,04
1.732.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	1.586.921	0,20
2.114.224	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	1.955.657	0,24
Versorger - 32.528.800			
(31. Dezember 2022: 22.590.418)		32.528.800	4,02
1.567.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	1.458.583	0,18
1.330.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	1.284.454	0,16
2.001.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	1.687.948	0,21
2.628.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	2.273.443	0,28
7.520.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	5.312.461	0,66
6.921.000	FirstEnergy Corp 4.150 % 15-Jul-2027	6.662.086	0,82
6.416.000	FirstEnergy Corp 5.100 % 15-Jul-2047	5.881.987	0,73
2.332.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	2.753.924	0,34
5.204.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	5.213.914	0,64
Gesamtanlagen in Anleihen		788.406.193	97,46
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Zeitwert USD Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Offene Terminkontrakte - 165.012			
(31. Dezember 2022: 63.206)			
(3)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(354.047)	417 0,00
45	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	4.894.805	109.908 0,01
17	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.123.938	54.687 0,01
Offene Terminkontrakte insgesamt			165.012 0,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 7.946.106 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 1.226.961)			7.946.106 0,98
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			796.517.311 98,46
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Zeitwert USD Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Offene Terminkontrakte - (4)			
(31. Dezember 2022: (110.805))			
2	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	225.781	(4) (0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(4) (0,00)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (20.473) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (3.309.099))			(20.473) (0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(20.477) (0,00)
Nettoumlaufvermögen			12.446.156 1,54
Summe Nettovermögen			808.942.990 100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

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	96,17
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,02
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,97
Sonstiges Umlaufvermögen	2,84
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	61	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	US-Dollar	145	168	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Schweizer Franken	US-Dollar	64	74	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	US-Dollar	10.644	12.143	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	526
USD						535
CHF						450

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	1.453.875	1.314.000	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.222
Euro	US-Dollar	300.000	329.657	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.671
Euro	US-Dollar	264.270	290.086	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.781
Euro	US-Dollar	611.882	669.048	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.730
Euro	US-Dollar	270.289	297.469	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.046
Euro	US-Dollar	108.000	116.411	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.867
Euro	US-Dollar	44.088.953	47.432.483	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.260.505
USD						1.277.822
EUR						1.157.500
Euro	US-Dollar	1.314.000	1.454.387	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.171)
Euro	US-Dollar	248.927	276.513	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.592)
USD						(4.763)
EUR						(4.315)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	181.045	199.493	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	458
Euro	US-Dollar	4.347	4.772	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Euro	US-Dollar	10.146	11.094	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	112
Euro	US-Dollar	4.449	4.896	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	733.411	789.030	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20.968
USD						21.584
EUR						19.552
US-Dollar	Euro	128.982	117.889	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.218)
USD						(1.218)
EUR						(1.103)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR N (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.541	1.692	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	3.633	3.973	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	40
Euro	US-Dollar	1.578	1.737	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	262.858	282.793	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7.515
USD						7.571
EUR						6.858
Euro	US-Dollar	1.422	1.579	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
USD						(9)
EUR						(8)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4771.07	523.714	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.215
Euro	US-Dollar	1.109.946	1.213.645	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12.208
Euro	US-Dollar	488.184	537.274	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.888
Euro	US-Dollar	80.208.154	86.290.820	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.293.155
USD						2.310.466
EUR						2.092.908
Euro	US-Dollar	444.756	494.044	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.844)
USD						(2.844)
EUR						(2.576)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	82.637	90.710	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	557
Euro	US-Dollar	192.248	210.209	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.114
Euro	US-Dollar	84.556	93.058	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	327
Euro	US-Dollar	13.892.410	14.945.955	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	397.185
USD						400.183
EUR						362.501
Euro	US-Dollar	77.034	85.571	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(493)
USD						(493)
EUR						(447)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	5.676	40	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Japanischer Yen	US-Dollar	13.450	95	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Japanischer Yen	US-Dollar	6.025	43	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Japanischer Yen	US-Dollar	1.004.974	6.898	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	241
USD						242
JPY						34.122

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	32.500	41.042	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	387
Pfund Sterling	US-Dollar	8.890	11.273	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	60
Pfund Sterling	US-Dollar	29.682	37.544	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	292
Pfund Sterling	US-Dollar	20.099	25.560	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	61
Pfund Sterling	US-Dollar	1.442.606	1.811.411	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27.517
USD						28.317
GBP						22.216
Pfund Sterling	US-Dollar	8.823	11.271	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.892	11.338	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
USD						(28)
GBP						(22)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	22.647	28.717	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	152
Pfund Sterling	US-Dollar	52.681	66.994	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	160
Pfund Sterling	US-Dollar	3.781.143	4.747.802	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	72.124
USD						72.436
GBP						56.828
Pfund Sterling	US-Dollar	22.287	28.469	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(60)
Pfund Sterling	US-Dollar	23.306	29.719	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
USD						(70)
GBP						(55)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	13.000	16.552	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
Pfund Sterling	US-Dollar	597.203	757.273	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.998
Pfund Sterling	US-Dollar	1.379.194	1.753.914	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.182
Pfund Sterling	US-Dollar	5.709	7.212	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	66
Pfund Sterling	US-Dollar	9.500	11.944	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	166
Pfund Sterling	US-Dollar	17.500	21.981	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	326
Pfund Sterling	US-Dollar	98.891.040	124.172.770	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.886.315
US-Dollar	Pfund Sterling	3.194	2.500	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
USD						1.895.080
GBP						1.486.745
US-Dollar	Pfund Sterling	16.551	13.000	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(20)
Pfund Sterling	US-Dollar	590.458	754.260	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.587)
Pfund Sterling	US-Dollar	614.228	783.243	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(270)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.204	17.500	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(103)
US-Dollar	Pfund Sterling	19.930	15.782	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(188)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	2.623	2.061	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
USD						(2.173)
GBP						(1.705)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	14.561	18.498	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	63
Pfund Sterling	US-Dollar	35.666	45.408	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	54
Pfund Sterling	US-Dollar	108.307	136.043	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.019
Pfund Sterling	US-Dollar	178.838	224.849	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.121
Pfund Sterling	US-Dollar	164.999	208.415	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.914
Pfund Sterling	US-Dollar	1.398.232	1.778.125	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.239
Pfund Sterling	US-Dollar	157.683	199.866	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.137
Pfund Sterling	US-Dollar	139.113	175.962	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.370
Pfund Sterling	US-Dollar	609.178	772.457	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.078
Pfund Sterling	US-Dollar	136.973	174.296	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	308
Pfund Sterling	US-Dollar	195.676	247.103	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.330
Pfund Sterling	US-Dollar	217.937	276.524	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.286
Pfund Sterling	US-Dollar	693.196	880.720	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.916
Pfund Sterling	US-Dollar	75.261	95.614	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	324
Pfund Sterling	US-Dollar	30.363	38.659	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Pfund Sterling	US-Dollar	99.883.432	125.418.869	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.905.244
Pfund Sterling	US-Dollar	66.891	83.965	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.302
US-Dollar	Pfund Sterling	56.222	44.011	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	119
USD						1.931.870
GBP						1.515.608
US-Dollar	Pfund Sterling	95.608	75.261	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(324)
US-Dollar	Pfund Sterling	38.656	30.363	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(46)
Pfund Sterling	US-Dollar	604.312	771.957	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.624)
Pfund Sterling	US-Dollar	455.443	581.797	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.232)
Pfund Sterling	US-Dollar	621.555	792.586	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(273)
US-Dollar	Pfund Sterling	21.273	16.947	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(330)
US-Dollar	Pfund Sterling	40.720	32.418	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(604)
US-Dollar	Pfund Sterling	45.411	35.666	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Pfund Sterling	53.423	42.491	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(741)
US-Dollar	Pfund Sterling	26.709	21.145	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(245)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.022	22.153	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(218)
US-Dollar	Pfund Sterling	112.284	88.241	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(198)
US-Dollar	Pfund Sterling	152.401	120.683	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.437)
US-Dollar	Pfund Sterling	209.426	165.055	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(974)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.975	10.213	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(43)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.499	14.561	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	82.560	65.135	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(469)
USD						(8.875)
GBP						(6.963)

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen			
	Grundstoffe - 68.683.855		
	(31. Dezember 2022: 67.920.941)	68.683.855	4,68
75.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	65.850	0,00
62.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	62.835	0,00
678.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	677.569	0,05
550.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 6.500% 15-Apr-2040	539.441	0,04
173.000	Arsenal AIC Parent LLC '144A' 8.000% 01-Oct-2030	180.717	0,01
355.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	349.227	0,02
633.000	Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031	546.754	0,04
839.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 5.250% 30-Sep-2028	606.932	0,04
430.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 7.500% 30-Sep-2029	219.313	0,02
367.000	ATI Inc 4.875% 01-Oct-2029	341.744	0,02
719.000	ATI Inc 5.125% 01-Oct-2031	669.366	0,05
410.000	ATI Inc 5.875 % 01-Dec-2027	404.951	0,03
650.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	650.671	0,04
630.000	Avient Corp '144A' 7.125% 01-Aug-2030	656.151	0,05
150.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 7.250% 15-Feb-2031	158.062	0,01
1.170.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	1.138.103	0,08
1.248.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	1.122.204	0,08
780.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	731.024	0,05
762.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	777.830	0,05
695.000	Carpenter Technology Corp 6.375% 15-Jul-2028	698.767	0,05
110.000	Carpenter Technology Corp 7.625% 15-Mar-2030	113.454	0,01
187.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	182.882	0,01
382.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	370.080	0,03
334.000	Century Aluminum Co '144A' 7.500% 01-Apr-2028	324.007	0,02
620.000	Cerdia Finanz GmbH '144A' 10.500% 15-Feb-2027	632.474	0,04
602.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	588.681	0,04
1.200.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	1.054.670	0,07
1.224.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	1.167.507	0,08
95.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	88.494	0,01
480.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	478.901	0,03
296.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	265.739	0,02
90.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029	83.747	0,01
450.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2031	407.382	0,03
556.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	557.843	0,04
892.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	906.177	0,06
215.000	Coeur Mining Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2029	198.311	0,01
382.000	Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031	338.626	0,02
50.000	Commercial Metals Co 4.125% 15-Jan-2030	46.095	0,00
582.000	Commercial Metals Co 4.375% 15-Mar-2032	523.229	0,04
1.994.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	1.976.662	0,14
630.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	534.215	0,04
632.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 6.500% 15-May-2026	577.635	0,04
503.000	Constellium SE '144A' 3.750% 15-Apr-2029	456.982	0,03
271.000	Constellium SE '144A' 5.625% 15-Jun-2028	264.780	0,02
783.000	Constellium SE '144A' 5.875% 15-Feb-2026	778.847	0,05
160.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 10.250% 01-Sep-2027	135.400	0,01
10.000	Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026	10.466	0,00
650.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028	607.162	0,04
1.119.000	Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028	1.012.938	0,07
413.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	380.682	0,03
1.995.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	1.829.574	0,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen Forts.			
	Grundstoffe Forts.		
780.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	750.368	0,05
89.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.875 % 15-Apr-2030	88.652	0,01
680.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125 % 15-Apr-2032	686.152	0,05
619.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	435.965	0,03
904.000	GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026	839.414	0,06
556.000	GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028	369.262	0,03
308.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	287.319	0,02
290.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	261.985	0,02
11.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030	9.915	0,00
241.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 4.750% 15-Jul-2027	234.029	0,02
10.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	9.600	0,00
605.000	HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028	566.391	0,04
479.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	482.836	0,03
110.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	90.364	0,01
364.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500 % 01-Apr-2026	353.043	0,02
508.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	498.492	0,03
381.000	Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028	364.769	0,03
645.000	INEOS Finance Plc '144A' 6.750% 15-May-2028	635.495	0,04
620.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 14.500% 15-Nov-2028	639.375	0,04
642.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	575.608	0,04
158.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	143.657	0,01
245.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	208.235	0,01
649.000	JW Aluminum Continuous Cast Co '144A' 10.250% 01-Jun-2026	654.043	0,04
535.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031	462.057	0,03
895.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028	828.865	0,06
228.900	Kobe US Midco 2 Inc '144A' 9.250% 01-Nov-2026	170.830	0,01
1.275.000	LSB Industries Inc '144A' 6.250% 15-Oct-2028	1.211.328	0,08
345.000	LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029	292.124	0,02
532.000	Mativ Holdings Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	510.912	0,04
1.154.000	Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029	992.788	0,07
590.000	Mercer International Inc '144A' 12.875% 01-Oct-2028	645.625	0,04
217.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	213.612	0,01
733.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	716.924	0,05
800.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	770.575	0,05
655.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	572.680	0,04
747.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.000% 01-Nov-2027	766.890	0,05
1.197.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	1.219.612	0,08
685.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.500 % 01-May-2030	714.963	0,05
450.000	Mineral Resources Ltd '144A' 9.250% 01-Oct-2028	479.259	0,03
11.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	10.589	0,00
475.000	New Gold Inc '144A' 7.500% 15-Jul-2027	479.886	0,03
845.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	795.967	0,05
226.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	199.485	0,01
2.096.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	1.974.602	0,13
210.000	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A' 5.000% 27-Jan-2030	195.006	0,01
292.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	278.802	0,02
1.055.000	Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027	1.030.587	0,07
206.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	202.935	0,01
815.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	734.160	0,05
140.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250 % 01-Oct-2029	124.456	0,01
10.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 7.125 % 01-Oct-2027	10.019	0,00
1.765.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 9.750% 15-Nov-2028	1.874.529	0,13
890.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	874.425	0,06
384.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	120.000	0,01
362.000	Rain Carbon Inc '144A' 12.250% 01-Sep-2029	354.307	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Grundstoffe Forts.			
280.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 7.625% 15-Jan-2026	257.257	0,02
1.060.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	993.350	0,07
943.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	881.932	0,06
210.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	196.401	0,01
2.075.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026	1.994.318	0,14
565.000	SK Invictus Intermediate II Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029	490.759	0,03
205.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	186.819	0,01
550.000	SPCM SA '144A' 3.375 % 15-Mar-2030	472.767	0,03
196.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	176.709	0,01
126.000	Tacora Resources Inc '144A' (Defaulted) 8.250% 15-May-2026	68.060	0,01
430.000	Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026	408.303	0,03
52.000	TMS International Corp/DE '144A' 6.250% 15-Apr-2029	42.970	0,00
200.000	TPC Group Inc '144A' 13.000% 16-Dec-2027	203.373	0,01
610.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	249.813	0,02
1.920.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	1.701.331	0,12
120.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	125.873	0,01
138.000	United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029	141.342	0,01
693.000	Vibrantz Technologies Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2030	544.795	0,04
200.000	Warrior Met Coal Inc '144A' 7.875% 01-Dec-2028	199.227	0,01
1.187.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	1.143.583	0,08
891.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	788.223	0,05
910.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 7.375% 01-Mar-2031	911.729	0,06
Investitionsgüter - 22.270.517 (31. Dezember 2022: 22.613.759)			
310.000	Alta Equipment Group Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2026	299.399	0,02
795.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	709.561	0,05
545.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	516.493	0,04
340.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	317.505	0,02
597.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2026	582.246	0,04
364.000	BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	337.293	0,02
561.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	504.990	0,03
372.000	GYP Holdings III Corp '144A' 4.625% 01-May-2029	341.756	0,02
565.000	H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028	513.879	0,04
1.076.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	1.062.984	0,07
453.000	Interface Inc '144A' 5.500% 01-Dec-2028	419.353	0,03
360.000	Iris Holding Inc '144A' 10.000% 15-Dec-2028	315.000	0,02
1.260.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	1.126.408	0,08
1.535.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	1.420.788	0,10
17.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	13.643	0,00
580.000	Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029	475.762	0,03
203.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	185.412	0,01
575.000	Patrick Industries Inc '144A' 7.500% 15-Oct-2027	578.085	0,04
563.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029	287.685	0,02
296.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	258.645	0,02
1.689.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	1.658.099	0,11
495.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	470.156	0,03
1.709.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	1.595.465	0,11
433.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	411.019	0,03
410.000	Titan International Inc 7.000% 30-Apr-2028	410.614	0,03
654.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	581.520	0,04
Investitionsgüter Forts.			
1.611.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	1.538.831	0,11
1.143.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	1.039.901	0,07
853.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	786.751	0,05
2.043.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	1.994.036	0,14
793.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	783.167	0,05
30.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	30.086	0,00
715.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	693.022	0,05
11.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	10.963	0,00
Kommunikation - 195.659.898 (31. Dezember 2022: 215.597.841)			
911.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	840.489	0,06
695.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	372.371	0,03
1.006.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	912.133	0,06
2.252.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	2.003.415	0,14
1.070.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	515.069	0,04
1.570.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	1.018.363	0,07
194.000	Altice France SA/France '144A' 5.125 % 15-Jan-2029	151.030	0,01
2.779.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	2.161.879	0,15
1.416.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	1.167.310	0,08
2.631.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	2.065.257	0,14
1.705.000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 01-Feb-2027	1.572.962	0,11
1.920.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	1.471.678	0,10
926.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	902.258	0,06
453.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	9.060	0,00
320.000	Beasley Mezzanine Holdings LLC '144A' 8.625% 01-Feb-2026	211.600	0,01
900.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	913.500	0,06
11.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	11.183	0,00
201.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	176.891	0,01
769.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081	710.700	0,05
725.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.875% 23-Nov-2081	622.797	0,04
1.510.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	1.224.434	0,08
334.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027	293.631	0,02
466.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028	367.753	0,03
3.474.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	2.978.600	0,20
4.209.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	3.693.397	0,25
1.600.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	1.302.828	0,09
4.725.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	4.266.078	0,29
1.747.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	1.481.154	0,10
4.846.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	4.434.238	0,30
1.808.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750 % 01-Feb-2032	1.596.645	0,11
2.261.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	2.165.848	0,15
4.674.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	4.513.421	0,31
1.843.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	1.740.345	0,12
1.447.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	1.438.357	0,10

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.				Kommunikation Forts.			
2.070.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 6.375% 01-Sep-2029	2.044.448	0,14	1.125.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	853.469	0,06
2.050.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 7.375 % 01-Mar-2031	2.103.970	0,14	1.083.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	816.773	0,06
458.000	Cellnex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041	355.165	0,02	160.000	Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026	156.155	0,01
54.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	54.305	0,00	5.000	Historic TW Inc Step-Up Coupon 8.300% 15-Jan-2036	5.859	0,00
1.008.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	962.898	0,07	1.541.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	1.357.603	0,09
1.015.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	844.500	0,06	884.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	697.790	0,05
1.300.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	1.121.539	0,08	1.437.332	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	1.226.957	0,08
1.130.000	CMG Media Corp '144A' 8.875% 15-Dec-2027	897.293	0,06	1.583.886	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	1.029.526	0,07
540.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026	517.423	0,04	99.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	76.254	0,01
445.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	447.641	0,03	716.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	569.608	0,04
2.263.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	2.251.742	0,15	1.215.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	1.213.492	0,08
1.217.000	Consolidated Communications Inc '144A' 5.000 % 01-Oct-2028	999.260	0,07	1.562.000	Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028	1.555.462	0,11
1.635.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	1.413.621	0,10	140.000	INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026	108.500	0,01
750.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	548.231	0,04	4.316.000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	4.122.571	0,28
973.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	741.348	0,05	545.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	484.761	0,03
1.379.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	1.044.310	0,07	15.000	Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028	14.148	0,00
2.450.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	1.479.060	0,10	526.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	483.663	0,03
80.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.000 % 15-Nov-2031	48.490	0,00	636.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	617.373	0,04
1.009.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	891.553	0,06	840.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	732.779	0,05
986.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	912.533	0,06	1.009.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	989.289	0,07
1.545.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	963.369	0,07	689.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	641.380	0,04
1.335.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	1.179.332	0,08	850.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	357.790	0,02
1.101.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	824.699	0,06	669.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	284.947	0,02
1.912.000	CSC Holdings LLC '144A' 11.250% 15-May-2028	1.971.396	0,13	1.905.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	1.592.856	0,11
330.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	222.234	0,02	993.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	492.538	0,03
360.000	Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029	318.882	0,02	1.062.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	638.182	0,04
4.880.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	4.592.273	0,31	968.000	Level 3 Financing Inc '144A' 10.500% 15-May-2030	939.574	0,06
1.191.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	615.062	0,04	515.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	218.344	0,01
997.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	935.732	0,06	394.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	173.742	0,01
1.013.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	606.537	0,04	12.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	4.334	0,00
2.341.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	1.632.941	0,11	700.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	199.227	0,01
4.045.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	3.473.138	0,24	299.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	85.516	0,01
2.267.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	1.812.410	0,12	1.191.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	769.755	0,05
4.716.000	DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	4.941.208	0,34	864.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	260.008	0,02
1.482.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	916.950	0,06	10.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	6.350	0,00
1.010.000	Endurance International Group Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	764.096	0,05	708.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028	683.411	0,05
685.000	EquipmentShare.com Inc '144A' 9.000% 15-May-2028	707.331	0,05	780.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	726.149	0,05
989.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	839.194	0,06	15.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5.375% 15-Aug-2027	14.634	0,00
1.848.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	1.708.937	0,12	903.000	Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026	642.006	0,04
1.004.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	970.677	0,07	40.000	Newfold Digital Holdings Group Inc '144A' 11.750% 15-Oct-2028	43.064	0,00
1.333.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	1.139.233	0,08	609.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	560.834	0,04
1.010.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	904.383	0,06	667.000	News Corp '144A' 5.125% 15-Feb-2032	634.130	0,04
660.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.625% 15-Mar-2031	673.286	0,05	960.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	885.440	0,06
635.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750 % 15-May-2030	653.738	0,04	2.167.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	2.096.984	0,14
48.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	45.845	0,00	169.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	156.416	0,01
855.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	757.299	0,05	220.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	222.356	0,02
455.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	421.294	0,03	224.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2029	202.347	0,01
66.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	66.579	0,00	501.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030	447.514	0,03
520.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	473.425	0,03	103.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	99.742	0,01
786.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	770.927	0,05	685.000	Paramount Global FRN 6.250% 28-Feb-2057	600.768	0,04
245.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	243.362	0,02	1.056.000	Paramount Global FRN 6.375% 30-Mar-2062	951.667	0,06
				256.000	Playtika Holding Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	223.621	0,02
				62.000	Qwest Corp 7.250% 15-Sep-2025	60.820	0,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
825.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	629.754	0,04
1.450.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	711.906	0,05
408.000	ROBLOX Corp '144A' 3.875% 01-May-2030	364.236	0,02
1.925.000	Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	1.852.116	0,13
320.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	283.350	0,02
460.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375 % 15-Jan-2031	338.123	0,02
915.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	813.769	0,06
41.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030	28.956	0,00
12.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2027	10.721	0,00
840.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030	631.100	0,04
721.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	678.325	0,05
1.387.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	1.188.260	0,08
1.625.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	1.502.848	0,10
1.165.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	1.038.119	0,07
1.470.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	1.419.928	0,10
1.202.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	1.163.434	0,08
440.000	Spanish Broadcasting System Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2026	257.921	0,02
435.000	Stagwell Global LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	400.648	0,03
79.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	74.071	0,01
1.097.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	1.026.046	0,07
1.184.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	1.086.356	0,07
650.000	TEGNA Inc '144A' 4.750 % 15-Mar-2026	633.134	0,04
991.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	942.287	0,06
953.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	933.034	0,06
1.126.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	1.133.730	0,08
1.188.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	1.210.522	0,08
1.800.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	1.691.280	0,12
380.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	224.929	0,02
598.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	374.886	0,03
470.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	222.052	0,02
362.000	Townsquare Media Inc '144A' 6.875% 01-Feb-2026	354.954	0,02
540.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	551.475	0,04
968.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	867.258	0,06
2.216.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	2.211.349	0,15
940.000	Univision Communications Inc '144A' 7.375 % 30-Jun-2030	941.175	0,06
715.000	Univision Communications Inc '144A' 8.000% 15-Aug-2028	738.266	0,05
1.597.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	1.407.468	0,10
749.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	706.835	0,05
775.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	659.486	0,05
755.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	736.897	0,05
1.733.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	1.678.506	0,11
975.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	801.791	0,05
130.000	Viasat Inc '144A' 7.500% 30-May-2031	102.212	0,01
697.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	633.257	0,04
590.000	Videotron Ltd '144A' 5.125% 15-Apr-2027	581.649	0,04
1.611.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	1.423.819	0,10
797.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030	710.613	0,05
1.181.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	1.142.228	0,08
70.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028	65.814	0,00
1.310.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	1.145.436	0,08
2.600.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	2.325.644	0,16
10.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	9.212	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
941.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	813.215	0,06
1.575.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	1.192.586	0,08
3.969.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	4.102.112	0,28
2.022.000	VZ Secured Financing BV '144A' 5.000% 15-Jan-2032	1.723.176	0,12
1.285.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	1.127.143	0,08
719.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.000% 15-Feb-2031	618.252	0,04
545.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	496.863	0,03
420.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.875% 15-Jul-2030	380.374	0,03
1.200.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	963.439	0,07
1.234.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	907.570	0,06
546.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030	457.181	0,03
608.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	592.307	0,04
1.640.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	1.464.244	0,10
Zyklische Konsumgüter - 303.656.584 (31. Dezember 2022: 304.667.076)			
697.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	640.638	0,04
2.397.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	2.265.634	0,15
2.182.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	1.959.046	0,13
1.379.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	1.319.289	0,09
100.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025	99.732	0,01
320.000	99 Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	108.390	0,01
155.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	157.505	0,01
60.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	58.981	0,00
103.000	Acushnet Co '144A' 7.375% 15-Oct-2028	108.150	0,01
202.000	Adams Homes Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2025	200.369	0,01
2.982.000	Adams Homes Inc '144A' 9.250% 15-Oct-2028	3.027.899	0,21
581.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	568.649	0,04
485.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 7.000% 15-Apr-2028	501.757	0,03
775.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 8.250% 15-Apr-2031	821.141	0,06
797.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	733.945	0,05
63.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	58.338	0,00
285.000	Advance Auto Parts Inc 1.750% 01-Oct-2027	245.033	0,02
295.000	Advance Auto Parts Inc 3.500% 15-Mar-2032	244.989	0,02
10.000	Advance Auto Parts Inc 3.900% 15-Apr-2030	8.989	0,00
245.000	Advance Auto Parts Inc 5.900% 09-Mar-2026	244.232	0,02
245.000	Advance Auto Parts Inc 5.950% 09-Mar-2028	244.107	0,02
1.000.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	891.940	0,06
616.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	502.715	0,03
2.883.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	2.870.607	0,20
1.641.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	1.609.869	0,11
644.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	589.328	0,04
985.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	894.360	0,06
1.561.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	1.381.076	0,09
464.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	448.576	0,03
980.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	977.555	0,07
1.155.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2029	803.292	0,05
1.221.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Jun-2026	1.059.873	0,07
737.000	American Airlines Inc '144A' 7.250% 15-Feb-2028	744.817	0,05
954.000	American Airlines Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	1.007.897	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Zyklische Konsumgüter Forts.		
503.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	444.870	0,03
264.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.250% 15-Mar-2026	262.573	0,02
206.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.500% 01-Apr-2027	206.987	0,01
726.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.875% 01-Jul-2028	714.096	0,05
657.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	555.701	0,04
730.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	681.697	0,05
685.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	684.253	0,05
749.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	679.156	0,05
925.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	801.147	0,05
478.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	412.849	0,03
11.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	10.457	0,00
440.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	411.482	0,03
1.185.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	1.098.515	0,07
925.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032	842.232	0,06
577.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	548.514	0,04
311.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029	276.925	0,02
700.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	625.371	0,04
104.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	101.441	0,01
1.155.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	1.167.010	0,08
337.000	At Home Group Inc '144A' 4.875 % 15-Jul-2028	125.111	0,01
490.000	Banijay Entertainment SASU '144A' 8.125% 01-May-2029	505.607	0,03
146.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	144.567	0,01
1.246.000	Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027	1.274.588	0,09
615.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	620.559	0,04
1.193.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	1.209.820	0,08
11.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	11.006	0,00
641.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	668.443	0,05
884.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	902.820	0,06
1.036.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	1.060.378	0,07
785.000	Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025	829.635	0,06
775.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	748.650	0,05
100.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.125% 15-May-2029	90.989	0,01
560.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 6.500% 01-Aug-2030	573.123	0,04
310.000	Beazer Homes USA Inc 5.875 % 15-Oct-2027	303.180	0,02
301.000	Beazer Homes USA Inc 6.750% 15-Mar-2025	300.570	0,02
315.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	318.221	0,02
454.000	Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029	417.306	0,03
855.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	824.091	0,06
1.456.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	1.338.913	0,09
325.000	Boyne USA Inc '144A' 4.750% 15-May-2029	305.972	0,02
50.000	Brinker International Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2024	49.611	0,00
2.829.000	Brinker International Inc '144A' 8.250% 15-Jul-2030	2.962.161	0,20
465.000	Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027	444.059	0,03
498.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	496.031	0,03
1.008.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	887.676	0,06
772.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 5.000% 15-Jun-2029	689.579	0,05
305.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	295.905	0,02
705.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	636.597	0,04
1.538.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	1.543.458	0,11
1.755.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2030	1.800.063	0,12
2.049.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	2.102.399	0,14
	Zyklische Konsumgüter Forts.		
132.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025	132.037	0,01
625.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	599.539	0,04
2.850.000	Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028	2.650.927	0,18
3.752.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	3.666.636	0,25
1.989.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	1.914.751	0,13
322.000	Carnival Corp '144A' 7.000 % 15-Aug-2029	336.573	0,02
840.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	855.743	0,06
1.215.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	1.276.592	0,09
1.125.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	1.231.361	0,08
1.370.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	1.491.594	0,10
11.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	11.523	0,00
311.000	Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029	276.568	0,02
192.000	Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029	169.795	0,01
306.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	294.583	0,02
1.081.000	Carvana Co '144A' 12.000% 01-Dec-2028	918.526	0,06
1.834.000	Carvana Co '144A' 13.000% 01-Jun-2030	1.544.576	0,11
1.975.000	Carvana Co '144A' 14.000% 01-Jun-2031	1.688.922	0,12
175.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	171.028	0,01
2.344.000	CDI Escrow Issuer Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2030	2.288.111	0,16
300.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	293.099	0,02
205.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	193.707	0,01
555.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	543.970	0,04
318.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 6.500% 01-Oct-2028	316.596	0,02
253.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	251.878	0,02
1.179.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	1.194.360	0,08
320.000	Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029	290.018	0,02
720.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	690.857	0,05
704.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	697.135	0,05
770.000	Churchill Downs Inc '144A' 6.750% 01-May-2031	782.463	0,05
455.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	417.520	0,03
375.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	366.963	0,03
20.000	Cinemark USA Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	20.167	0,00
1.097.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026	1.099.011	0,07
909.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.750 % 15-May-2028	927.957	0,06
2.468.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	2.481.159	0,17
270.000	Clarios Global LP '144A' 6.750% 15-May-2025	272.545	0,02
466.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	415.152	0,03
919.775	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 5.625% 15-May-2027	691.758	0,05
413.000	CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027	381.648	0,03
914.000	CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026	930.728	0,06
193.000	Crocs Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2031	163.253	0,01
650.000	Crocs Inc '144A' 4.250% 15-Mar-2029	581.216	0,04
845.000	Dana Financing Luxembourg Sarl '144A' 5.750% 15-Apr-2025	843.692	0,06
314.000	Dana Inc 4.250% 01-Sep-2030	278.709	0,02
295.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	257.002	0,02
386.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	383.684	0,03
725.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	715.451	0,05
271.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	274.672	0,02
730.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	723.550	0,05
584.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	527.246	0,04
1.100.000	eG Global Finance Plc '144A' 12.000% 30-Nov-2028	1.172.418	0,08
384.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	379.594	0,03
170.000	Empire Resorts Inc '144A' 7.750% 01-Nov-2026	147.003	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.				Zyklische Konsumgüter Forts.			
689.000	Evergreen Acqco 1 LP / TVI Inc '144A' 9.750% 26-Apr-2028	734.326	0,05	473.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	480.292	0,03
681.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 4.625% 15-Jan-2029	618.522	0,04	307.000	International Game Technology Plc '144A' 6.500% 15-Feb-2025	307.541	0,02
2.852.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	2.510.781	0,17	92.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	92.072	0,01
436.000	Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029	361.337	0,02	604.000	Jacobs Entertainment Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2029	568.322	0,04
1.345.000	Forestar Group Inc '144A' 3.850% 15-May-2026	1.280.245	0,09	595.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4.500% 01-Oct-2027	561.978	0,04
11.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	10.650	0,00	500.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	487.740	0,03
845.000	Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028	795.077	0,05	655.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	646.982	0,04
1.624.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	1.390.400	0,09	120.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	121.457	0,01
1.655.000	Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031	1.363.850	0,09	987.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 8.750% 15-Dec-2031	1.007.678	0,07
385.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	370.896	0,03	142.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	140.116	0,01
1.071.000	Garda World Security Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	961.709	0,07	228.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	204.387	0,01
333.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	336.101	0,02	120.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	114.859	0,01
545.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	496.868	0,03	986.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	1.026.119	0,07
934.000	GEO Group Inc/The '144A' 10.500% 30-Jun-2028	948.837	0,06	545.000	KB Home 7.250% 15-Jul-2030	564.674	0,04
480.000	GEO Group Inc/The '144A' 9.500% 31-Dec-2028	463.800	0,03	280.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	266.137	0,02
991.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	992.120	0,07	1.493.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 4.750% 01-Jun-2027	1.471.680	0,10
271.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	271.917	0,02	492.000	Kohl's Corp 4.250% 17-Jul-2025	480.577	0,03
319.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	309.099	0,02	860.000	Kohl's Corp 4.625% 01-May-2031	677.964	0,05
404.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026	398.128	0,03	869.000	Kohl's Corp 5.550% 17-Jul-2045	582.326	0,04
60.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 15-Jul-2029	56.778	0,00	427.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	386.533	0,03
825.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250% 15-Jul-2031	749.558	0,05	61.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	58.984	0,00
504.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033	452.508	0,03	591.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	568.306	0,04
200.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	203.069	0,01	2.162.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	2.062.619	0,14
375.000	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2028	274.093	0,02	1.111.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	1.025.054	0,07
755.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	700.504	0,05	527.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	490.113	0,03
295.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	248.303	0,02	475.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	474.584	0,03
440.000	Guitar Center Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2026	385.494	0,03	390.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	337.944	0,02
980.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	945.848	0,06	11.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	9.500	0,00
1.300.000	Hanesbrands Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2031	1.275.243	0,09	1.169.000	LGI Homes Inc '144A' 8.750% 15-Dec-2028	1.244.254	0,08
1.383.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	1.342.342	0,09	1.730.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	1.718.323	0,12
2.216.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	1.937.303	0,13	1.225.000	Life Time Inc '144A' 8.000% 15-Apr-2026	1.237.414	0,08
938.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	870.804	0,06	305.000	Lindblad Expeditions Holdings Inc '144A' 9.000% 15-May-2028	316.434	0,02
1.814.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	1.663.924	0,11	525.000	Lindblad Expeditions LLC '144A' 6.750% 15-Feb-2027	522.821	0,04
18.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025	17.996	0,00	925.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	692.894	0,05
974.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	975.289	0,07	560.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	509.600	0,03
514.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 4.875% 01-Jul-2031	455.473	0,03	794.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2031	722.425	0,05
732.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	676.184	0,05	1.460.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2027	1.405.235	0,10
245.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	241.465	0,02	622.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	581.628	0,04
575.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4.750% 15-Sep-2026	551.405	0,04	881.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	845.496	0,06
1.025.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.000% 15-May-2027	999.784	0,07	400.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	396.748	0,03
507.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	498.126	0,03	1.347.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	1.335.907	0,09
404.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	392.907	0,03	1.230.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	1.252.278	0,09
950.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	931.955	0,06	1.045.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	1.003.662	0,07
				390.000	M/I Homes Inc 3.950 % 15-Feb-2030	347.490	0,02
				540.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	520.150	0,04
				516.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	377.387	0,03
				26.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	21.098	0,00
				217.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	169.569	0,01
				221.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	195.335	0,01
				673.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	646.593	0,04
				489.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Mar-2030	465.252	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.				Zyklische Konsumgüter Forts.			
490.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.125% 15-Mar-2032	464.263	0,03	1.140.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	1.158.354	0,08
980.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.700% 15-Jul-2034	832.412	0,06	425.000	Odeon Finco Plc '144A' 12.750% 01-Nov-2027	431.939	0,03
215.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	217.543	0,01	30.000	Ontario Gaming GTA LP '144A' 8.000% 01-Aug-2030	30.959	0,00
789.000	Marriott Ownership Resorts Inc 4.750% 15-Jan-2028	725.458	0,05	173.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	153.262	0,01
500.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 4.500% 15-Jun-2029	441.178	0,03	66.000	Penn Entertainment Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2029	56.707	0,00
280.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	242.187	0,02	223.000	Penn Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2027	216.575	0,01
303.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.125% 01-Aug-2030	275.255	0,02	525.000	Penske Automotive Group Inc 3.500% 01-Sep-2025	509.691	0,03
520.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028	498.332	0,03	527.000	Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029	468.883	0,03
107.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	104.624	0,01	870.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	821.436	0,06
1.669.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	1.622.427	0,11	1.870.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	1.820.312	0,12
536.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	497.321	0,03	162.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	164.462	0,01
585.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	568.887	0,04	980.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	778.110	0,05
199.000	Matthews International Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2025	194.088	0,01	555.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031	429.856	0,03
1.808.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 04-Dec-2029	1.599.841	0,11	625.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	579.662	0,04
1.260.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.750% 21-Jul-2028	1.162.172	0,08	1.189.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	1.194.851	0,08
910.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	883.446	0,06	1.110.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	1.105.326	0,08
738.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	712.063	0,05	508.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	367.348	0,03
702.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.625% 17-Jul-2027	651.704	0,04	1.318.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	1.238.708	0,08
13.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	12.880	0,00	675.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	535.038	0,04
805.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	728.863	0,05	360.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	218.624	0,02
610.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	580.781	0,04	111.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	58.456	0,00
1.253.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.250% 18-Jun-2025	1.231.567	0,08	1.669.000	Rakuten Group Inc '144A' 10.250% 30-Nov-2024	1.714.896	0,12
880.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	860.880	0,06	1.136.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125 % 22-Apr-2026	919.747	0,06
349.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	340.853	0,02	1.125.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	769.268	0,05
1.011.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	963.881	0,07	440.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	419.280	0,03
787.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	781.240	0,05	600.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	517.948	0,04
650.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	647.938	0,04	700.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	574.894	0,04
505.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	506.930	0,03	1.200.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	1.047.222	0,07
930.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	745.065	0,05	1.145.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2028	1.180.292	0,08
1.494.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	942.199	0,06	1.285.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Mar-2031	1.371.558	0,09
15.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	13.967	0,00	695.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	641.177	0,04
2.000.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 8.000% 01-Feb-2026	1.889.220	0,13	10.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	10.526	0,00
50.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 13.250% 15-Dec-2027	53.281	0,00	612.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	591.338	0,04
487.000	Motion Bondco DAC '144A' 6.625% 15-Nov-2027	452.910	0,03	1.415.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.375% 15-Jul-2027	1.401.808	0,10
661.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	627.025	0,04	1.187.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	1.176.537	0,08
505.000	Murphy Oil USA Inc 5.625% 01-May-2027	501.413	0,03	1.634.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	1.614.565	0,11
645.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	561.945	0,04	1.000.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2030	1.045.229	0,07
559.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	543.978	0,04	1.760.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 8.250% 15-Jan-2029	1.871.529	0,13
845.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	825.545	0,06	1.655.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	1.781.948	0,12
480.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875 % 15-Feb-2027	476.214	0,03	1.065.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.625% 15-Aug-2027	1.159.636	0,08
560.000	NCL Corp Ltd '144A' 7.750 % 15-Feb-2029	563.165	0,04	875.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025	875.681	0,06
1.097.000	NCL Corp Ltd '144A' 8.125% 15-Jan-2029	1.146.227	0,08	492.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	465.735	0,03
400.000	NCL Corp Ltd '144A' 8.375 % 01-Feb-2028	424.119	0,03	1.200.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	1.213.171	0,08
1.551.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	1.482.809	0,10	980.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	1.004.392	0,07
1.660.000	New Home Co Inc/The '144A' 8.250% 15-Oct-2027	1.550.274	0,11				
50.000	Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024	49.078	0,00				
200.000	Newell Brands Inc 6.625% 15-Sep-2029	199.608	0,01				
1.250.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	1.202.910	0,08				
391.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	364.641	0,02				
815.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	679.152	0,05				
1.248.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	1.087.239	0,07				
985.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	704.084	0,05				

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Beschreibung				Beschreibung			
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.				Zyklische Konsumgüter Forts.			
550.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	514.088	0,04	1.135.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	1.096.268	0,07
230.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	231.601	0,02	10.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025	9.969	0,00
760.000	Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030	663.109	0,05	610.000	Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029	605.364	0,04
688.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	616.826	0,04	1.104.000	Viking Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jul-2031	1.177.306	0,08
453.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	438.633	0,03	334.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029	325.937	0,02
680.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	668.100	0,05	392.000	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc '144A' 9.500% 01-Jun-2028	332.240	0,02
300.000	Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027	313.842	0,02	770.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2030	537.939	0,04
40.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 15-Feb-2028	37.650	0,00	1.105.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 7.875% 01-May-2027	952.498	0,07
135.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 01-Apr-2029	124.907	0,01	366.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	351.299	0,02
805.000	Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	576.376	0,04	572.000	Wabash National Corp '144A' 4.500% 15-Oct-2028	516.840	0,04
705.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 5.500% 15-Apr-2027	689.769	0,05	170.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.200% 15-Apr-2030	150.057	0,01
247.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 7.250% 15-May-2031	247.921	0,02	690.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.450% 01-Jun-2026	656.335	0,04
258.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	259.365	0,02	156.000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.800% 18-Nov-2044	129.922	0,01
140.000	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp '144A' 8.500% 28-Nov-2025	139.801	0,01	282.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	273.040	0,02
465.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	424.209	0,03	861.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 4.875% 15-Sep-2028	802.434	0,05
585.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.875% 15-Nov-2031	522.107	0,04	666.000	Wesco Aircraft Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2024	26.640	0,00
522.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	503.945	0,03	1.323.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	1.307.264	0,09
95.000	Sotheby's/Bidfair Holdings Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	83.072	0,01	804.000	Windsor Holdings III LLC '144A' 8.500% 15-Jun-2030	841.207	0,06
1.046.000	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2027	985.287	0,07	670.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029	526.794	0,04
2.576.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	2.398.450	0,16	1.206.000	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	800.911	0,05
1.165.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	850.283	0,06	458.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	428.668	0,03
620.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	584.519	0,04	651.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	633.895	0,04
1.218.000	Station Casinos LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2031	1.099.470	0,08	983.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	978.495	0,07
275.000	STL Holding Co LLC '144A' 7.500% 15-Feb-2026	268.700	0,02	550.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024	543.423	0,04
250.000	StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	196.491	0,01	1.295.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	1.151.797	0,08
340.000	Studio City Co Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2027	334.820	0,02	530.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	517.676	0,04
2.005.000	Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029	1.686.195	0,11	1.019.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027	962.876	0,07
551.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025	540.476	0,04	1.620.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.625% 26-Aug-2028	1.502.725	0,10
480.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.500 % 15-Jan-2028	445.836	0,03	578.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	546.239	0,04
375.000	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp '144A' 5.875% 15-May-2025	372.279	0,03	555.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.125% 15-Feb-2031	578.142	0,04
458.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	443.562	0,03	1.379.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	1.245.203	0,08
504.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	506.351	0,03	1.441.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	1.349.561	0,09
825.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	830.070	0,06	101.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	98.338	0,01
3.287.000	Tenneco Inc '144A' 8.000% 17-Nov-2028	2.809.267	0,19	1.361.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	1.338.992	0,09
579.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	536.200	0,04	946.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	1.039.093	0,07
643.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	582.568	0,04	1.080.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	1.048.037	0,07
705.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	703.296	0,05	1.325.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	1.310.732	0,09
646.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	647.207	0,04	1.080.000	ZF North America Capital Inc '144A' 6.875 % 14-Apr-2028	1.122.102	0,08
166.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.500% 01-Dec-2029	148.864	0,01	535.000	ZF North America Capital Inc '144A' 7.125 % 14-Apr-2030	570.941	0,04
704.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030	630.464	0,04	600.000	ZipRecruiter Inc '144A' 5.000% 15-Jan-2030	525.717	0,04
930.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	940.174	0,06	Nicht-zyklische Konsumgüter - 168.459.824			
293.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	288.205	0,02	(31. Dezember 2022: 159.329.482)			
364.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	360.544	0,02	725.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	653.823	0,05
910.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	818.361	0,06	500.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	481.915	0,03
471.000	TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025	472.594	0,03	221.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	218.468	0,02
945.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	903.115	0,06	10.000	ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	9.031	0,00
1.260.000	Uber Technologies Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	1.264.275	0,09	395.000	AdaptHealth LLC '144A' 4.625% 01-Aug-2029	305.254	0,02
1.265.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027	1.310.863	0,09	995.000	AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030	777.911	0,05
1.558.000	Uber Technologies Inc '144A' 8.000% 01-Nov-2026	1.587.995	0,11	400.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	345.666	0,02
333.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	314.648	0,02	458.000	AHP Health Partners Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	398.973	0,03
635.000	Universal Entertainment Corp '144A' 8.750% 11-Dec-2024	682.442	0,05	715.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	674.879	0,05
2.781.000	Verde Purchaser LLC '144A' 10.500% 30-Nov-2030	2.805.751	0,19	2.016.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	1.833.791	0,13
431.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	360.510	0,02				

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
1.275.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	1.240.599	0,08
1.365.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	1.309.405	0,09
745.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	746.658	0,05
505.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 6.500 % 15-Feb-2028	510.513	0,04
536.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 7.500% 15-Mar-2026	546.172	0,04
1.482.000	Albion Financing 2SARL '144A' 8.750% 15-Apr-2027	1.467.180	0,10
163.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	162.910	0,01
610.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	550.857	0,04
405.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	383.616	0,03
44.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025	43.700	0,00
1.342.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	1.302.615	0,09
1.109.000	Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029	1.008.014	0,07
1.395.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	1.348.867	0,09
288.000	B&G Foods Inc 5.250% 01-Apr-2025	283.828	0,02
916.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	832.426	0,06
489.000	B&G Foods Inc '144A' 8.000% 15-Sep-2028	514.092	0,04
1.755.000	Bausch & Lomb Escrow Corp '144A' 8.375% 01-Oct-2028	1.853.613	0,13
1.204.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	670.095	0,05
1.650.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	1.511.699	0,10
1.670.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	1.008.443	0,07
254.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 30-Jan-2028	115.836	0,01
49.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2029	21.495	0,00
1.220.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	563.683	0,04
445.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	194.337	0,01
1.886.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025	1.727.001	0,12
1.300.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	839.949	0,06
665.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 01-Feb-2027	449.580	0,03
889.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	394.424	0,03
165.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.000% 15-Jan-2028	72.114	0,01
100.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029	45.814	0,00
1.145.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9.000% 15-Dec-2025	1.071.125	0,07
2.003.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 11.000% 30-Sep-2028	1.461.148	0,10
316.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 14.000% 15-Oct-2030	175.140	0,01
265.000	BellRing Brands Inc '144A' 7.000% 15-Mar-2030	274.915	0,02
420.000	C&S Group Enterprises LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2028	338.365	0,02
812.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	62.324	0,00
307.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029	269.009	0,02
395.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	344.222	0,02
511.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	495.908	0,03
1.030.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	1.020.102	0,07
148.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	134.775	0,01
272.000	Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028	265.681	0,02
362.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	320.359	0,02
1.663.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	1.524.732	0,10
625.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031	564.839	0,04
11.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	10.469	0,00
675.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	639.498	0,04
410.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2028	383.760	0,03
939.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	935.108	0,06
1.253.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	1.052.491	0,07

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
1.767.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	1.644.262	0,11
700.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029	630.889	0,04
1.982.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	1.285.763	0,09
709.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 01-Apr-2028	436.521	0,03
1.308.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	858.512	0,06
1.215.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	1.212.099	0,08
1.050.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027	1.014.351	0,07
1.642.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 10.875 % 15-Jan-2032	1.721.921	0,12
265.000	Cimpress Plc 7.000% 15-Jun-2026	259.220	0,02
663.000	Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026	652.659	0,04
182.000	Coty Inc '144A' 6.500% 15-Apr-2026	181.956	0,01
345.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	329.365	0,02
300.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 6.625% 15-Jul-2030	308.790	0,02
499.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	492.105	0,03
11.000	Darling Ingredients Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2030	11.015	0,00
2.130.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	1.752.463	0,12
4.044.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	3.533.120	0,24
268.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029	244.210	0,02
905.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	889.027	0,06
679.000	Elanco Animal Health Inc 6.650 % 28-Aug-2028	705.270	0,05
385.000	Embecka Corp '144A' 5.000% 15-Feb-2030	327.083	0,02
890.000	Embecka Corp '144A' 6.750% 15-Feb-2030	775.479	0,05
405.000	Emergent BioSolutions Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2028	166.137	0,01
1.406.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	1.346.781	0,09
652.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	600.756	0,04
1.530.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	1.443.444	0,10
751.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	676.009	0,05
721.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	671.785	0,05
213.000	Energizer Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Dec-2027	213.220	0,01
1.368.000	Fortrea Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jul-2030	1.407.263	0,10
329.000	Garda World Security Corp '144A' 7.750 % 15-Feb-2028	340.722	0,02
225.000	Garden Spinco Corp '144A' 8.625% 20-Jul-2030	241.049	0,02
795.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	632.351	0,04
1.005.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	912.545	0,06
2.940.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC '144A' 7.500% 15-Jan-2031	3.108.675	0,21
11.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	10.891	0,00
1.158.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	1.144.917	0,08
325.000	H-Food Holdings LLC / Hearthside Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	34.125	0,00
810.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	636.867	0,04
1.171.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	1.062.774	0,07
521.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	500.526	0,03
574.000	Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031	507.189	0,04
937.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	928.798	0,06
1.630.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	1.600.825	0,11
500.000	IQVIA Inc '144A' 6.500 % 15-May-2030	514.545	0,04
2.022.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	1.884.771	0,13
800.000	Kedrion SpA '144A' 6.500% 01-Sep-2029	732.000	0,05
131.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	131.595	0,01
437.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	426.475	0,03
500.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027	478.045	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
1.940.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030	1.792.145	0,12
1.480.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032	1.352.370	0,09
386.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	377.921	0,03
76.000	Land O'Lakes Capital Trust I '144A' 7.450% 15-Mar-2028	72.801	0,01
885.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027	819.035	0,06
585.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	434.137	0,03
1.455.000	LifePoint Health Inc '144A' 9.875% 15-Aug-2030	1.471.922	0,10
280.000	LifePoint Health Inc '144A' 11.000% 15-Oct-2030	295.284	0,02
1.015.000	MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6.375% 01-Jun-2029	876.473	0,06
855.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 14.750% 14-Nov-2028	922.442	0,06
4.582.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	4.147.681	0,28
2.427.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	2.290.389	0,16
80.000	Mobius Merger Sub Inc '144A' 9.000% 01-Jun-2030	77.703	0,01
1.023.000	ModivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	838.103	0,06
645.000	ModivCare Inc '144A' 5.875% 15-Nov-2025	637.660	0,04
1.264.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	1.133.245	0,08
995.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	818.193	0,06
310.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	305.152	0,02
2.249.000	Newell Brands Inc 5.200 % 01-Apr-2026	2.220.256	0,15
352.000	Newell Brands Inc 6.375% 15-Sep-2027	351.143	0,02
199.000	Newell Brands Inc 6.375 % 01-Apr-2036	182.315	0,01
397.000	Newell Brands Inc 6.500 % 01-Apr-2046	331.011	0,02
489.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	442.576	0,03
2.759.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	2.542.806	0,17
2.606.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	2.232.345	0,15
540.000	Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026	160.650	0,01
487.000	Owens & Minor Inc 4.375% 15-Dec-2024	480.316	0,03
577.000	Owens & Minor Inc '144A' 4.500% 31-Mar-2029	509.566	0,04
903.000	Owens & Minor Inc '144A' 6.625% 01-Apr-2030	867.043	0,06
479.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	389.724	0,03
1.185.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	1.088.281	0,07
1.484.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	1.463.916	0,10
325.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	326.571	0,02
1.070.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	1.039.476	0,07
980.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	947.745	0,07
745.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.650 % 15-Jun-2030	678.555	0,05
210.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	165.762	0,01
349.000	Port of Newcastle Investments Financing Pty Ltd '144A' 5.900% 24-Nov-2031	315.965	0,02
1.241.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	1.114.574	0,08
3.292.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	3.032.114	0,21
2.197.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	2.119.530	0,14
1.941.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	1.925.020	0,13
660.000	PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026	619.367	0,04
560.000	Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031	491.339	0,03
351.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	341.197	0,02
1.060.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	1.034.661	0,07
930.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	857.969	0,06
915.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	470.260	0,03
1.691.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A' 9.750% 01-Dec-2026	1.682.581	0,12
655.000	Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029	615.415	0,04
737.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	590.483	0,04
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
750.000	Sabre GLBL Inc '144A' 8.625% 01-Jun-2027	681.885	0,05
101.000	Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031	105.547	0,01
275.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.000% 01-Apr-2031	234.015	0,02
89.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.375% 01-Feb-2032	75.532	0,01
120.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	106.950	0,01
439.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 5.250% 15-Dec-2026	426.978	0,03
245.000	SEG Holding LLC / SEG Finance Corp '144A' 5.625% 15-Oct-2028	246.188	0,02
2.101.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	2.113.461	0,14
490.000	Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026	441.581	0,03
812.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	703.955	0,05
650.000	Spectrum Brands Inc '144A' 3.875% 15-Mar-2031	592.719	0,04
329.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	314.886	0,02
226.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2030	219.555	0,02
1.345.000	Star Parent Inc '144A' 9.000% 01-Oct-2030	1.419.233	0,10
8.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	8.032	0,00
300.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	303.795	0,02
570.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	410.260	0,03
728.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	610.512	0,04
47.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	45.943	0,00
11.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	10.443	0,00
900.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2031	762.079	0,05
1.071.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	968.248	0,07
1.012.000	Tenet Healthcare Corp 4.250 % 01-Jun-2029	943.978	0,06
1.127.000	Tenet Healthcare Corp 4.375% 15-Jan-2030	1.045.821	0,07
502.000	Tenet Healthcare Corp 4.625 % 15-Jun-2028	479.150	0,03
2.235.000	Tenet Healthcare Corp 4.875% 01-Jan-2026	2.211.873	0,15
1.257.000	Tenet Healthcare Corp 5.125 % 01-Nov-2027	1.229.651	0,08
1.929.000	Tenet Healthcare Corp 6.125% 01-Oct-2028	1.925.238	0,13
1.755.000	Tenet Healthcare Corp 6.125 % 15-Jun-2030	1.776.274	0,12
1.284.000	Tenet Healthcare Corp 6.250% 01-Feb-2027	1.291.185	0,09
1.148.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.750% 15-May-2031	1.174.748	0,08
649.000	Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029	579.680	0,04
230.000	Toledo Hospital/The 4.982% 15-Nov-2045	154.962	0,01
698.000	Toledo Hospital/The 5.325% 15-Nov-2028	642.160	0,04
565.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	442.943	0,03
1.000.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	886.449	0,06
612.000	TriNet Group Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2031	630.937	0,04
741.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	646.278	0,04
590.000	Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026	551.143	0,04
1.107.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	897.622	0,06
1.192.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	997.346	0,07
436.000	US Foods Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	406.892	0,03
1.095.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	1.041.006	0,07
600.000	US Foods Inc '144A' 6.875% 15-Sep-2028	618.366	0,04
927.000	US Foods Inc '144A' 7.250% 15-Jan-2032	967.753	0,07
1.042.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	891.160	0,06
385.000	Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030	382.410	0,03
790.000	Varex Imaging Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2027	798.086	0,05
1.426.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	1.307.205	0,09
496.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	497.756	0,03
515.000	Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	503.325	0,03
809.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15-Aug-2028	763.977	0,05
300.000	Winnebago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	295.089	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Diversifizierte Unternehmen - 1.575.012			
(31. Dezember 2022: -)			
1.494.000	Benteler International AG '144A' 10.500% 15-May-2028	1.575.012	0,11
Elektro - 3.819.232			
(31. Dezember 2022: 2.522.218)			
690.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2026	340.592	0,02
1.426.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	1.327.756	0,09
1.305.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	1.267.195	0,09
887.559	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	883.689	0,06
Energie - 172.188.424			
(31. Dezember 2022: 167.918.925)			
770.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	774.635	0,05
1.190.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.750% 20-May-2027	1.157.677	0,08
605.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.875% 20-Aug-2026	599.147	0,04
879.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	846.944	0,06
745.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	739.766	0,05
663.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	656.917	0,04
1.085.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	1.114.106	0,08
1.451.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	1.392.351	0,09
353.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	362.576	0,02
920.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	907.148	0,06
12.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	12.042	0,00
215.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	199.907	0,01
500.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	504.262	0,03
1.255.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 8.250% 31-Dec-2028	1.263.388	0,09
247.000	Athabasca Oil Corp '144A' 9.750% 01-Nov-2026	261.060	0,02
1.095.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.500 % 30-Apr-2030	1.133.876	0,08
930.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	962.900	0,07
375.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026	366.735	0,02
220.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	218.877	0,01
890.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	902.507	0,06
432.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	415.234	0,03
743.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	702.763	0,05
71.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	67.512	0,00
17.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	16.676	0,00
10.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	7.715	0,00
739.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	599.817	0,04
11.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	10.773	0,00
864.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	843.536	0,06
715.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	677.191	0,05
1.185.000	California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026	1.202.550	0,08
557.000	Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026	555.962	0,04
1.096.000	Callon Petroleum Co '144A' 7.500% 15-Jun-2030	1.106.664	0,08
711.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	727.552	0,05
11.100	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 8.125% 15-Jan-2027	10.917	0,00
1.244.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 9.750 % 15-Jul-2028	1.245.269	0,08
11.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 15-Apr-2025	11.185	0,00
335.000	CGG SA '144A' 8.750% 01-Apr-2027	305.480	0,02
564.063	Chesapeake Energy Corp 0.000% 15-Apr-2022	11.281	0,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
668.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	663.045	0,05
710.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	696.664	0,05
1.311.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	1.324.847	0,09
340.000	Chord Energy Corp '144A' 6.375% 01-Jun-2026	340.343	0,02
635.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	616.364	0,04
2.120.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.375% 01-Jul-2028	2.215.962	0,15
313.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.625% 01-Nov-2030	332.192	0,02
1.496.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.750% 01-Jul-2031	1.594.910	0,11
272.000	CNX Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Apr-2030	244.842	0,02
1.294.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	1.241.939	0,08
466.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	471.086	0,03
1.251.000	CNX Resources Corp '144A' 7.375 % 15-Jan-2031	1.261.318	0,09
562.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	548.661	0,04
1.860.000	Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030	1.614.903	0,11
2.382.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	2.181.882	0,15
288.000	Conuma Resources Ltd '144A' 13.125% 01-May-2028	277.460	0,02
1.560.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	1.480.167	0,10
620.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026	624.205	0,04
923.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 9.250% 15-Feb-2028	958.383	0,07
299.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	291.869	0,02
1.425.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	1.423.995	0,10
252.000	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2025	252.630	0,02
665.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	664.426	0,05
115.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	106.208	0,01
3.831.000	CVR Energy Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2029	3.824.736	0,26
517.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	514.353	0,03
455.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	429.092	0,03
1.257.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	1.157.980	0,08
1.766.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	1.594.424	0,11
844.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	832.243	0,06
958.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	959.503	0,07
610.000	Enerflex Ltd '144A' 9.000% 15-Oct-2027	593.487	0,04
510.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	531.384	0,04
1.506.000	EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029	1.475.518	0,10
447.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	442.497	0,03
183.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	186.989	0,01
15.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	14.675	0,00
791.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	775.912	0,05
480.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	397.949	0,03
390.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	341.154	0,02
372.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	324.086	0,02
200.000	EnQuest Plc '144A' 11.625% 01-Nov-2027	190.936	0,01
355.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	343.271	0,02
670.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	664.157	0,05
311.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	318.377	0,02
525.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	496.651	0,03
15.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	13.980	0,00
341.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	341.131	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Energie Forts.				Energie Forts.		
597.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	608.173	0,04	799.000	Nabors Industries Inc '144A' 7.375% 15-May-2027	783.614	0,05
626.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2027	644.337	0,04	654.000	Nabors Industries Inc '144A' 9.125% 31-Jan-2030	657.221	0,04
295.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2030	317.490	0,02	463.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026	445.508	0,03
507.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	496.907	0,03	752.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.500% 15-Jan-2028	654.078	0,04
555.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	524.961	0,04	929.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025	921.373	0,06
572.000	FTAI Infra Escrow Holdings LLC '144A' 10.500% 01-Jun-2027	594.530	0,04	4.042.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	3.884.845	0,26
283.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	282.992	0,02	1.805.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	1.791.222	0,12
1.331.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	1.336.999	0,09	2.109.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	2.131.849	0,15
1.415.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	1.440.672	0,10	813.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025	812.007	0,06
395.000	Global Marine Inc 7.000% 01-Jun-2028	343.729	0,02	489.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026	486.713	0,03
658.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	637.932	0,04	400.000	Nine Energy Service Inc 13.000% 01-Feb-2028	354.886	0,02
12.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	11.743	0,00	550.000	Noble Finance II LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2030	574.411	0,04
450.000	Greenfire Resources Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2028	447.422	0,03	955.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	967.931	0,07
720.000	Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026	728.593	0,05	80.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.750% 15-Jun-2031	83.332	0,01
410.000	Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026	401.167	0,03	260.000	Northriver Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	252.402	0,02
1.525.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	1.518.238	0,10	690.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	687.678	0,05
1.497.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030	1.378.962	0,09	168.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	166.891	0,01
320.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	309.036	0,02	795.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	794.312	0,05
418.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.500% 15-Oct-2030	405.011	0,03	5.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	5.016	0,00
770.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	765.041	0,05	260.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	252.307	0,02
500.000	HF Sinclair Corp '144A' 6.375% 15-Apr-2027	504.451	0,03	862.000	Oceaneering International Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2028	849.070	0,06
392.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	379.314	0,03	610.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.500% 01-Oct-2029	559.852	0,04
1.306.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 15-Apr-2030	1.268.915	0,09	456.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.625% 01-May-2030	420.019	0,03
1.226.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	1.187.151	0,08	113.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 5.875% 15-Jul-2027	112.614	0,01
370.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	368.946	0,03	370.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	359.692	0,02
720.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 15-Apr-2032	693.444	0,05	1.226.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 7.875% 15-Sep-2030	1.256.650	0,09
688.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	681.994	0,05	75.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 5.375% 15-Jan-2026	74.062	0,01
710.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026	703.092	0,05	280.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	280.168	0,02
445.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	394.121	0,03	380.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 7.000% 15-Jan-2032	391.956	0,03
1.060.000	KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025	1.077.880	0,07	250.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 7.750% 15-Feb-2026	254.598	0,02
1.905.000	Kinetik Holdings LP '144A' 5.875% 15-Jun-2030	1.871.815	0,13	965.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2027	1.000.202	0,07
1.018.000	Kinetik Holdings LP '144A' 6.625% 15-Dec-2028	1.037.925	0,07	1.595.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 9.875% 15-Jul-2031	1.774.246	0,12
345.000	KLX Energy Services Holdings Inc '144A' 11.500% 01-Nov-2025	340.455	0,02	551.000	Petrofac Ltd '144A' 9.750% 15-Nov-2026	289.812	0,02
300.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	300.316	0,02	518.000	Precision Drilling Corp '144A' 6.875% 15-Jan-2029	500.085	0,03
909.000	Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-Jan-2028	934.745	0,06	271.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	271.026	0,02
1.579.000	Laredo Petroleum Inc '144A' 7.750% 31-Jul-2029	1.511.255	0,10	1.910.000	Puma International Financing SA '144A' 5.000% 24-Jan-2026	1.817.651	0,12
356.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	347.470	0,02	679.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	671.046	0,05
385.000	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 15-Feb-2028	396.917	0,03	648.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	671.220	0,05
755.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	750.002	0,05	450.000	Range Resources Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2030	416.473	0,03
75.000	Matador Resources Co '144A' 6.875% 15-Apr-2028	76.198	0,01	470.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	444.828	0,03
471.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	458.168	0,03	470.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	455.251	0,03
690.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	688.876	0,05	249.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	228.156	0,02
434.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	445.604	0,03	792.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	757.604	0,05
392.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027	390.465	0,03	784.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	770.975	0,05
182.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2042	160.628	0,01	143.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	144.586	0,01
421.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	423.755	0,03	300.000	Sadrii Finance Ltd '144A' 8.375% 01-Aug-2030	313.249	0,02
356.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	356.104	0,02	14.000	SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025	13.806	0,00
				247.000	SM Energy Co 6.500% 15-Jul-2028	247.387	0,02
				1.065.000	SM Energy Co 6.625% 15-Jan-2027	1.058.607	0,07
				389.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	388.095	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
1.572.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	1.456.543	0,10
327.000	Southwestern Energy Co 4.950 % 23-Jan-2025	325.840	0,02
300.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	293.077	0,02
703.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	687.869	0,05
495.000	Strathcona Resources Ltd/Alberta '144A' 6.875% 01-Aug-2026	473.230	0,03
13.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	12.997	0,00
1.245.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	1.139.908	0,08
405.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025	395.284	0,03
1.621.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp '144A' 9.000% 15-Oct-2026	1.619.257	0,11
317.000	Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026	270.128	0,02
420.000	Sunnova Energy Corp '144A' 11.750% 01-Oct-2028	381.305	0,03
199.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	184.942	0,01
1.025.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 30-Apr-2030	950.125	0,06
580.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	579.832	0,04
1.043.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027	1.046.550	0,07
730.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 7.000% 15-Sep-2028	753.446	0,05
555.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	515.140	0,04
1.380.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028	1.305.554	0,09
752.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	736.125	0,05
1.614.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030	1.502.964	0,10
565.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	524.744	0,04
230.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	231.390	0,02
291.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	299.548	0,02
375.000	Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029	352.945	0,02
19.000	TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp 6.125% 15-Feb-2026	17.283	0,00
303.000	Transocean Aquila Ltd '144A' 8.000% 30-Sep-2028	307.715	0,02
750.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	602.265	0,04
380.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	334.957	0,02
280.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	251.026	0,02
840.000	Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	828.248	0,06
805.000	Transocean Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	791.756	0,05
540.000	Transocean Inc '144A' 8.000% 01-Feb-2027	527.045	0,04
1.130.500	Transocean Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2030	1.182.257	0,08
714.000	Transocean Inc '144A' 11.500% 30-Jan-2027	746.658	0,05
103.500	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	103.214	0,01
784.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	781.531	0,05
737.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	729.202	0,05
1.785.000	Valaris Ltd '144A' 8.375% 30-Apr-2030	1.830.330	0,12
150.000	Vantage Drilling International '144A' 9.500% 15-Feb-2028	148.676	0,01
1.966.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	1.787.394	0,12
1.418.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	1.204.657	0,08
2.414.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	2.129.599	0,15
1.031.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2030	1.026.714	0,07
3.549.000	Venture Global LNG Inc '144A' 8.125% 01-Jun-2028	3.587.201	0,24
2.051.000	Venture Global LNG Inc '144A' 8.375% 01-Jun-2031	2.054.567	0,14
3.272.000	Venture Global LNG Inc '144A' 9.500% 01-Feb-2029	3.463.533	0,24
2.312.000	Venture Global LNG Inc '144A' 9.875% 01-Feb-2032	2.409.992	0,16

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
225.000	Vermilion Energy Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2025	222.414	0,02
474.000	Vermilion Energy Inc '144A' 6.875% 01-May-2030	455.522	0,03
432.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	424.473	0,03
571.000	W&T Offshore Inc '144A' 11.750% 01-Feb-2026	589.542	0,04
29.000	Weatherford International Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2028	29.910	0,00
1.875.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	1.958.957	0,13
89.000	Welltec International ApS '144A' 8.250% 15-Oct-2026	90.836	0,01
Finanzunternehmen - 3.971.279			
(31. Dezember 2022: 4.869.893)		3.971.279	0,27
460.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045	461.237	0,03
318.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	297.180	0,02
566.000	FirstCash Inc '144A' 5.625% 01-Jan-2030	542.675	0,04
835.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028	804.169	0,05
1.290.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	1.287.054	0,09
50.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	52.048	0,00
571.000	PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	526.916	0,04
Finanzwerte - 146.192.427			
(31. Dezember 2022: 133.442.992)		146.192.427	9,96
650.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	587.578	0,04
620.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	564.036	0,04
921.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	919.399	0,06
877.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	917.299	0,06
91.000	Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027	92.459	0,01
489.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	486.611	0,03
275.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC '144A' 8.625% 30-Sep-2027	289.411	0,02
725.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	697.396	0,05
727.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Nov-2029	689.735	0,05
1.245.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	1.235.526	0,08
1.390.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Apr-2028	1.422.885	0,10
972.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	970.052	0,07
400.000	Ally Financial Inc 6.700% 14-Feb-2033	400.977	0,03
820.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	748.846	0,05
310.000	Anywhere Real Estate Group LLC / Anywhere Co-Issuer Corp '144A' 7.000% 15-Apr-2030	286.654	0,02
172.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	144.842	0,01
547.000	Aretex Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2029	493.757	0,03
55.000	Armor Holdco Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2029	49.945	0,00
665.000	Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048	671.850	0,05
733.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	684.996	0,05
555.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	556.369	0,04
246.037	Avation Capital SA '144A' 8.250% 31-Oct-2026	208.794	0,01
678.000	Blackstone Mortgage Trust Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2027	603.779	0,04
540.000	Brandywine Operating Partnership LP 3.950% 15-Nov-2027	483.444	0,03
499.000	Brandywine Operating Partnership LP 4.550% 01-Oct-2029	437.304	0,03
146.000	Brandywine Operating Partnership LP 7.800% 15-Mar-2028	147.950	0,01
2.464.000	Bread Financial Holdings Inc '144A' 9.750% 15-Mar-2029	2.546.655	0,17
1.200.000	Brightsphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	1.151.791	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Finanzwerte Forts.		
200.000	BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029	186.868	0,01
902.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSi Selco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	812.914	0,06
820.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSi Selco LL '144A' 5.750% 15-May-2026	796.036	0,05
317.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.250% 15-Apr-2028	304.630	0,02
192.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	185.553	0,01
1.504.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 9.250% 01-Jul-2031	1.600.331	0,11
130.000	Castlelake Aviation Finance DAC '144A' 5.000% 15-Apr-2027	122.280	0,01
410.000	Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029	316.499	0,02
2.118.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	1.790.961	0,12
500.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.625% 01-Oct-2031	387.275	0,03
280.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Jan-2032	254.120	0,02
942.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	890.859	0,06
426.000	Constellation Insurance Inc '144A' 6.625% 01-May-2031	409.784	0,03
535.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	534.527	0,04
291.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028	266.109	0,02
680.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	229.500	0,02
1.275.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	248.619	0,02
1.090.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	1.085.656	0,07
307.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 8.875% 01-Sep-2031	325.581	0,02
1.538.000	Diversified Healthcare Trust 4.375% 01-Mar-2031	1.156.176	0,08
1.348.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	1.036.926	0,07
515.000	Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025	506.006	0,03
1.597.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	1.770.674	0,12
239.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	235.065	0,02
3.511.000	Enova International Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2028	3.619.841	0,25
284.000	Finance of America Funding LLC '144A' 7.875% 15-Nov-2025	228.604	0,02
291.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 12.000% 01-Oct-2028	318.281	0,02
890.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 12.250% 01-Oct-2030	976.387	0,07
375.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	343.383	0,02
240.000	GGAM Finance Ltd '144A' 7.750% 15-May-2026	243.855	0,02
339.000	GGAM Finance Ltd '144A' 8.000% 15-Feb-2027	347.041	0,02
610.000	GGAM Finance Ltd '144A' 8.000% 15-Jun-2028	631.786	0,04
1.920.958	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024	1.807.938	0,12
940.000	Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051	806.351	0,05
275.000	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027	230.197	0,02
428.000	goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	412.551	0,03
1.277.000	goeasy Ltd '144A' 9.250% 01-Dec-2028	1.364.934	0,09
270.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	273.108	0,02
780.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	733.579	0,05
1.025.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.750% 15-Sep-2030	864.270	0,06
353.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 8.000% 15-Jun-2027	368.015	0,02
295.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	268.246	0,02
700.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	684.938	0,05
755.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	674.060	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Finanzwerte Forts.		
660.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	573.563	0,04
723.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	695.887	0,05
1.050.000	HUB International Ltd '144A' 5.625% 01-Dec-2029	1.004.719	0,07
1.599.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	1.607.035	0,11
800.000	HUB International Ltd '144A' 7.250% 15-Jun-2030	845.524	0,06
744.000	Hunt Cos Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2029	664.474	0,05
430.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	359.587	0,02
1.093.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	1.087.002	0,07
1.949.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	1.755.847	0,12
1.494.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	1.426.580	0,10
1.003.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	985.585	0,07
2.908.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jan-2029	2.970.377	0,20
2.604.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	2.593.424	0,18
1.639.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.198% 01-Jun-2032	1.356.320	0,09
650.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	463.956	0,03
354.000	Iron Mountain Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2029	364.087	0,02
700.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	653.540	0,04
1.787.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	1.603.191	0,11
755.000	Jefferson Capital Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Aug-2026	723.429	0,05
630.000	Jones Deslauriers Insurance Management Inc '144A' 8.500% 15-Mar-2030	662.379	0,04
425.000	Jones Deslauriers Insurance Management Inc '144A' 10.500% 15-Dec-2030	448.616	0,03
1.042.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	871.117	0,06
591.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	479.786	0,03
1.065.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	847.144	0,06
821.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027	774.305	0,05
459.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	414.416	0,03
727.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	717.828	0,05
520.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	443.881	0,03
490.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025	454.764	0,03
658.000	LFS Topco LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2026	605.802	0,04
840.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	553.492	0,04
308.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	307.787	0,02
1.005.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051	844.367	0,06
70.000	Macquarie Airfinance Holdings Ltd '144A' 8.375% 01-May-2028	73.372	0,00
811.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	790.226	0,05
11.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 5.625% 15-Jan-2030	9.570	0,00
1.055.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	990.513	0,07
1.140.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.500% 15-Mar-2031	713.904	0,05
739.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	532.060	0,04
1.493.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027	1.220.861	0,08
102.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.250% 01-Aug-2026	91.271	0,01
636.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030	577.474	0,04
1.334.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	1.286.903	0,09
1.186.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031	1.107.635	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Finanzwerte Forts.		
70.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	69.547	0,00
670.000	Navient Corp 4.875% 15-Mar-2028	623.228	0,04
492.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	475.414	0,03
527.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	486.534	0,03
115.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	115.048	0,01
1.090.000	Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025	1.104.032	0,07
709.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	720.189	0,05
572.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	468.923	0,03
627.000	Necessity Retail REIT Inc/The / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	528.680	0,04
423.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	419.028	0,03
2.454.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	2.495.963	0,17
885.000	NFP Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2030	941.935	0,06
30.000	NFP Corp '144A' 8.500% 01-Oct-2031	32.497	0,00
940.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	942.623	0,06
722.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	405.518	0,03
310.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	192.651	0,01
1.429.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	713.846	0,05
1.264.000	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	993.142	0,07
288.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 6.800% 24-Jan-2030	273.631	0,02
995.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	921.531	0,06
450.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	398.560	0,03
850.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	728.455	0,05
615.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	577.431	0,04
675.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	682.050	0,05
1.938.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	1.963.359	0,13
1.516.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	1.545.694	0,11
652.000	OneMain Finance Corp 7.875% 15-Mar-2030	671.808	0,05
1.186.000	OneMain Finance Corp 9.000% 15-Jan-2029	1.255.562	0,09
141.000	Oxford Finance LLC / Oxford Finance Co-Issuer II Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2027	133.292	0,01
600.000	Pacific Western Bank FRN 3.250% 01-May-2031	517.069	0,03
551.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	510.261	0,03
785.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	772.750	0,05
752.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	756.730	0,05
1.417.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	1.277.126	0,09
744.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	736.093	0,05
585.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	542.532	0,04
355.000	PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026	318.309	0,02
349.000	PRA Group Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	288.301	0,02
471.000	PRA Group Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	467.602	0,03
499.000	PRA Group Inc '144A' 8.375 % 01-Feb-2028	480.707	0,03
130.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	139.750	0,01
798.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025	736.271	0,05
1.211.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.250% 15-Apr-2030	905.638	0,06
858.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	667.992	0,05
250.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	241.656	0,02
390.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029	363.034	0,02
590.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 7.250% 15-Jul-2028	613.784	0,04
608.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	599.166	0,04
350.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026	331.889	0,02
1.099.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	988.719	0,07
971.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	896.568	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Finanzwerte Forts.		
607.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	550.079	0,04
1.271.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	1.118.733	0,08
1.245.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033	1.059.929	0,07
400.000	Ryan Specialty Group LLC '144A' 4.375% 01-Feb-2030	371.500	0,03
640.000	Sagcor Financial Co Ltd '144A' 5.300% 13-May-2028	615.078	0,04
1.434.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	1.290.223	0,09
1.500.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	1.441.925	0,10
320.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	262.518	0,02
540.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	419.862	0,03
282.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	275.658	0,02
609.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	569.090	0,04
320.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	290.060	0,02
189.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	156.657	0,01
330.000	Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026	320.793	0,02
363.000	Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027	332.710	0,02
644.000	Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025	651.857	0,04
104.000	SLM Corp 3.125% 02-Nov-2026	97.062	0,01
405.000	SLM Corp 4.200 % 29-Oct-2025	393.210	0,03
264.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	260.722	0,02
37.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.625% 15-Jul-2026	35.082	0,00
430.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.750% 31-Dec-2024	422.284	0,03
80.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2027	75.479	0,00
205.000	StoneX Group Inc '144A' 8.625% 15-Jun-2025	208.022	0,01
1.437.000	Synchrony Financial 7.250% 02-Feb-2033	1.430.406	0,10
269.000	Texas Capital Bancshares Inc FRN 4.000% 06-May-2031	233.674	0,02
1.500.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459 % 30-Jun-2035	1.413.721	0,10
885.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	867.272	0,06
1.544.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	1.590.866	0,11
943.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	938.423	0,06
1.445.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	1.369.679	0,09
515.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	505.285	0,03
728.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	509.520	0,03
150.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 4.750% 15-Apr-2028	129.503	0,01
1.125.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	812.533	0,06
1.755.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 10.500% 15-Feb-2028	1.780.549	0,12
132.000	Valley National Bancorp FRN 3.000% 15-Jun-2031	112.325	0,01
155.000	Valley National Bancorp FRN 6.250% 30-Sep-2032	130.509	0,01
160.000	Vornado Realty LP 2.150% 01-Jun-2026	144.338	0,01
110.000	Vornado Realty LP 3.400% 01-Jun-2031	85.285	0,01
653.000	Western Alliance Bancorp FRN 3.000% 15-Jun-2031	569.742	0,04
215.000	Western Alliance Bank 'BKNT' FRN 5.250% 01-Jun-2030	204.788	0,01
60.000	Wilton RE Ltd '144A' FRN (Perpetual) 6.000% 22-Oct-2030	53.267	0,00
11.000	World Acceptance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	10.020	0,00
715.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	658.965	0,04
698.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	696.852	0,05
Industrie - 146.041.038			
(31. Dezember 2022: 125.327.974)		146.041.038	9,95
186.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	179.673	0,01
854.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2030	860.946	0,06
748.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	743.008	0,05
960.000	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC '144A' 10.250% 15-Oct-2028	987.600	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Industrie Forts.				Industrie Forts.		
363.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	332.706	0,02	250.000	Danaos Corp '144A' 8.500% 01-Mar-2028	254.060	0,02
443.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	441.861	0,03	476.000	Dycor Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	442.251	0,03
494.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	460.630	0,03	104.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	104.130	0,01
945.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	442.529	0,03	2.990.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	3.057.634	0,21
606.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	530.887	0,04	260.000	EnerSys '144A' 4.375% 15-Dec-2027	247.163	0,02
1.580.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	1.340.631	0,09	28.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	27.742	0,00
886.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	883.214	0,06	482.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026	474.770	0,03
2.114.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	1.930.811	0,13	630.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	546.938	0,04
799.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	777.701	0,05	48.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	45.841	0,00
1.151.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	894.608	0,06	1.487.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250 % 15-Nov-2026	1.327.163	0,09
920.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	715.065	0,05	251.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250 % 15-Nov-2026	225.272	0,02
1.317.814	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	1.250.283	0,09	962.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026	958.239	0,07
685.000	Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031	612.168	0,04	736.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	680.889	0,05
184.000	ATS Corp '144A' 4.125% 15-Dec-2028	169.359	0,01	1.406.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	1.373.808	0,09
1.641.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	1.410.168	0,10	588.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	543.962	0,04
210.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	181.453	0,01	528.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	520.535	0,04
385.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	383.834	0,03	478.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2029	441.961	0,03
361.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	360.884	0,02	1.287.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029	1.213.436	0,08
1.619.000	Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	1.655.355	0,11	703.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029	642.824	0,04
302.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	294.224	0,02	736.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2032	679.901	0,05
213.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	211.630	0,01	615.000	GN Bondco LLC '144A' 9.500% 15-Oct-2031	601.242	0,04
270.000	Boise Cascade Co '144A' 4.875% 01-Jul-2030	253.800	0,02	460.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	414.554	0,03
1.710.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	1.667.769	0,11	185.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029	157.480	0,01
530.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	528.078	0,04	909.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	894.261	0,06
415.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	474.137	0,03	606.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	565.736	0,04
465.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Feb-2029	472.856	0,03	719.000	Hillenbrand Inc 3.750% 01-Mar-2031	621.505	0,04
1.513.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	1.514.764	0,10	305.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	301.810	0,02
470.000	Bombardier Inc '144A' 8.750% 15-Nov-2030	501.117	0,03	839.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	766.724	0,05
1.088.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 10.375% 01-Aug-2030	1.151.953	0,08	145.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	145.000	0,01
975.000	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2026	975.717	0,07	285.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	292.650	0,02
813.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	734.488	0,05	315.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	329.286	0,02
520.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	502.741	0,03	773.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	814.647	0,06
600.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2032	613.493	0,04	1.212.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	1.230.249	0,08
290.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	269.206	0,02	731.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	729.624	0,05
1.340.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	1.224.204	0,08	1.887.000	Intelligent Packaging Ltd Fincio Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028	1.762.590	0,12
1.040.000	Camelot Return Merger Sub Inc '144A' 8.750% 01-Aug-2028	1.056.977	0,07	544.000	James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028	526.869	0,04
598.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	547.980	0,04	344.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2025	333.174	0,02
292.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	239.311	0,02	17.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.875% 15-Dec-2027	16.083	0,00
932.000	Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	976.363	0,07	905.000	Knife River Corp '144A' 7.750% 01-May-2031	964.956	0,07
490.000	Chart Industries Inc '144A' 9.500% 01-Jan-2031	532.688	0,04	1.167.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	1.061.241	0,07
504.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	494.464	0,03	728.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	708.729	0,05
20.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	19.233	0,00	510.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	430.631	0,03
507.000	Clean Harbors Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2031	516.078	0,04	900.000	LABL Inc '144A' 9.500% 01-Nov-2028	910.125	0,06
65.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 6.625% 15-Apr-2029	63.978	0,00	1.070.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	1.027.666	0,07
1.605.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Apr-2030	1.498.391	0,10	490.000	Louisiana-Pacific Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	439.485	0,03
355.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029	291.464	0,02	545.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	496.344	0,03
314.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	267.947	0,02	1.215.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	1.072.345	0,07
1.245.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	1.089.226	0,07	524.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	527.893	0,04
760.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	662.553	0,05	161.000	Masonite International Corp '144A' 3.500% 15-Feb-2030	139.752	0,01
510.000	Crown Americas LLC 5.250% 01-Apr-2030	502.814	0,03	386.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	371.085	0,03
63.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	61.171	0,00	3.251.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.875% 15-Aug-2026	3.311.124	0,23
866.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	858.360	0,06	2.115.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 9.250% 15-Apr-2027	2.078.214	0,14
685.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	719.932	0,05	460.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A' 11.500% 01-Sep-2028	477.245	0,03
				1.046.000	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2030	926.934	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Industrie Forts.		
355.000	Moog Inc '144A' 4.250% 15-Dec-2027	335.562	0,02
471.000	Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	429.603	0,03
666.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	636.177	0,04
30.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	30.126	0,00
561.000	OI European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	525.288	0,04
311.000	Oscar AcquisitionCo LLC / Oscar Finance Inc '144A' 9.500% 15-Apr-2030	303.594	0,02
343.000	OT Merger Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2029	205.826	0,01
844.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.375% 15-Aug-2025	849.960	0,06
705.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.625% 13-May-2027	705.879	0,05
283.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 7.250% 15-May-2031	287.285	0,02
481.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	449.366	0,03
595.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	554.944	0,04
425.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	431.751	0,03
633.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	586.240	0,04
500.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	498.932	0,03
268.000	Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc '144A' 8.250% 15-Nov-2028	265.630	0,02
910.000	Rand Parent LLC '144A' 8.500% 15-Feb-2030	872.387	0,06
730.000	Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029	676.476	0,05
1.795.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	1.730.829	0,12
864.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750 % 15-Oct-2027	866.059	0,06
500.000	RXO Inc '144A' 7.500% 15-Nov-2027	516.415	0,04
625.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	587.000	0,04
722.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	695.442	0,05
528.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	528.525	0,04
425.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	451.248	0,03
940.000	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US '144A' 6.125% 01-Feb-2028	948.358	0,06
1.627.000	Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029	1.362.530	0,09
993.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	949.340	0,06
2.465.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	2.430.765	0,17
640.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 8.875% 15-Nov-2031	673.543	0,05
185.000	Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026	178.016	0,01
2.014.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	1.783.623	0,12
545.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 9.375% 30-Nov-2029	596.944	0,04
11.000	SPX FLOW Inc '144A' 8.750% 01-Apr-2030	11.013	0,00
1.336.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	1.151.204	0,08
1.754.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	1.616.100	0,11
2.195.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	2.115.480	0,14
560.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	546.334	0,04
461.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	418.696	0,03
770.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	745.695	0,05
550.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	551.046	0,04
573.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	540.686	0,04
501.000	Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	528.312	0,04
521.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	524.790	0,04
664.000	TK Elevator Holdco GmbH '144A' 7.625% 15-Jul-2028	653.038	0,04
2.557.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	2.514.448	0,17
987.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	895.384	0,06
11.000	TopBuild Corp '144A' 4.125% 15-Feb-2032	9.801	0,00
1.555.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	1.460.922	0,10
757.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	708.603	0,05
	Industrie Forts.		
4.864.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	4.767.960	0,32
675.000	TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027	678.286	0,05
4.806.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	4.802.278	0,33
3.895.000	TransDigm Inc '144A' 6.750% 15-Aug-2028	3.989.508	0,27
2.338.000	TransDigm Inc '144A' 6.875% 15-Dec-2030	2.409.671	0,16
300.000	TransDigm Inc '144A' 7.125% 01-Dec-2031	314.624	0,02
220.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 12.750% 31-Dec-2028	235.675	0,02
325.000	TriMas Corp '144A' 4.125% 15-Apr-2029	292.398	0,02
26.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	25.641	0,00
200.000	Trinity Industries Inc '144A' 7.750% 15-Jul-2028	206.741	0,01
96.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	95.829	0,01
2.140.000	Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	2.277.814	0,16
1.865.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.500% 15-Aug-2026	1.831.717	0,12
565.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	554.807	0,04
483.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	471.916	0,03
1.300.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	1.220.656	0,08
675.000	Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029	500.375	0,03
160.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	151.522	0,01
684.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	659.123	0,05
704.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	704.750	0,05
473.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	418.789	0,03
1.090.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	1.098.904	0,07
1.483.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	1.525.004	0,10
275.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	281.582	0,02
	Versicherungen - 2.867.161		
	(31. Dezember 2022: 1.904.107)	2.867.161	0,20
1.010.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	908.727	0,06
610.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032	533.916	0,04
1.504.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	1.424.518	0,10
	Sonstige Industrie - 9.136.464		
	(31. Dezember 2022: 10.070.646)	9.136.464	0,62
252.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	242.665	0,02
715.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	709.094	0,05
257.000	API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029	235.633	0,01
407.000	API Group DE Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2029	382.759	0,02
425.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	402.250	0,03
1.060.000	Grand Canyon University 4.125% 01-Oct-2024	1.002.993	0,07
1.169.000	Grand Canyon University 5.125% 01-Oct-2028	1.048.196	0,07
440.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	429.227	0,03
412.000	KBR Inc '144A' 4.750% 30-Sep-2028	383.532	0,03
695.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	662.967	0,04
580.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	550.631	0,04
2.448.000	Vericast Corp '144A' 11.000% 15-Sep-2026	2.604.060	0,18
481.000	Williams Scotsman Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025	482.457	0,03
	Technologie - 113.060.812		
	(31. Dezember 2022: 100.576.647)	113.060.812	7,70
835.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2026	830.390	0,06
260.000	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL '144A' 5.000% 01-May-2028	213.447	0,01
391.000	Ahead DB Holdings LLC '144A' 6.625% 01-May-2028	341.052	0,02
1.295.000	Alteryx Inc '144A' 8.750% 15-Mar-2028	1.379.479	0,09
1.030.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	1.043.827	0,07
300.000	ams-OSRAM AG '144A' 12.250% 30-Mar-2029	333.999	0,02
3.036.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	2.760.200	0,19
1.047.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	993.341	0,07
1.006.000	Block Inc 2.750% 01-Jun-2026	949.400	0,06
390.000	Block Inc 3.500% 01-Jun-2031	347.041	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Technologie Forts.		
935.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	941.012	0,06
337.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 9.125% 01-Mar-2026	338.580	0,02
1.502.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	1.468.421	0,10
405.000	Capstone Borrower Inc '144A' 8.000% 15-Jun-2030	421.795	0,03
475.000	Castle US Holding Corp '144A' 9.500% 15-Feb-2028	247.463	0,02
1.000.000	Central Parent Inc / CDK Global Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2029	1.022.682	0,07
459.000	Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc '144A' 8.000% 15-Jun-2029	479.439	0,03
985.000	Ciena Corp '144A' 4.000% 31-Jan-2030	898.177	0,06
1.065.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028	1.005.203	0,07
780.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029	732.751	0,05
5.494.000	Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	5.239.334	0,36
4.572.000	Cloud Software Group Inc '144A' 9.000% 30-Sep-2029	4.358.991	0,30
557.000	Coherent Corp '144A' 5.000% 15-Dec-2029	529.596	0,04
1.444.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	970.867	0,07
2.181.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	1.945.888	0,13
605.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	287.971	0,02
1.251.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	663.030	0,05
617.000	CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027	257.403	0,02
693.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	565.446	0,04
2.772.000	Condor Merger Sub Inc '144A' 7.375% 15-Feb-2030	2.536.272	0,17
511.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029	460.735	0,03
1.280.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	1.218.317	0,08
1.399.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028	1.270.412	0,09
755.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	662.124	0,04
1.029.000	CPI CG Inc '144A' 8.625% 15-Mar-2026	999.740	0,07
885.000	Crane Holdings Co 4.200% 15-Mar-2048	665.697	0,05
490.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	443.577	0,03
410.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 5.000% 15-Dec-2029	382.903	0,03
835.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	767.621	0,05
923.000	Entegris Escrow Corp '144A' 5.950% 15-Jun-2030	917.618	0,06
949.000	Entegris Inc '144A' 3.625% 01-May-2029	861.407	0,06
378.000	Entegris Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2028	360.051	0,02
230.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	209.599	0,01
900.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	851.858	0,06
520.000	Fair Isaac Corp '144A' 5.250% 15-May-2026	516.755	0,04
521.000	Gen Digital Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025	516.256	0,03
1.755.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	1.785.883	0,12
955.000	Gen Digital Inc '144A' 7.125% 30-Sep-2030	999.087	0,07
914.000	GoTo Group Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	442.991	0,03
559.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	519.994	0,04
418.000	Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl '144A' 4.625% 01-May-2028	384.176	0,03
2.451.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	2.332.533	0,16
660.000	ION Trading Technologies Sarl '144A' 5.750% 15-May-2028	582.886	0,04
1.448.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	1.322.884	0,09
1.185.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	1.157.260	0,08
1.665.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	1.578.776	0,11
630.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	606.186	0,04
955.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	929.030	0,06
1.676.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	1.603.564	0,11
1.108.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	1.052.114	0,07
1.958.000	Iron Mountain Information Management Services Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2032	1.793.548	0,12
400.000	Likewise Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	405.896	0,03
360.000	MicroStrategy Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2028	349.634	0,02
1.820.000	NCR Atleos Corp '144A' 9.500% 01-Apr-2029	1.935.335	0,13
391.000	NCR Corp '144A' 5.000% 01-Oct-2028	370.177	0,03
727.000	NCR Corp '144A' 5.125% 15-Apr-2029	691.825	0,05
	Technologie Forts.		
951.000	NCR Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2030	874.337	0,06
4.300.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	4.012.244	0,27
742.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3.875% 01-Sep-2028	688.870	0,05
1.168.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 15-Feb-2028	1.086.659	0,07
1.483.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 01-Dec-2029	1.331.160	0,09
1.078.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 15-Feb-2030	976.772	0,07
830.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2031	735.521	0,05
510.000	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2029	451.227	0,03
932.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6.875% 15-Mar-2027	871.420	0,06
2.000.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7.250% 15-Mar-2029	1.714.610	0,12
57.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4.875% 01-Feb-2027	55.925	0,00
615.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8.250% 01-Feb-2028	621.957	0,04
510.000	PTC Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2025	499.287	0,03
130.000	PTC Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2028	123.313	0,01
600.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2028	241.563	0,02
645.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5.375% 01-Dec-2028	233.106	0,02
1.919.000	RingCentral Inc '144A' 8.500% 15-Aug-2030	1.964.260	0,13
520.000	Rocket Software Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2029	452.954	0,03
243.676	RRD Parent Inc '144A' 10.000% 15-Oct-2031	417.904	0,03
640.000	Sabre Global Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2027	629.219	0,04
630.000	Science Applications International Corp '144A' 4.875% 01-Apr-2028	602.582	0,04
363.000	Seagate HDD Cayman 3.125% 15-Jul-2029	296.079	0,02
685.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	634.433	0,04
635.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	568.481	0,04
977.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	969.853	0,07
699.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	686.324	0,05
488.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	469.522	0,03
1.025.000	Seagate HDD Cayman 9.625% 01-Dec-2032	1.172.959	0,08
310.000	Seagate HDD Cayman '144A' 8.500% 15-Jul-2031	336.703	0,02
2.185.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029	2.033.178	0,14
760.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	761.628	0,05
776.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.875% 01-Sep-2030	771.660	0,05
620.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	547.363	0,04
396.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	368.298	0,02
465.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	452.461	0,03
1.640.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	1.617.067	0,11
376.000	Synaptics Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	337.776	0,02
260.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp '144A' 5.750% 01-Jun-2025	261.400	0,02
250.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	227.398	0,02
407.000	Twilio Inc 3.625% 15-Mar-2029	371.721	0,03
325.000	Twilio Inc 3.875% 15-Mar-2031	290.116	0,02
2.325.000	Unisys Corp '144A' 6.875% 01-Nov-2027	2.095.674	0,14
549.000	Vericast Corp '144A' 12.500% 15-Dec-2027	624.205	0,04
1.891.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7.500% 01-Sep-2025	1.555.907	0,11
560.000	Verscend Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Aug-2026	564.133	0,04
560.000	Viavi Solutions Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2029	490.952	0,03
298.000	Virtusa Corp '144A' 7.125% 15-Dec-2028	256.021	0,02
350.000	West Technology Group LLC '144A' 8.500% 10-Apr-2027	302.750	0,02
3.879.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	3.809.598	0,26
280.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	217.799	0,01
525.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	459.041	0,03
1.148.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2025	1.125.685	0,08
2.040.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	1.843.836	0,13
606.000	Ziff Davis Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2030	556.626	0,04
1.485.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3.875% 01-Feb-2029	1.348.329	0,09

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Transport – 25.217.974			
(31. Dezember 2022: 26.689.283)			
1.025.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	979.809	0,07
550.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	594.000	0,04
845.000	Allegiant Travel Co '144A' 7.250% 15-Aug-2027	827.767	0,06
894.289	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	857.477	0,06
350.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	341.707	0,02
3.607.500	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	3.584.193	0,25
4.085.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	3.985.356	0,27
465.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 4.750% 01-Apr-2028	428.632	0,03
335.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.375% 01-Mar-2029	310.298	0,02
550.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	527.605	0,04
311.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	301.784	0,02
340.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	331.214	0,02
1.290.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	1.181.945	0,08
331.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	320.498	0,02
747.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	772.709	0,05
320.187	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	296.173	0,02
1.461.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / Hawaiian Miles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	1.376.559	0,09
465.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	417.321	0,03
1.295.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000 % 01-Dec-2029	1.064.186	0,07
960.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	684.565	0,05
1.268.333	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	904.434	0,06
405.000	Stena International SA '144A' 6.125% 01-Feb-2025	403.693	0,03
258.000	United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-Jan-2025	255.044	0,02
2.615.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	2.551.510	0,17
2.050.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	1.919.495	0,13
Versorger – 36.792.306			
(31. Dezember 2022: 31.227.179)			
905.000	Algonquin Power & Utilities Corp FRN 4.750% 18-Jan-2082	765.752	0,05
795.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.500% 20-May-2025	784.600	0,05
40.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp '144A' 9.375% 01-Jun-2028	41.361	0,00
654.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028	613.509	0,04
939.000	Calpine Corp '144A' 3.750% 01-Mar-2031	825.932	0,06
1.747.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	1.661.445	0,11
820.000	Calpine Corp '144A' 4.625% 01-Feb-2029	761.515	0,05
1.650.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	1.514.995	0,10
1.648.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	1.581.207	0,11
426.000	Calpine Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2026	420.281	0,03
610.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Feb-2031	537.579	0,04
353.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Jan-2032	307.861	0,02
1.061.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4.750% 15-Mar-2028	1.022.475	0,07
654.000	DPL Inc 4.125% 01-Jul-2025	638.163	0,04
1.019.000	DPL Inc 4.350 % 15-Apr-2029	946.607	0,06
1.143.000	Drax Finco Plc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	1.125.660	0,08
520.000	Edison International FRN 8.125% 15-Jun-2053	532.135	0,04
120.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	111.697	0,01
343.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	331.254	0,02
445.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	375.381	0,02
520.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	449.844	0,03
1.544.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	1.090.750	0,07
1.140.000	FirstEnergy Corp 4.150 % 15-Jul-2027	1.097.353	0,07
673.000	FirstEnergy Corp 5.100 % 15-Jul-2047	616.985	0,04
475.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	560.941	0,04

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Anleihen Forts.				
Versorger Forts.				
258.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC '144A' 4.250% 01-Jul-2029	225.080	0,01	
415.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	395.802	0,03	
93.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.500% 15-Sep-2027	89.583	0,01	
695.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 7.250% 15-Jan-2029	727.319	0,05	
1.293.000	NRG Energy Inc 5.750% 15-Jan-2028	1.288.994	0,09	
310.000	NRG Energy Inc 6.625% 15-Jan-2027	310.838	0,02	
456.000	NRG Energy Inc '144A' 3.375 % 15-Feb-2029	403.519	0,03	
1.685.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625 % 15-Feb-2031	1.449.847	0,10	
112.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875 % 15-Feb-2032	96.009	0,01	
105.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	101.781	0,01	
136.508	Panoche Energy Center LLC '144A' 6.885% 31-Jul-2029	139.001	0,01	
574.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	543.374	0,04	
1.016.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	991.858	0,07	
1.114.000	PG&E Corp 5.250% 01-Jul-2030	1.076.431	0,07	
655.000	Pike Corp '144A' 8.625% 31-Jan-2031	689.176	0,05	
230.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	233.486	0,02	
650.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 8.625% 01-Jun-2030	693.988	0,05	
583.000	Terraform Global Operating LP '144A' 6.125% 01-Mar-2026	574.966	0,04	
231.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	231.440	0,02	
1.012.000	TransAlta Corp 7.750% 15-Nov-2029	1.074.672	0,07	
1.025.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	957.742	0,06	
1.502.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.000% 31-Jul-2027	1.463.494	0,10	
1.575.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2026	1.558.767	0,11	
1.335.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2027	1.317.633	0,09	
1.388.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 7.750% 15-Oct-2031	1.442.224	0,10	
Gesamtanlagen in Anleihen		1.419.592.807	96,73	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte – 1.338				
(31. Dezember 2022: –)				
30	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	3.540.469	416	0,00
7	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	874.562	425	0,00
8	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.068.750	497	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			1.338	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 15.203.497 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 4.655.050)			15.203.497	1,04
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			1.434.797.642	97,77
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (158.760) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (3.999.065))			(158.760)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(158.760)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen			33.001.129	2,24
Summe Nettovermögen			1.467.640.011	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

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	96,46
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,00
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,03
Sonstiges Umlaufvermögen	2,51
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (B)	Betrag (S)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	62	73	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	US-Dollar	118	136	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	76	88	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schweizer Franken	US-Dollar	10.531	12.014	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	521
USD						529
CHF						445
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.689	1.866	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	4.618	5.049	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	51
Euro	US-Dollar	1.710	1.848	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	41
Euro	US-Dollar	4.671.666	5.025.947	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	133.563
USD						133.655
EUR						121.070
US-Dollar	Euro	4.685.968	4.347.434	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(115.451)
USD						(115.451)
EUR						(104.580)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	427	472	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	946	1.034	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	605	666	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	82.921	89.209	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.371
USD						2.383
EUR						2.159
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	96	105	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	13.145	14.142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	376
Euro	US-Dollar	67	74	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	150	164	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
USD						378
EUR						342
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	63	70	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	140	153	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	89	98	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	12.244	13.172	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	350
USD						352
EUR						319

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	977.588	1.076.569	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.640
Euro	US-Dollar	23.346	25.720	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	64
Euro	US-Dollar	61.037	67.256	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	155
Euro	US-Dollar	234.481	258.198	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	768
Euro	US-Dollar	432.063	472.719	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.462
Euro	US-Dollar	50.897	55.929	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	284
Euro	US-Dollar	376.415	410.531	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.191
Euro	US-Dollar	57.406	63.172	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	229
Euro	US-Dollar	2.638.899	2.885.444	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29.025
Euro	US-Dollar	1.693.000	1.863.245	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.549
Euro	US-Dollar	146.782	159.901	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.208
Euro	US-Dollar	95.620	103.376	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.229
Euro	US-Dollar	191.652	206.578	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.088
Euro	US-Dollar	73.504	79.228	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.952
Euro	US-Dollar	231.529.824	249.088.122	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.619.450
US-Dollar	Euro	668.945	604.374	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.459
USD						6.681.753
EUR						6.052.586
US-Dollar	Euro	25.710	23.346	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)
Euro	US-Dollar	604.374	668.710	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.482)
Euro	US-Dollar	1.199.841	1.325.307	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(172)
US-Dollar	Euro	1.076.980	977.588	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.694)
US-Dollar	Euro	467.167	423.968	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.073)
US-Dollar	Euro	458.669	416.537	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.365)
US-Dollar	Euro	369.398	337.628	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.487)
US-Dollar	Euro	137.712	125.323	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(698)
US-Dollar	Euro	35.967	32.906	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(376)
US-Dollar	Euro	21.367	19.591	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(270)
US-Dollar	Euro	85.797	77.966	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(311)
US-Dollar	Euro	236.834	217.402	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.270)
US-Dollar	Euro	180.758	167.197	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.898)
US-Dollar	Euro	374.959	347.868	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9.236)
US-Dollar	Euro	64.739	60.062	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.595)
USD						(29.990)
EUR						(27.166)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	11.549	12.628	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	127
Euro	US-Dollar	7.406	8.151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Euro	US-Dollar	1.012.014	1.088.761	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	28.934
USD						29.090
EUR						26.351

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	5.245	5.794	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	56	61	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	123	134	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	79	86	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.753	11.569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	307
USD						308
EUR						279
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	25.228	27.585	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	278
Euro	US-Dollar	16.158	17.783	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	63
Euro	US-Dollar	2.211.120	2.378.803	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	63.216
USD						63.557
EUR						57.572
Euro	US-Dollar	11.427	12.622	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(2)
EUR						(2)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	32.368	41.210	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
Pfund Sterling	US-Dollar	584.575	744.348	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	826
Pfund Sterling	US-Dollar	1.253.003	1.593.438	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.799
Pfund Sterling	US-Dollar	107.291.347	134.720.635	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.046.548
Pfund Sterling	US-Dollar	1.569.600	1.970.252	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	30.560
Pfund Sterling	US-Dollar	565.616	720.319	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	687
US-Dollar	Pfund Sterling	33.980	26.600	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	72
USD						2.082.541
GBP						1.633.814
Pfund Sterling	US-Dollar	805.915	1.027.676	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(355)
US-Dollar	Pfund Sterling	41.212	32.368	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(49)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.900	10.167	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(60)
USD						(464)
GBP						(364)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	62	79	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	134	170	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	86	110	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	11.614	14.583	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	222
Pfund Sterling	US-Dollar	60	77	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						222
GBP						174
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	64.741	82.255	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	272
Pfund Sterling	US-Dollar	1.151.059	1.465.659	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.627
Pfund Sterling	US-Dollar	51.425	65.249	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	303
Pfund Sterling	US-Dollar	97.299	123.071	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	958
Pfund Sterling	US-Dollar	511.663	648.543	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.688
Pfund Sterling	US-Dollar	2.468.027	3.138.577	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7.483
Pfund Sterling	US-Dollar	41.245.103	52.097.878	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	478.371
Pfund Sterling	US-Dollar	41.011.505	51.562.744	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	715.731
Pfund Sterling	US-Dollar	132.199.114	165.996.133	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.521.656
Pfund Sterling	US-Dollar	1.113.357	1.417.875	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.352
Pfund Sterling	US-Dollar	38.258	48.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
USD						3.731.499
GBP						2.927.469
US-Dollar	Pfund Sterling	48.708	38.258	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.095.322	1.396.719	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(482)
US-Dollar	Pfund Sterling	224.584	177.001	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.044)
US-Dollar	Pfund Sterling	33.631	26.632	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(317)
US-Dollar	Pfund Sterling	89.948	71.112	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(700)
USD						(2.601)
GBP						(2.041)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	29.179	37.154	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	41
Pfund Sterling	US-Dollar	62.744	79.792	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	190
Pfund Sterling	US-Dollar	5.452.536	6.846.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	104.005
Pfund Sterling	US-Dollar	28.232	35.953	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	34
USD						104.270
GBP						81.803
Pfund Sterling	US-Dollar	40.286	51.372	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18)
USD						(18)
GBP						(14)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	60	77	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	129	164	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	83	106	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	11.186	14.046	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	213
Pfund Sterling	US-Dollar	58	74	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						213
GBP						167
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	18.595	23.622	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	80
Pfund Sterling	US-Dollar	55.772	71.007	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	84
Pfund Sterling	US-Dollar	107.392	136.434	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	462
Pfund Sterling	US-Dollar	217.408	276.222	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	915
Pfund Sterling	US-Dollar	672.047	855.726	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	950
Pfund Sterling	US-Dollar	226.479	287.363	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.336
Pfund Sterling	US-Dollar	364.032	459.707	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.334
Pfund Sterling	US-Dollar	223.047	283.822	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	501
Pfund Sterling	US-Dollar	220.964	279.493	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.175
Pfund Sterling	US-Dollar	44.779	57.014	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	67
Pfund Sterling	US-Dollar	222.667	282.234	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.605
Pfund Sterling	US-Dollar	230.782	291.508	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.677
Pfund Sterling	US-Dollar	261.761	329.105	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.568
Pfund Sterling	US-Dollar	155.971	195.912	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.908
Pfund Sterling	US-Dollar	122.815.544	154.213.630	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.342.667
Pfund Sterling	US-Dollar	112.416	141.111	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.189
Pfund Sterling	US-Dollar	652.476	830.936	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	792
Pfund Sterling	US-Dollar	1.421.047	1.807.139	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.309
US-Dollar	Pfund Sterling	60.632	47.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	128
USD						2.372.747
GBP						1.861.489
US-Dollar	Pfund Sterling	136.426	107.392	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(462)
US-Dollar	Pfund Sterling	57010	44.779	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(68)
Pfund Sterling	US-Dollar	767.322	980.202	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.076)
Pfund Sterling	US-Dollar	913.533	1.164.907	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(402)
US-Dollar	Pfund Sterling	71.011	55.772	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(84)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.623	18.595	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.979	14.151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(59)
US-Dollar	Pfund Sterling	315.706	248.817	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.468)
US-Dollar	Pfund Sterling	157.209	124.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.482)
US-Dollar	Pfund Sterling	166.314	130.701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(294)
US-Dollar	Pfund Sterling	63.784	50.427	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(496)
US-Dollar	Pfund Sterling	103.486	81.645	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(588)
US-Dollar	Pfund Sterling	34.944	27.664	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(321)
US-Dollar	Pfund Sterling	69.060	54.928	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(959)
US-Dollar	Pfund Sterling	60.593	48.240	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(899)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	31.919	25.428	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(495)
USD						(10.233)
GBP						(8.028)

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Supranational - 4.685.000			
(31. Dezember 2022: 17.750.000)			
4.685.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	4.685.000	1,65
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		4.685.000	1,65
Anleihen			
Argentinien - 2.989.579			
(31. Dezember 2022: 7.498.992)			
1.500.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.625% 09-Jul-2035	521.958	0,18
482.000	Banco Macro SA 'REGS' FRN 6.643% 04-Nov-2026	418.740	0,15
200.000	YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10.000% 25-Jul-2026	192.843	0,07
2.028.000	YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029	1.856.038	0,65
Brasilien - 13.206.259			
(31. Dezember 2022: 20.318.784)			
300.000	Adecoagro SA 'REGS' 6.000% 21-Sep-2027	290.172	0,10
300.000	Azul Secured Finance LLP 'REGS' 11.930% 28-Aug-2028	311.204	0,11
1.400.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 7.250% 13-Feb-2033	1.157.476	0,41
1.469.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 8.500% 12-Jan-2031	1.349.644	0,48
1.200.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	1.061.609	0,37
2.000.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	1.540.000	0,54
2.200.000	CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	2.290.816	0,81
460.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	374.828	0,13
2.200.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	1.825.576	0,64
795.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 8.875% 13-Sep-2033	841.940	0,30
1.300.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	1.107.964	0,39
1.200.000	Suzano Austria GmbH 3.750% 15-Jan-2031	1.055.030	0,37
Burkina Faso - 2.777.175			
(31. Dezember 2022: 2.576.400)			
3.000.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	2.777.175	0,98
Chile - 6.274.672			
(31. Dezember 2022: 10.972.624)			
2.040.000	CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031	1.560.600	0,55
1.440.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	1.150.567	0,41
1.500.000	Inversiones CMPC SA 'REGS' 3.000% 06-Apr-2031	1.271.761	0,45
500.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024	346.598	0,12
2.200.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	1.945.146	0,68
China - 10.917.040			
(31. Dezember 2022: 29.405.844)			
500.000	Agile Group Holdings Ltd 5.500% 21-Apr-2025	75.160	0,03
500.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.000% 06-Dec-2037	431.166	0,15
1.200.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	1.131.696	0,40
1.000.000	Baidu Inc 2.375% 09-Oct-2030	846.940	0,30
200.000	Central Plaza Development Ltd 'EMTN' 3.850% 14-Jul-2025	169.534	0,06
200.000	China Resources Land Ltd 'EMTN' 4.125% 26-Feb-2029	185.972	0,06
200.000	Fortune Star BVI Ltd 5.000% 18-May-2026	146.710	0,05
200.000	Franshion Brilliant Ltd 4.250% 23-Jul-2029	130.206	0,05
200.000	Franshion Brilliant Ltd FRN (Perpetual) 6.000% 08-Feb-2026	170.744	0,06
200.000	Fuqing Investment Management Ltd 'EMTN' 3.250% 23-Jun-2025	162.396	0,06
200.000	Longfor Group Holdings Ltd 3.950% 16-Sep-2029	92.201	0,03
1.600.000	Prosus NV 'REGS' 2.085% 19-Jan-2030	1.487.302	0,52
600.000	Prosus NV 'REGS' 3.832% 08-Feb-2051	380.306	0,13
3.350.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	2.890.615	1,02
1.000.000	Prosus NV 'REGS' 4.987% 19-Jan-2052	758.046	0,27
400.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd 5.125% 26-Jul-2026	94.108	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
China Forts.			
200.000	Shui On Development Holding Ltd 5.500% 03-Mar-2025	115.049	0,04
500.000	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 6.750% 30-Sep-2028	39.000	0,01
1.000.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.840% 22-Apr-2051	754.234	0,27
1.000.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.940% 22-Apr-2061	737.690	0,26
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN' 3.500% 12-Nov-2029	117.965	0,04
Kolumbien - 14.078.887			
(31. Dezember 2022: 16.801.230)			
1.800.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033	1.390.689	0,49
700.000	Aris Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	607.759	0,21
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA 'REGS' 4.875% 21-Apr-2025	973.320	0,34
600.000	Banco Davivienda SA 'REGS' FRN (Perpetual) 6.650% 22-Apr-2031	427.500	0,15
2.000.000	Bancolombia SA FRN 4.625% 18-Dec-2029	1.855.275	0,65
2.500.000	Ecopetrol SA 4.625% 02-Nov-2031	2.123.312	0,75
1.500.000	Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045	1.182.520	0,42
1.300.000	Ecopetrol SA 5.875% 02-Nov-2051	982.531	0,35
290.000	Ecopetrol SA 8.625% 19-Jan-2029	309.878	0,11
1.900.000	Frontera Energy Corp 'REGS' 7.875% 21-Jun-2028	1.425.416	0,50
800.000	Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027	710.491	0,25
1.500.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	1.247.163	0,44
900.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028	843.033	0,30
Costa Rica - 721.700			
(31. Dezember 2022: -)			
705.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 'REGS' 10.875% 15-Jan-2031	721.700	0,25
Elfenbeinküste - 1.590.695			
(31. Dezember 2022: -)			
1.000.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2.750% 22-Jan-2033	844.355	0,30
800.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	746.340	0,26
Tschechische Republik - 1.172.855			
(31. Dezember 2022: 680.887)			
1.200.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	1.172.855	0,41
Ecuador - 840.365			
(31. Dezember 2022: 1.500.551)			
817.985	International Airport Finance SA 'REGS' 12.000% 15-Mar-2033	840.365	0,30
Ägypten - 2.637.927			
(31. Dezember 2022: 4.605.250)			
1.600.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031	1.361.600	0,48
1.400.000	Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	1.276.327	0,45
Estland - 1.722.474			
(31. Dezember 2022: -)			
2.000.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	1.722.474	0,61
Ghana - 1.223.622			
(31. Dezember 2022: 1.449.023)			
500.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.125% 04-Apr-2026	477.582	0,17
400.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.750% 01-May-2027	372.342	0,13
400.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025	373.698	0,13
Guatemala - 3.282.620			
(31. Dezember 2022: 2.684.475)			
600.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	562.967	0,20
2.037.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	1.783.713	0,63

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Guatemala Forts.			
1.000.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029	935.940	0,33
Hongkong - 5.392.815			
(31. Dezember 2022: 6.687.140)		5.392.815	1,90
3.000.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	2.838.758	1,00
800.000	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 0.750% 02-Nov-2029	753.745	0,27
1.000.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS' 2.500% 15-Apr-2031	858.270	0,30
600.000	NWD Finance BVI Ltd FRN (Perpetual) 5.250% 22-Mar-2026	397.925	0,14
600.000	Prudential Funding Asia Plc 3.125% 14-Apr-2030	544.117	0,19
Ungarn - 2.515.978			
(31. Dezember 2022: -)		2.515.978	0,89
516.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6.000% 16-May-2029	605.893	0,22
500.000	OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN 8.750% 15-May-2033	514.715	0,18
1.300.000	OTP Bank Nyrt FRN 2.875% 15-Jul-2029	1.395.370	0,49
Indien - 7.866.314			
(31. Dezember 2022: 11.686.456)		7.866.314	2,77
1.000.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	1.035.980	0,36
2.970.000	Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	2.687.197	0,95
500.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS' 5.950% 29-Jul-2026	484.750	0,17
600.000	JSW Steel Ltd 'REGS' 3.950% 05-Apr-2027	554.482	0,19
1.800.000	JSW Steel Ltd 'REGS' 5.050% 05-Apr-2032	1.554.885	0,55
600.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.975% 03-Mar-2026	558.600	0,20
1.000.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 5.650% 15-Jan-2025	990.420	0,35
Indonesien - 10.296.884			
(31. Dezember 2022: 16.821.317)		10.296.884	3,63
1.800.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT FRN (Perpetual) 4.300% 24-Mar-2027	1.599.358	0,56
2.100.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 5.315% 14-Apr-2032	2.068.348	0,73
1.700.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 6.200% 14-Apr-2052	1.692.690	0,60
2.800.000	Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	2.847.914	1,00
950.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS' 4.850% 14-Oct-2038	871.906	0,31
1.216.200	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 'REGS' 6.750% 24-Apr-2033	1.216.668	0,43
Israel - 11.817.381			
(31. Dezember 2022: 15.404.452)		11.817.381	4,16
2.300.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	1.998.700	0,70
600.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	521.400	0,18
1.250.000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 7.129% 18-Jul-2033	1.231.900	0,43
500.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.375% 30-Mar-2028	439.917	0,16
400.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	338.592	0,12
1.260.606	Energian Israel Finance Ltd '144A' 8.500% 30-Sep-2033	1.208.606	0,43
1.000.000	Israel Electric Corp Ltd '144A' 'GMTN' 3.750% 22-Feb-2032	849.494	0,30
300.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.125% 30-Jun-2025	290.902	0,10
500.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.500% 30-Jun-2027	471.707	0,17
500.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd '144A' FRN 3.077% 07-Apr-2031	444.991	0,16
2.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	2.393.536	0,84
1.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.875% 15-Sep-2031	1.627.636	0,57

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Jordanien - 2.107.864			
(31. Dezember 2022: 2.047.848)		2.107.864	0,74
2.200.000	Hikma Finance USA LLC 3.250% 09-Jul-2025	2.107.864	0,74
Kasachstan - 4.860.998			
(31. Dezember 2022: 375.030)		4.860.998	1,71
3.500.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 3.500% 14-Apr-2033	2.923.501	1,03
1.000.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	993.039	0,35
1.000.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 6.375% 24-Oct-2048	944.458	0,33
Kuwait - 4.728.259			
(31. Dezember 2022: 6.340.729)		4.728.259	1,67
2.500.000	Burgan Bank SAK FRN 2.750% 15-Dec-2031	2.111.562	0,75
1.500.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 4.500% 27-Aug-2025	1.442.130	0,51
1.300.000	NBK Tier 1 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.625% 24-Aug-2026	1.174.567	0,41
Macau - 15.200.512			
(31. Dezember 2022: 17.957.997)		15.200.512	5,35
2.000.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.375% 04-Dec-2029	1.763.690	0,62
1.500.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.750% 21-Jul-2028	1.382.841	0,49
1.750.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027	1.657.561	0,58
2.994.000	Sands China Ltd 3.500% 08-Aug-2031	2.501.245	0,88
500.000	Sands China Ltd 4.625% 18-Jun-2030	455.272	0,16
1.217.000	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	1.201.221	0,42
2.300.000	Studio City Finance Ltd 'REGS' 5.000% 15-Jan-2029	1.924.744	0,68
800.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	708.450	0,25
1.800.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026	1.752.133	0,62
2.000.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.625% 26-Aug-2028	1.853.355	0,65
Malaysia - 1.037.602			
(31. Dezember 2022: -)		1.037.602	0,37
1.500.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd 'EMTN' 3.064% 19-Aug-2050	1.037.602	0,37
Mauritius - 1.352.125			
(31. Dezember 2022: 1.276.000)		1.352.125	0,48
1.450.000	Axian Telecom 'REGS' 7.375% 16-Feb-2027	1.352.125	0,48
Mexiko - 11.275.604			
(31. Dezember 2022: 20.580.620)		11.275.604	3,97
1.000.000	America Movil SAB de CV 4.700% 21-Jul-2032	986.081	0,35
500.000	America Movil SAB de CV 6.125% 30-Mar-2040	549.486	0,19
300.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 5.875% 24-Jan-2027	276.428	0,10
600.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 24-Jan-2032	508.770	0,18
800.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 7.625% 10-Jan-2028	771.492	0,27
2.000.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN 5.125% 18-Jan-2033	1.819.210	0,64
714.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN 8.450% 29-Jun-2038	759.929	0,27
1.300.000	Bimbo Bakeries USA Inc 'REGS' 6.400% 15-Jan-2034	1.438.469	0,51
900.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	509.149	0,18
250.000	Food Service Project SA 'REGS' 5.500% 21-Jan-2027	276.366	0,10
500.000	Fresnillo Plc 'REGS' 4.250% 02-Oct-2050	382.987	0,13
800.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 3.625% 28-Jun-2031	665.032	0,23
1.000.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	828.051	0,29
1.600.000	Sixsigma Networks Mexico SA de CV 'REGS' 7.500% 02-May-2025	1.464.154	0,52
1.000.000	Unifin Financiera SAB de CV 'REGS' (Defaulted) 8.375% 27-Jan-2028	40.000	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Moldawien - 999.420		
	(31. Dezember 2022: 2.391.942)	999.420	0,35
1.435.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	999.420	0,35
	Marokko - 2.025.437		
	(31. Dezember 2022: 2.809.430)	2.025.437	0,71
1.500.000	Morocco Government International Bond 'REGS' 4.000% 15-Dec-2050	1.085.437	0,38
1.000.000	Vivo Energy Investments BV 'REGS' 5.125% 24-Sep-2027	940.000	0,33
	Nigeria - 4.477.428		
	(31. Dezember 2022: 5.815.032)	4.477.428	1,58
800.000	Access Bank Plc 'REGS' 6.125% 21-Sep-2026	720.480	0,25
1.600.000	Africa Finance Corp 3.750% 30-Oct-2029	1.402.838	0,49
200.000	EBN Finance Co BV 'REGS' 7.125% 16-Feb-2026	182.260	0,07
2.000.000	IHS Holding Ltd 'REGS' 6.250% 29-Nov-2028	1.634.370	0,58
600.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	537.480	0,19
	Panama - 3.419.478		
	(31. Dezember 2022: 3.918.135)	3.419.478	1,20
400.000	Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027	363.445	0,13
2.900.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	2.694.743	0,95
361.000	Multibank Inc 'REGS' 7.750% 03-Feb-2028	361.290	0,12
	Peru - 6.682.783		
	(31. Dezember 2022: 10.789.588)	6.682.783	2,35
700.000	Banco BBVA Peru SA 'REGS' FRN 5.250% 22-Sep-2029	692.365	0,24
1.500.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN 3.125% 01-Jul-2030	1.428.270	0,50
2.250.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' FRN 4.000% 08-Jul-2030	2.157.019	0,76
870.000	Camposol SA 'REGS' 6.000% 03-Feb-2027	603.807	0,21
1.070.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	1.008.040	0,36
400.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.875% 24-May-2026	393.486	0,14
400.000	Nexa Resources SA 'REGS' 6.500% 18-Jan-2028	399.796	0,14
	Philippinen - 5.698.800		
	(31. Dezember 2022: 3.373.135)	5.698.800	2,01
1.500.000	Philippine Government International Bond 1.200% 28-Apr-2033	1.334.258	0,47
1.000.000	Philippine Government International Bond 3.200% 06-Jul-2046	777.500	0,28
4.300.000	PLDT Inc 2.500% 23-Jan-2031	3.587.042	1,26
	Polen - 6.364.676		
	(31. Dezember 2022: 1.171.806)	6.364.676	2,24
1.700.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027	1.726.334	0,61
1.500.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	1.753.351	0,62
2.500.000	ORLEN SA 'EMTN' 4.750% 13-Jul-2030	2.884.991	1,01
	Katar - 1.800.535		
	(31. Dezember 2022: 4.157.922)	1.800.535	0,63
1.000.000	Ooredoo International Finance Ltd 'REGS' 2.625% 08-Apr-2031	876.082	0,31
1.000.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.375% 26-Jan-2026	924.453	0,32
	Republik Korea - 10.333.163		
	(31. Dezember 2022: 13.262.073)	10.333.163	3,64
1.200.000	Hana Bank 'REGS' FRN (Perpetual) 3.500% 19-Oct-2026	1.090.349	0,38
2.500.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Perpetual) 4.350% 02-Jul-2024	2.456.548	0,87
2.350.000	LG Chem Ltd 'REGS' 4.375% 14-Jul-2025	2.315.930	0,82
750.000	LG Energy Solution Ltd 'REGS' 5.750% 25-Sep-2028	773.607	0,27
1.000.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.500% 12-Apr-2028	992.580	0,35

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Republik Korea Forts.		
1.800.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 2.875% 12-May-2026	1.644.750	0,58
1.000.000	SK Hynix Inc 'REGS' 6.500% 17-Jan-2033	1.059.399	0,37
	Rumänien - 837.248		
	(31. Dezember 2022: -)	837.248	0,29
800.000	NE Property BV 3.375% 14-Jul-2027	837.248	0,29
	Saudi-Arabien - 5.785.002		
	(31. Dezember 2022: 7.560.555)	5.785.002	2,04
1.000.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 3.545% 31-Aug-2036	873.125	0,31
1.700.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	1.364.888	0,48
800.000	Gac First Investment Co 4.875% 14-Feb-2035	783.749	0,28
2.108.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 2.250% 24-Nov-2030	1.815.230	0,64
1.000.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029	948.010	0,33
	Senegal - 1.434.334		
	(31. Dezember 2022: -)	1.434.334	0,51
1.600.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.250% 23-May-2033	1.434.334	0,51
	Serbien - 634.267		
	(31. Dezember 2022: -)	634.267	0,22
600.000	United Group BV 'REGS' 5.250% 01-Feb-2030	634.267	0,22
	Singapur - 4.867.952		
	(31. Dezember 2022: 8.453.748)	4.867.952	1,71
700.000	BOC Aviation Ltd 'REGS' 3.000% 11-Sep-2029	630.038	0,22
2.000.000	BOC Aviation USA Corp 'REGS' 4.875% 03-May-2033	1.961.870	0,69
2.500.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 2.000% 14-Oct-2031	2.276.044	0,80
	Südafrika - 9.189.961		
	(31. Dezember 2022: -)	9.189.961	3,24
1.000.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 4.750% 21-Sep-2032	1.169.476	0,41
500.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 5.000% 15-Mar-2031	590.005	0,21
1.000.000	Anglo American Capital Plc 'REGS' 4.750% 16-Mar-2052	862.913	0,30
1.000.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	901.668	0,32
1.256.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.750% 01-Oct-2030	1.093.430	0,39
2.500.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS' 5.500% 04-Sep-2026	1.487.157	0,52
500.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	422.376	0,15
600.000	Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028	572.899	0,20
2.047.000	Sasol Financing USA LLC 'REGS' 8.750% 03-May-2029	2.090.037	0,74
	Taiwan - 3.384.555		
	(31. Dezember 2022: 983.260)	3.384.555	1,19
1.000.000	TSMC Arizona Corp 2.500% 25-Oct-2031	863.328	0,30
1.000.000	TSMC Global Ltd 'REGS' 1.375% 28-Sep-2030	813.898	0,29
2.000.000	TSMC Global Ltd 'REGS' 2.250% 23-Apr-2031	1.707.329	0,60
	Thailand - 13.881.947		
	(31. Dezember 2022: 13.224.046)	13.881.947	4,89
2.700.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.466% 23-Sep-2036	2.273.473	0,80
1.900.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN (Perpetual) 5.000% 23-Sep-2025	1.820.944	0,64
3.950.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.980% 18-Mar-2031	3.342.865	1,18
1.556.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	1.422.161	0,50
2.000.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN 3.343% 02-Oct-2031	1.840.719	0,65
1.000.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.000% 10-Feb-2027	891.268	0,31

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Thailand Forts.		
600.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.275% 14-Oct-2025	574.384	0,20
1.000.000	Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands FRN (Perpetual) 4.400% 25-Mar-2026	930.100	0,33
500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.750% 18-Jun-2050	352.227	0,13
500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.875% 23-Jan-2043	433.806	0,15
	Türkei - 11.220.969		
	(31. Dezember 2022: 8.209.005)	11.220.969	3,95
1.100.000	Akbank TAS 'REGS' FRN 6.800% 22-Jun-2031	1.093.903	0,39
2.400.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	2.195.040	0,77
450.000	Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 10.500% 06-Dec-2028	477.562	0,17
996.096	Limak Iskenderun Uluslararası Liman Isletmeciligi AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036	907.675	0,32
1.300.000	Türkiye Garanti Bankasi AS 'REGS' FRN 7,177% 24-May-2027	1.290.237	0,45
300.000	Türkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS 'REGS' 5.875% 14-Jan-2026	295.534	0,10
600.000	Türkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS 'REGS' 9.375% 19-Oct-2028	646.716	0,23
1.000.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS 'REGS' 6.950% 14-Mar-2026	997.864	0,35
892.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS' 9.000% 12-Oct-2028	936.734	0,33
800.000	Ulker Bisküvi Sanayi AS 'REGS' 6.950% 30-Oct-2025	787.736	0,28
1.500.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' 9.250% 16-Oct-2028	1.591.968	0,56
	Ukraine - 473.450		
	(31. Dezember 2022: 876.317)	473.450	0,17
1.700.000	NPC Ukrenergo 'REGS' 6.875% 09-Nov-2028	473.450	0,17
	Vereinigte Arabische Emirate - 14.471.599		
	(31. Dezember 2022: 16.772.343)	14.471.599	5,10
800.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC FRN (Perpetual) 8.000% 27-Nov-2028	851.000	0,30
1.000.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	923.230	0,32
2.000.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual) 4.250% 27-Feb-2027	1.805.000	0,64
700.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual) 6.125% 20-Mar-2025	696.927	0,25
1.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN' 0.125% 16-Feb-2026	1.023.436	0,36
3.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC FRN 6.320% 04-Apr-2034	3.096.081	1,09
1.698.880	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.160% 31-Mar-2034	1.478.917	0,52
3.057.834	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040	2.526.892	0,89
300.000	Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	311.625	0,11
1.657.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	1.758.491	0,62
	Vereinigtes Königreich - 4.935.911		
	(31. Dezember 2022: 1.655.987)	4.935.911	1,74
3.000.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	3.012.191	1,06
2.000.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 3.516% 12-Feb-2030	1.923.720	0,68
	Vereinigte Staaten von Amerika - 8.890.470		
	(31. Dezember 2022: -)	8.890.470	3,13
3.250.000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15-Feb-2053	3.030.181	1,07
6.100.000	United States Treasury Note/Bond 3.875% 15-May-2043	5.860.289	2,06
	Sambia - 2.428.586		
	(31. Dezember 2022: -)	2.428.586	0,86
400.000	First Quantum Minerals Ltd '144A' 6.875% 01-Mar-2026	359.800	0,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Sambia Forts.		
400.000	First Quantum Minerals Ltd '144A' 6.875% 15-Oct-2027	341.794	0,12
1.000.000	First Quantum Minerals Ltd '144A' 8.625% 01-Jun-2031	850.000	0,30
500.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 01-Mar-2026	449.750	0,16
500.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 15-Oct-2027	427.242	0,15
Gesamtanlagen in Anleihen		266.126.177	93,73

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.465.182 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 1.845.949) 3.465.182 1,22

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **274.276.359** **96,60**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (341.085)				
(31. Dezember 2022: -5.591)				
(49)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(6.475.825)	(95.300)	(0,03)
(54)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(8.218.691)	(245.785)	(0,09)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(341.085)	(0,12)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (867.508) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.970.512)) (867.508) (0,31)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **(1.208.593)** **(0,43)**

Nettoumlaufvermögen	10.862.099	3,83
Summe Nettovermögen	283.929.865	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,81
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,21
Sonstiges Umlaufvermögen	3,98
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (S)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
Euro	US-Dollar	1.674.000	1.807.452	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	47.640
Euro	US-Dollar	384.000	416.096	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	9.445
USD						57.085
US-Dollar	Euro	32.132.937	29.740.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(824.311)
USD						(824.311)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	995	1.189	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	2.663	3.124	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	60
Schweizer Franken	US-Dollar	12.259	14.396	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	276
Schweizer Franken	US-Dollar	272	320	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Schweizer Franken	US-Dollar	138.379	161.623	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.997
Schweizer Franken	US-Dollar	252	291	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Schweizer Franken	US-Dollar	316.770	365.567	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13.561
Schweizer Franken	US-Dollar	6.544	7.501	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	331
Schweizer Franken	US-Dollar	896	1.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	51
Schweizer Franken	US-Dollar	21.391.997	24.399.810	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.203.323
US-Dollar	Schweizer Franken	1.190	995	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						1.221.615
CHF						1.021.820
US-Dollar	Schweizer Franken	14.381	12.259	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(276)
US-Dollar	Schweizer Franken	3.127	2.663	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(60)
US-Dollar	Schweizer Franken	7.333	6.247	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(144)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.895	1.625	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(50)
US-Dollar	Schweizer Franken	5.834	5.040	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(198)
US-Dollar	Schweizer Franken	6.421	5.554	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(227)
US-Dollar	Schweizer Franken	54.878	47.517	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.992)
US-Dollar	Schweizer Franken	23.970	21.025	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.194)
USD						(4.141)
CHF						(3.464)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	47.562	55.551	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.374
Schweizer Franken	US-Dollar	108.764	125.519	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.656
Schweizer Franken	US-Dollar	7.329.258	8.359.786	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	412.279
USD						418.309
CHF						349.895
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
US-Dollar	Euro	5.548	4.990	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21
Euro	US-Dollar	3.988	4.412	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	27.008	29.706	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	224
Euro	US-Dollar	40.683	44.421	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	663
Euro	US-Dollar	21.002	23.120	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	154

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	6.848	7.393	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	195
Euro	US-Dollar	4.082.443	4.394.078	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	130.000
USD						131.264
EUR						118.501
US-Dollar	Euro	4.411	3.988	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
Euro	US-Dollar	4.990	5.550	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(20)
US-Dollar	Euro	49.742	45.532	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(716)
USD						(742)
EUR						(670)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	2.374	2.620	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	44.052	48.453	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	365
Euro	US-Dollar	64.887	70.848	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.058
Euro	US-Dollar	33.840	37.253	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	248
Euro	US-Dollar	6.548.580	7.048.469	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	208.531
US-Dollar	Euro	14.223	12.788	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
USD						210.265
EUR						189.821
Euro	US-Dollar	12.788	14.218	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(53)
US-Dollar	Euro	16.595	15.037	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(69)
US-Dollar	Euro	7.543	6.864	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Euro	12.692	11.595	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(158)
US-Dollar	Euro	28.730	26.643	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(796)
USD						(1.140)
EUR						(1.029)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	29.055	32.139	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Euro	US-Dollar	15.573	17.232	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	26
Euro	US-Dollar	55.434	61.177	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	254
Euro	US-Dollar	8.802	9.672	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	82
Euro	US-Dollar	289.366	318.273	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.397
Euro	US-Dollar	10.124	11.082	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	137
Euro	US-Dollar	13.615	14.907	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	181
Euro	US-Dollar	40.334	44.063	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	634
Euro	US-Dollar	425.089	464.146	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.929
Euro	US-Dollar	221.937	244.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.624
Euro	US-Dollar	12.385	13.372	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	353
Euro	US-Dollar	18.683	20.198	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	506
Euro	US-Dollar	43.696.764	47.032.378	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.391.466
Euro	US-Dollar	17.343	18.701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	518

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen			
Angola - 176.444			
(31. Dezember 2022: 173.680)			
200.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.750% 14-Apr-2032	176.444	0,75
Argentinien - 704.415			
(31. Dezember 2022: 492.656)			
1.397.578	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	480.292	2,03
548.171	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.625% 09-Jul-2035	189.429	0,80
100.399	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.625% 09-Jul-2035	34.694	0,15
Australien - 180.334			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	180.334	0,76
Brasilien - 768.720			
(31. Dezember 2022: 520.626)			
200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 8.500% 12-Jan-2031	186.250	0,79
250.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	220.100	0,93
200.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	153.750	0,65
200.000	CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	208.620	0,88
Burkina Faso - 185.376			
(31. Dezember 2022: 172.260)			
200.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	185.376	0,78
Chile - 650.984			
(31. Dezember 2022: 512.310)			
300.000	Chile Government International Bond 0.830% 02-Jul-2031	275.210	1,16
200.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	172.500	0,73
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 5.950% 08-Jan-2034	203.274	0,86
China - 172.861			
(31. Dezember 2022: 1.107.578)			
200.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	172.861	0,73
Kolumbien - 444.884			
(31. Dezember 2022: 663.046)			
200.000	Colombia Government International Bond 8.750% 14-Nov-2053	230.451	0,97
201.000	Ecopetrol SA 8.625% 19-Jan-2029	214.433	0,91
Elfenbeinküste - 88.268			
(31. Dezember 2022: -)			
100.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048	88.268	0,37
Ecuador - 418.714			
(31. Dezember 2022: 445.993)			
64.164	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	18.462	0,08
696.759	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2040	222.963	0,94
297.456	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 3.500% 31-Jul-2035	107.184	0,45
150.019	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 6.000% 31-Jul-2030	70.105	0,30
Ägypten - 455.088			
(31. Dezember 2022: 186.270)			
775.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	455.088	1,93

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Gabun - 167.288			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Gabon Government International Bond 'REGS' 7.000% 24-Nov-2031	167.288	0,71
Ghana - 175.783			
(31. Dezember 2022: 242.422)			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	87.710	0,37
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	88.073	0,37
Guatemala - 378.638			
(31. Dezember 2022: 341.587)			
213.000	Guatemala Government Bond 'REGS' 4.500% 03-May-2026	207.300	0,88
206.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	171.338	0,72
Hongkong - 136.451			
(31. Dezember 2022: 131.287)			
150.000	Prudential Funding Asia Plc 3.125% 14-Apr-2030	136.451	0,58
Ungarn - 350.231			
(31. Dezember 2022: -)			
198.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	233.431	0,99
100.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6.000% 16-May-2029	116.800	0,49
Indien - 315.653			
(31. Dezember 2022: 299.813)			
345.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	315.653	1,34
Indonesien - 1.324.512			
(31. Dezember 2022: 1.306.850)			
550.000	Indonesia Government International Bond 3.850% 15-Oct-2030	525.224	2,22
400.000	Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	406.845	1,72
225.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030	203.344	0,86
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.875% 17-Jul-2029	189.099	0,80
Israel - 580.763			
(31. Dezember 2022: 369.942)			
225.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	195.590	0,83
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	169.345	0,72
200.000	Israel Government International Bond 'EMTN' 6.500% 06-Nov-2031	215.828	0,91
Kuwait - 638.300			
(31. Dezember 2022: 625.733)			
200.000	MEGlobal BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	180.325	0,76
260.000	MEGlobal BV 'REGS' 4.250% 03-Nov-2026	251.793	1,07
200.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.875% 18-May-2030	206.182	0,87
Libanon - 21.796			
(31. Dezember 2022: -)			
350.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034	21.796	0,09
Mexiko - 1.843.242			
(31. Dezember 2022: 2.649.882)			
255.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	206.987	0,87
225.000	Mexico Government International Bond 3.771% 24-May-2061	153.030	0,65
200.000	Mexico Government International Bond 5.400% 09-Feb-2028	205.204	0,87
437.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	349.489	1,48

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Mexiko Forts.		
500.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	441.639	1,87
10.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	7.123	0,03
325.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	231.507	0,98
247.000	Petroleos Mexicanos 10.000% 07-Feb-2033	248.263	1,05
	Marokko - 190.426		
	(31. Dezember 2022: 189.833)	190.426	0,81
200.000	OCF SA 'REGS' 6.875% 25-Apr-2044	190.426	0,81
	Niederlande - 149.000		
	(31. Dezember 2022: 143.000)	149.000	0,63
200.000	VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027	149.000	0,63
	Nigeria - 578.796		
	(31. Dezember 2022: 669.037)	578.796	2,45
275.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.143% 23-Feb-2030	248.479	1,05
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.375% 28-Sep-2033	171.120	0,73
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.625% 28-Nov-2047	159.197	0,67
	Panama - 638.056		
	(31. Dezember 2022: 684.872)	638.056	2,70
250.000	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	182.900	0,77
200.000	Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060	120.285	0,51
200.000	Panama Government International Bond 4.500% 01-Apr-2056	134.818	0,57
200.000	Panama Government International Bond 6.875% 31-Jan-2036	200.053	0,85
	Peru - 485.617		
	(31. Dezember 2022: 493.744)	485.617	2,05
200.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.875% 24-May-2026	198.174	0,84
400.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	287.443	1,21
	Philippinen - 193.194		
	(31. Dezember 2022: -)	193.194	0,82
200.000	Philippine Government International Bond 3.750% 14-Jan-2029	193.194	0,82
	Polen - 116.605		
	(31. Dezember 2022: -)	116.605	0,49
100.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	116.605	0,49
	Katar - 276.918		
	(31. Dezember 2022: 953.356)	276.918	1,17
300.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	276.918	1,17
	Rumänien - 581.035		
	(31. Dezember 2022: 589.966)	581.035	2,46
200.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 5.000% 27-Sep-2026	226.737	0,96
300.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	354.298	1,50
	Russland - 74.773		
	(31. Dezember 2022: 82.930)	74.773	0,32
200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 5.100% 28-Mar-2035	74.773	0,32
	Saudi-Arabien - 1.339.359		
	(31. Dezember 2022: 550.150)	1.339.359	5,67
200.000	Gaci First Investment Co 4.750% 14-Feb-2030	200.250	0,85
200.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 0.625% 03-Mar-2030	188.289	0,80
200.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 2.000% 09-Jul-2039	170.835	0,72
600.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.000% 18-Jan-2053	566.541	2,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Saudi-Arabien Forts.		
200.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	213.444	0,90
	Senegal - 315.620		
	(31. Dezember 2022: 283.898)	315.620	1,34
400.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.750% 13-Mar-2048	315.620	1,34
	Singapur - 184.660		
	(31. Dezember 2022: -)	184.660	0,78
200.000	United Overseas Bank Ltd 'GMTN' FRN 1.750% 16-Mar-2031	184.660	0,78
	Slowenien - 203.905		
	(31. Dezember 2022: -)	203.905	0,86
200.000	Slovenia Government International Bond 'REGS' 5.000% 19-Sep-2033	203.905	0,86
	Südafrika - 204.264		
	(31. Dezember 2022: 678.046)	204.264	0,86
200.000	Sasol Financing USA LLC 'REGS' 8.750% 03-May-2029	204.264	0,86
	Supranational - 707.790		
	(31. Dezember 2022: 708.791)	707.790	3,00
200.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026	184.960	0,79
560.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	522.830	2,21
	Thailand - 182.127		
	(31. Dezember 2022: -)	182.127	0,77
200.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	182.127	0,77
	Türkei - 2.044.616		
	(31. Dezember 2022: 767.532)	2.044.616	8,65
200.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	182.848	0,77
400.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 8.509% 14-Jan-2029	424.800	1,80
200.000	Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 10.500% 06-Dec-2028	212.750	0,90
400.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	396.600	1,68
200.000	Türkiye Government International Bond 5.750% 11-May-2047	157.327	0,66
400.000	Türkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	443.881	1,88
200.000	Türkiye Government International Bond 9.375% 19-Jan-2033	226.410	0,96
	Ukraine - 313.770		
	(31. Dezember 2022: 373.551)	313.770	1,33
808.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.253% 15-Mar-2035	196.482	0,83
260.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 7.750% 01-Aug-2041	117.288	0,50
	Vereinigte Arabische Emirate - 1.757.533		
	(31. Dezember 2022: 1.742.318)	1.757.533	7,44
400.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 'REGS' 4.600% 02-Nov-2047	368.310	1,56
200.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	184.230	0,78
200.000	DP World Crescent Ltd 'REGS' 3.750% 30-Jan-2030	188.525	0,80
400.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	399.828	1,69
400.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	437.316	1,85
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3.234% 23-Oct-2029	179.324	0,76

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.210.611 (31. Dezember 2022: –)		2.210.611	9,35	
475.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	465.901	1,97	
650.000	United States Treasury Note/Bond 3.125% 15-Aug-2025	637.228	2,69	
586.700	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	564.332	2,39	
385.000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15-Feb-2053	357.306	1,51	
200.000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15-May-2053	185.844	0,79	
Gesamtanlagen in Anleihen		22.927.420	97,00	
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD		
Offene Terminkontrakte - 231.801 (31. Dezember 2022: 53.410)				
2	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	236.031	4.122	0,02
3	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	326.321	7.327	0,03
19	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.538.281	220.352	0,93
Offene Terminkontrakte insgesamt		231.801	0,98	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 11.746 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 5.256)		11.746	0,05	
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		23.170.967	98,03	
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD		
Offene Terminkontrakte - (40.407) (31. Dezember 2022: (10.234))				
(1)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(151.484)	(4.338)	(0,02)
(3)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(469.356)	(36.069)	(0,15)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(40.407)	(0,17)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (38.471) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (12.781))		(38.471)	(0,16)	
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(78.878)	(0,33)	
Nettoumlaufvermögen		543.216	2,30	
Summe Nettovermögen		23.635.305	100,00	
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan Securities Plc.				
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens		
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,15		
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,97		
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,05		
Sonstiges Umlaufvermögen		2,83		
Gesamtvermögen		100,00		

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund							
Euro	US-Dollar	22.000	24.036	19. Jan. 24	HSBC Bank plc		269
USD							269
US-Dollar	Euro	22.986	21.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc		(214)
US-Dollar	Euro	1.791.314	1.656.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc		(38.167)
US-Dollar	Euro	10.960	10.000	23. Jan. 24	Morgan Stanley		(90)
USD							(38.471)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	2.632	2.895	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		11
Euro	US-Dollar	9.570	10.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		105
Euro	US-Dollar	397.386	427.522	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		11.361
USD							11.477
EUR							10.396

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Brasilien - 2.952.166			
(31. Dezember 2022: 3.476.479)			
3.510.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	723.259	2,53
9.292.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	1.920.723	6,73
1.500.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	308.184	1,08
Chile - 838.898			
(31. Dezember 2022: 421.059)			
360.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	401.877	1,41
230.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	251.770	0,88
155.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 6.000% 01-Apr-2033	185.251	0,65
China - 1.421.391			
(31. Dezember 2022: 2.946.828)			
3.390.000	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	489.663	1,72
4.820.000	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	710.800	2,49
1.340.000	China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	220.928	0,77
Kolumbien - 2.816.784			
(31. Dezember 2022: 2.189.762)			
1.177.800.000	Colombian TES 7.000% 30-Jun-2032	254.884	0,89
1.132.600.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	213.042	0,74
2.530.300.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	475.948	1,67
3.109.100.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	731.758	2,56
2.457.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	610.706	2,14
2.365.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	530.446	1,86
Tschechische Republik - 1.331.042			
(31. Dezember 2022: 631.165)			
2.500.000	Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030	94.617	0,33
9.880.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	318.082	1,11
7.390.000	Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029	314.138	1,10
6.770.000	Czech Republic Government Bond 4.500% 11-Nov-2032	319.901	1,12
5.860.000	Czech Republic Government Bond 5.500% 12-Dec-2028	284.304	1,00
Dominikanische Republik - 149.016			
(31. Dezember 2022: -)			
8.000.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 11.250% 15-Sep-2035	149.016	0,52
Ungarn - 969.530			
(31. Dezember 2022: 788.122)			
90.760.000	Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033	198.924	0,70
109.410.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2027	287.522	1,01
167.950.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	415.972	1,45
24.420.000	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	67.112	0,23
Indonesien - 2.770.556			
(31. Dezember 2022: 2.709.588)			
13.591.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	871.971	3,05
2.874.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	184.776	0,65
6.331.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	418.223	1,46
729.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Jun-2035	50.492	0,18
3.517.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Apr-2040	244.210	0,86
3.596.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-Jun-2032	256.751	0,90
3.939.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Mar-2034	286.132	1,00
6.300.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	458.001	1,60
Malaysia - 1.592.646			
(31. Dezember 2022: 1.573.235)			
1.176.000	Malaysia Government Bond 3.502% 31-May-2027	255.240	0,89

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Malaysia Forts.			
1.832.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	396.265	1,39
576.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	126.387	0,44
215.000	Malaysia Government Bond 3.899% 16-Nov-2027	47.266	0,17
3.189.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	767.488	2,69
Mexiko - 3.766.654			
(31. Dezember 2022: 2.221.170)			
2.500.000	Mexican Bonos 7.500% 26-May-2033	133.449	0,47
15.600.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	857.417	3,00
11.382.800	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	590.155	2,07
25.000.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	1.441.582	5,05
13.235.500	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	744.051	2,60
Peru - 627.087			
(31. Dezember 2022: 546.156)			
1.860.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	454.755	1,59
637.000	Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	172.332	0,60
Polen - 1.223.354			
(31. Dezember 2022: -)			
1.162.000	Republic of Poland Government Bond 1.750% 25-Apr-2032	229.830	0,80
3.550.000	Republic of Poland Government Bond 7.500% 25-Jul-2028	993.524	3,48
Republik Korea - 356.867			
(31. Dezember 2022: 365.336)			
453.680.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	356.867	1,25
Rumänien - 871.617			
(31. Dezember 2022: 132.972)			
1.095.000	Romania Government Bond 5.000% 12-Feb-2029	230.322	0,80
1.390.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	304.605	1,07
1.390.000	Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	336.690	1,18
Russland - 259.445			
(31. Dezember 2022: 233.654)			
53.850.000	Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027	259.445	0,91
Südafrika - 3.056.511			
(31. Dezember 2022: 3.887.566)			
25.844.794	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	1.183.343	4,14
30.054.363	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	1.514.548	5,30
5.750.000	Republic of South Africa Government Bond 8.250% 31-Mar-2032	275.343	0,97
2.064.997	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	83.277	0,29
Thailand - 1.868.896			
(31. Dezember 2022: 1.334.287)			
12.516.000	Thailand Government Bond 1.585% 17-Dec-2035	324.842	1,14
22.643.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	608.661	2,13
24.479.000	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	758.030	2,65
5.663.000	Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	177.363	0,62
Türkei - 763.472			
(31. Dezember 2022: -)			
11.000.000	Türkiye Government Bond 12.600% 01-Oct-2025	266.173	0,93
2.424.015	Türkiye Government Bond 26.200% 05-Oct-2033	85.547	0,30
10.961.000	Türkiye Government Bond 31.080% 08-Nov-2028	411.752	1,44

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Uruguay - 36.968		
	(31. Dezember 2022: 33.835)	36.968	0,13
1.557.347	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	36.968	0,13
Gesamtanlagen in Anleihen		27.672.900	96,88
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 555.293 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 142.171)		555.293	1,94
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		28.228.193	98,82
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (329.474) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (95.817))		(329.474)	(1,15)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(329.474)	(1,15)
Nettoumlaufvermögen		664.782	2,33
Summe Nettovermögen		28.563.501	100,00
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,22	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,91	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,87	
Gesamtvermögen		100,00	

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Euro	US-Dollar	50.000	52.869	23.Jan. 24	HSBC Bank plc	2.379
Euro	US-Dollar	260.000	281.721	23.Jan. 24	Morgan Stanley	5.566
Euro	US-Dollar	250.000	273.997	23.Jan. 24	Morgan Stanley	2.240
Brasilianischer Real	US-Dollar	190.000	38.003	2.Feb. 24	Goldman Sachs International	1.038
Chilenischer Peso	US-Dollar	14.570.000	15.641	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	824
Chilenischer Peso	US-Dollar	691.094.000	755.294	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	25.674
Chilenischer Peso	US-Dollar	241.460.000	271.180	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.681
Chinesischer Yuan	US-Dollar	6.318.000	869.138	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	22.372
Chinesischer Yuan	US-Dollar	140.000	19.722	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	33
Chinesischer Yuan	US-Dollar	140.000	19.647	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	107
Chinesischer Yuan	US-Dollar	260.000	36.400	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	287
Chinesischer Yuan	US-Dollar	4.177.000	588.542	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	859
Chinesischer Yuan	US-Dollar	1.623.000	228.759	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	257
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	1.289.760.000	308.555	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	19.057
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	389.300.000	95.308	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	3.578
Tschechische Krone	US-Dollar	350.000	15.170	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	448
Tschechische Krone	US-Dollar	440.000	19.631	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	3
Tschechische Krone	US-Dollar	12.312.000	525.201	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	24.199
Tschechische Krone	US-Dollar	430.000	18.868	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	320
Ungarischer Forint	US-Dollar	87.512.000	248.920	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	1.147
Indische Rupie	US-Dollar	23.200.000	277.068	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	714
Indonesische Rupiah	US-Dollar	448.250.000	28.694	20. Mrz. 24	Merrill Lynch International	417
Indonesische Rupiah	US-Dollar	4.335.700.000	278.791	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	2.783
Indonesische Rupiah	US-Dollar	576.704.267	36.264	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	1.189
Indonesische Rupiah	US-Dollar	1.819.560.000	113.868	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	4.299
Koreanischer Won	US-Dollar	626.838.000	479.479	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	6.782
Koreanischer Won	US-Dollar	108.965.000	84.287	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	241
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	190.000	41.090	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	586
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	140.000	29.712	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	997
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	8.083.418	1.714.586	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	58.483
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	10.000	2.158	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	36
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	70.000	15.021	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	333
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	190.000	40.697	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	979
Mexikanischer Peso	US-Dollar	1.520.000	82.821	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	5.553
Mexikanischer Peso	US-Dollar	570.000	32.443	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	697
Mexikanischer Peso	US-Dollar	9.960.000	565.457	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	13.623
Peruanischer neuer Sol	US-Dollar	326.156	84.562	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	3.388
Philippinischer Peso	US-Dollar	1.230.000	21.645	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	571
Polnischer Zloty	US-Dollar	5.788.000	1.364.002	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	105.422
Polnischer Zloty	US-Dollar	190.000	47.374	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	862
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.892.000	401.118	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	18.283
Rumänischer Leu	US-Dollar	140.000	30.725	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	309
Rumänischer Leu	US-Dollar	470.000	103.140	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	1.045
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	70.000	3.721	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	80
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	5.250.000	279.436	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	5.604
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	5.298.000	286.926	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	719
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	6.646.000	352.834	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	8.000

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)	Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.							BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.						
Südafrikani- scher Rand	US-Dollar	5.101.000	267.982	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	8.968	US-Dollar	Rumänischer Leu	270.026	1.230.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(2.629)
Taiwan-Dollar	US-Dollar	27.860.000	870.924	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	45.438	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	99.757	1.880.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(2.314)
Thailändi- scher Baht	US-Dollar	1.190.000	33.495	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.607	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	23.745	450.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(687)
Thailändi- scher Baht	US-Dollar	43.381.800	1.213.514	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	66.130	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.740.264	32.693.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(34.746)
Türkische Lira	US-Dollar	5.080.000	158.636	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.561	US-Dollar	Thailändischer Baht	34.587	1.240.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.990)
Türkische Lira	US-Dollar	460.000	14.370	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	136	US-Dollar	Thailändischer Baht	101.302	3.520.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.529)
US-Dollar	Chilenischer Peso	288.868	252.560.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	3.463	US-Dollar	Thailändischer Baht	188.151	6.682.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(8.950)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	168.582	1.200.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	255	US-Dollar	Thailändischer Baht	37.282	1.330.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.949)
US-Dollar	Koreanischer Won	28.510	36.570.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	141	US-Dollar	Türkische Lira	72.515	2.327.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(867)
US-Dollar	Taiwan-Dollar	943.701	27.859.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	27.371	US-Dollar	Türkische Lira	12.125	390.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(173)
US-Dollar	Türkische Lira	136.279	4.308.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	426	US-Dollar	Hongkong-Dollar	612.986	4.768.096	26. Aug. 24	Goldman Sachs	(617)
US-Dollar	Türkische Lira	242.942	7.663.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	1.290	US-Dollar	Taiwan-Dollar	291.457	8.780.000	4. Dez. 24	HSBC Bank plc	(4.476)
US-Dollar	Türkische Lira	255.721	8.069.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	1.266							
US-Dollar	Taiwan-Dollar	302.270	8.920.000	4. Dez. 24	Barclays Bank PLC	1.619							
					USD	513.735						USD	(329.166)
US-Dollar	Euro	18.342	17.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(442)	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
US-Dollar	Euro	23.351	22.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(958)	Euro	US-Dollar	1.885	2.077	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Brasilianischer Real	271.870	1.341.978	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(3.874)	Euro	US-Dollar	7.951	8.728	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	54
Chinesischer Yuan	US-Dollar	500.000	70.684	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(130)	Euro	US-Dollar	1.102	1.201	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15
Indische Rupie	US-Dollar	24.230.000	290.226	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(112)	Euro	US-Dollar	25.550	27.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	281
Türkische Lira	US-Dollar	2.170.000	68.771	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(341)	Euro	US-Dollar	14.000	15.090	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	372
US-Dollar	Chilenischer Peso	291.162	260.590.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(3.317)	Euro	US-Dollar	1.194.217	1.284.782	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	34.143
US-Dollar	Chilenischer Peso	46.433	42.250.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(1.312)							
US-Dollar	Chilenischer Peso	170.609	151.801.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(933)						USD	34.870
US-Dollar	Chilenischer Peso	275.114	251.938.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(9.588)							
US-Dollar	Chinesischer Yuan	265.304	1.930.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(7.031)							
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	19.171	81.300.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.480)							
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	323.519	1.309.110.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(9.008)							
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.697.799	714.7735.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(117.797)	US-Dollar	Euro	2.076	1.885	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	147.886	589.680.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.898)	Euro	US-Dollar	13.831	15.363	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(88)
US-Dollar	Tschechische Krone	54.613	1.230.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(274)	US-Dollar	Euro	24.301	22.083	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(88)
US-Dollar	Tschechische Krone	97.610	2.290.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(4.577)	US-Dollar	Euro	8.652	7.933	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(109)
US-Dollar	Ungarischer Forint	23.208	8.180.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(167)							
US-Dollar	Ungarischer Forint	241.491	89.304.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(13.697)						USD	(290)
US-Dollar	Ungarischer Forint	41.538	15.410.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.496)							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	29.830	460.020.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(45)							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	262.855	4.138.600.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(5.918)							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	180.368	2.794.150.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.093)							
US-Dollar	Koreanischer Won	318.481	425.809.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(11.834)	Euro	US-Dollar	879	965	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	574.840	2.648.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(5.990)	Euro	US-Dollar	2.740	2.996	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	30
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	190.894	880.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(2.131)	Euro	US-Dollar	129.070	138.859	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.690
US-Dollar	Mexikanischer Peso	387.746	7.138.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(27.261)							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	504.744	8.754.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(4.218)						USD	3.726
US-Dollar	Mexikanischer Peso	113.117	1.980.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.002)							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	454.709	8.052.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(13.439)							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	27.790	490.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(699)	Euro	US-Dollar	1.528	1.697	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	24.422	440.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.159)						USD	(10)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	18.108	70.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(768)							
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	39.945	150.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(504)							
US-Dollar	Polnischer Zloty	67.281	270.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(1.265)							
US-Dollar	Polnischer Zloty	47.049	200.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(3.726)							
US-Dollar	Polnischer Zloty	467.666	1.864.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(5.556)							
US-Dollar	Rumänischer Leu	4.234	20.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(199)	Euro	US-Dollar	1.269	1.387	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

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.

Euro	US-Dollar	59.597	64.116	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.704
					USD	1.721
					EUR	1.559
Euro	US-Dollar	710	789	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
					USD	(5)
					EUR	(5)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	62	68	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	191	209	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	8.990	9.672	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	257
					USD	259
					EUR	235
Euro	US-Dollar	107	119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	354	449	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Pfund Sterling	US-Dollar	1.099	1.397	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	51.244	64.344	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	977
					USD	982
					GBP	770
Pfund Sterling	US-Dollar	629	803	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(2)
					GBP	(2)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Argentinien - 329.109			
(31. Dezember 2022: 329.952)			
742.273	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	255.089	1,12
214.200	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.625% 09-Jul-2035	74.020	0,32
Australien - 180.334			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	180.334	0,79
Brasilien - 1.598.666			
(31. Dezember 2022: 2.408.402)			
200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 8.500% 12-Jan-2031	186.250	0,81
3.294.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	678.751	2,97
1.825.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	371.295	1,62
200.000	Corupee Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	153.750	0,67
200.000	CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	208.620	0,91
Chile - 790.102			
(31. Dezember 2022: 198.833)			
140.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	156.285	0,68
235.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	257.243	1,12
145.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 6.000% 01-Apr-2033	173.300	0,76
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 5.950% 08-Jan-2034	203.274	0,89
China - 420.169			
(31. Dezember 2022: 757.296)			
1.500.000	China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	247.308	1,08
200.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	172.861	0,75
Kolumbien - 1.489.727			
(31. Dezember 2022: 1.598.841)			
346.100.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	81.458	0,36
2.933.300.000	Colombian TES 9.250% 28-May-2042	687.298	3,00
1.520.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	377.808	1,65
1.530.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	343.163	1,50
Tschechische Republik - 543.270			
(31. Dezember 2022: 175.441)			
5.010.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	161.294	0,70
2.950.000	Czech Republic Government Bond 4.500% 11-Nov-2032	139.396	0,61
5.000.000	Czech Republic Government Bond 5.500% 12-Dec-2028	242.580	1,06
Ecuador - 288.385			
(31. Dezember 2022: 323.024)			
34.728	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	9.992	0,04
505.174	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2040	161.656	0,71
212.556	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 3.500% 31-Jul-2035	76.592	0,33
85.907	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 6.000% 31-Jul-2030	40.145	0,18
Ägypten - 117.442			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	117.442	0,51

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Gabun - 167.288			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Gabon Government International Bond 'REGS' 7.000% 24-Nov-2031	167.288	0,73
Ghana - 88.073			
(31. Dezember 2022: 72.502)			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	88.073	0,38
Guatemala - 207.300			
(31. Dezember 2022: 172.418)			
213.000	Guatemala Government Bond 'REGS' 4.500% 03-May-2026	207.300	0,91
Ungarn - 592.508			
(31. Dezember 2022: 573.273)			
86.100.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	213.249	0,93
20.000.000	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	54.965	0,24
176.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	207.494	0,91
100.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6.000% 16-May-2029	116.800	0,51
Indonesien - 1.471.781			
(31. Dezember 2022: 1.804.754)			
5.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	363.328	1,59
3.623.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	263.387	1,15
3.614.000.000	Indonesia Treasury Bond 9.000% 15-Mar-2029	259.747	1,13
400.000	Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	406.845	1,78
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.000% 30-Jun-2030	178.474	0,78
Israel - 568.284			
(31. Dezember 2022: 566.587)			
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	169.345	0,74
200.000	Israel Government International Bond 'EMTN' 6.500% 06-Nov-2031	215.828	0,94
200.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	183.111	0,80
Kuwait - 180.325			
(31. Dezember 2022: 174.750)			
200.000	MEGlobal BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	180.325	0,79
Libanon - 12.455			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034	12.455	0,05
Macao - 360.097			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Sands China Ltd 4.625% 18-Jun-2030	182.213	0,79
200.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	177.884	0,78
Malaysia - 768.447			
(31. Dezember 2022: 764.827)			
895.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	193.590	0,85
1.094.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	240.048	1,05
415.000	Malaysia Government Bond 4.893% 08-Jun-2038	99.196	0,43
979.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	235.613	1,03
Mexiko - 2.812.482			
(31. Dezember 2022: 2.490.252)			
200.000	Alpek SAB de CV 'REGS' 3.250% 25-Feb-2031	171.545	0,75
8.053.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	442.614	1,93
6.050.000	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	313.669	1,37
17.900.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	1.032.173	4,51
3.003.600	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	168.851	0,74
200.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	165.672	0,72
65.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	57.413	0,25
151.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	133.375	0,58

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Mexiko Forts.		
250.000	Petroleos Mexicanos 6.700% 16-Feb-2032	207.779	0,91
90.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	64.110	0,28
55.000	Petroleos Mexicanos 10.000% 07-Feb-2033	55.281	0,24
	Marokko - 152.336		
	(31. Dezember 2022: 152.577)	152.336	0,67
200.000	OCF SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	152.336	0,67
	Nigeria - 329.416		
	(31. Dezember 2022: 451.404)	329.416	1,44
400.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	329.416	1,44
	Panama - 408.976		
	(31. Dezember 2022: 376.374)	408.976	1,79
300.000	Panama Government International Bond 4.500% 16-Apr-2050	208.923	0,91
200.000	Panama Government International Bond 6.875% 31-Jan-2036	200.053	0,88
	Peru - 479.529		
	(31. Dezember 2022: 591.640)	479.529	2,09
675.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	165.032	0,72
100.000	Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	27.054	0,12
400.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	287.443	1,25
	Polen - 396.471		
	(31. Dezember 2022: -)	396.471	1,73
100.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	116.605	0,51
1.000.000	Republic of Poland Government Bond 7.500% 25-Jul-2028	279.866	1,22
	Katar - 184.612		
	(31. Dezember 2022: 429.441)	184.612	0,81
200.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	184.612	0,81
	Republik Korea - 229.688		
	(31. Dezember 2022: 538.286)	229.688	1,00
292.000.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	229.688	1,00
	Rumänien - 402.934		
	(31. Dezember 2022: 476.455)	402.934	1,76
620.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	135.867	0,59
615.000	Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	148.967	0,65
100.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	118.100	0,52
	Russland - 188.894		
	(31. Dezember 2022: 182.875)	188.894	0,83
42.147.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	188.894	0,83
	Senegal - 354.007		
	(31. Dezember 2022: 327.600)	354.007	1,55
395.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.250% 23-May-2033	354.007	1,55
	Slowenien - 203.905		
	(31. Dezember 2022: -)	203.905	0,89
200.000	Slovenia Government International Bond 'REGS' 5.000% 19-Sep-2033	203.905	0,89
	Südafrika - 1.225.922		
	(31. Dezember 2022: 2.618.344)	1.225.922	5,35
16.700.000	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	764.635	3,34
4.687.576	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	236.224	1,03
4.700.000	Republic of South Africa Government Bond 8.250% 31-Mar-2032	225.063	0,98

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Supranational - 209.374		
	(31. Dezember 2022: 410.487)	209.374	0,91
245.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4.700% 22-Oct-2031	209.374	0,91
	Thailand - 1.050.999		
	(31. Dezember 2022: 850.026)	1.050.999	4,59
200.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	182.127	0,80
5.121.000	Thailand Government Bond 1.585% 17-Dec-2035	132.911	0,58
12.036.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	323.537	1,41
7.250.000	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	224.507	0,98
6.000.000	Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	187.917	0,82
	Türkei - 1.155.041		
	(31. Dezember 2022: 189.218)	1.155.041	5,04
200.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	182.848	0,80
250.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 8.509% 14-Jan-2029	265.500	1,16
200.000	Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 10.500% 06-Dec-2028	212.750	0,93
8.600.000	Türkiye Government Bond 12.600% 01-Oct-2025	208.098	0,91
1.969.501	Türkiye Government Bond 26.200% 05-Oct-2033	69.507	0,30
5.759.000	Türkiye Government Bond 31.080% 08-Nov-2028	216.338	0,94
	Ukraine - 227.050		
	(31. Dezember 2022: 182.695)	227.050	0,99
256.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.253% 15-Mar-2035	62.252	0,27
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2034	47.510	0,21
260.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 7.750% 01-Aug-2041	117.288	0,51
	Vereinigte Arabische Emirate - 637.230		
	(31. Dezember 2022: 797.623)	637.230	2,78
200.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	199.914	0,87
400.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	437.316	1,91
	Vereinigte Staaten von Amerika - 1.352.119		
	(31. Dezember 2022: -)	1.352.119	5,90
925.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	910.739	3,97
450.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	441.380	1,93
	Uruguay - 43.744		
	(31. Dezember 2022: 40.438)	43.744	0,19
600.000	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	14.243	0,06
1.195.000	Uruguay Government International Bond 'REGS' 8.500% 15-Mar-2028	29.501	0,13
Gesamtanlagen in Anleihen		22.218.491	97,02

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
	Offene Terminkontrakte - 96.294			
	(31. Dezember 2022: 48.405)			
2	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	236.031	1.247	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
	8 U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.068.750	95.047	0,41
Offene Terminkontrakte insgesamt			96.294	0,42
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 350.030 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 57.037)			350.030	1,53
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			22.664.815	98,97
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (12.012) (31. Dezember 2022: (2.363))				
	(1) Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(156.452)	(12.012)	(0,05)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(12.012)	(0,05)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (293.362) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (81.275))			(293.362)	(1,28)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(305.374)	(1,33)
Nettoumlaufvermögen			541.251	2,36
Summe Nettovermögen			22.900.692	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan Securities Plc.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,21
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,41
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,50
Sonstiges Umlaufvermögen	2,88
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- datum (V)	Kontrahent		
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
Euro	US-Dollar	465.000	507.413	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	6.388
Euro	US-Dollar	193.000	209.124	23. Jan. 24	Morgan Stanley	4.131
Euro	US-Dollar	190.000	208.238	23. Jan. 24	Morgan Stanley	1.703
Brasilianischer Real	US-Dollar	30.000	6.000	2. Feb. 24	Goldman Sachs International	164
Chilenischer Peso	US-Dollar	192.420.000	216.104	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.339
Chilenischer Peso	US-Dollar	494.110.000	540.011	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	18.356
Chinesischer Yuan	US-Dollar	7.030.000	967.084	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	24.893
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	455.050.000	108.864	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	6.724
Tschechische Krone	US-Dollar	2.512.000	110.711	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.382
Tschechische Krone	US-Dollar	2.814.000	120.039	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	5.531
Tschechische Krone	US-Dollar	367.000	16.104	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	273
Euro	US-Dollar	355.000	381.189	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	11.951
Ungarischer Forint	US-Dollar	48.890.000	141.907	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	654
Indische Rupie	US-Dollar	18.300.000	218.549	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	563
Indonesische Rupiah	US-Dollar	7.052.452.529	443.467	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	14.541
Indonesische Rupiah	US-Dollar	706.670.000	44.224	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	1.670
Koreanischer Won	US-Dollar	116.490.000	89.966	20. Mrz. 24	Merrill Lynch International	399
Koreanischer Won	US-Dollar	487.428.000	372.842	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	5.274
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	3.979.723	844.145	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	28.793
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	90.000	19.464	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	278
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	620.000	133.791	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	2.204
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	120.000	25.467	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	854
Mexikanischer Peso	US-Dollar	3.671.000	202.878	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	10.556
Mexikanischer Peso	US-Dollar	7.740.000	439.421	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	10.587
Mexikanischer Peso	US-Dollar	720.000	39.231	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	2.630
Peruanischer neuer Sol	US-Dollar	920.311	238.608	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	9.560
Philippinischer Peso	US-Dollar	535.000	9.415	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	248
Polnischer Zloty	US-Dollar	3.062.000	721.592	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	55.771
Rumänischer Leu	US-Dollar	190.000	41.695	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	422
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.790.000	379.493	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	17.298
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	6.935.000	364.332	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	12.192
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	4.670.000	247.928	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	5.621
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	2.843.000	153.970	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	386
Taiwan-Dollar	US-Dollar	22.880.000	715.246	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	37.316
Thailändischer Baht	US-Dollar	520.000	14.636	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	702
Thailändischer Baht	US-Dollar	12.830.324	358.901	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	19.558
Türkische Lira	US-Dollar	2.050.000	64.016	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	630
Türkische Lira	US-Dollar	190.000	5.936	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	56
US-Dollar	Chilenischer Peso	230.170	201.240.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	2.760
US-Dollar	Taiwan-Dollar	774.737	22.871.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	22.471
US-Dollar	Türkische Lira	71.746	2.268.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	224
US-Dollar	Türkische Lira	127.511	4.022.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	677
US-Dollar	Türkische Lira	199.912	6.308.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	990
US-Dollar	Taiwan-Dollar	244.663	7.220.000	4. Dez. 24	Barclays Bank PLC	1.310
USD						350.030
US-Dollar	Euro	1.096.455	1.033.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(44.958)
US-Dollar	Euro	210.394	195.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(5.071)
US-Dollar	Brasilianischer Real	12.340	60.911	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(176)
Chinesischer Yuan	US-Dollar	80.000	11.309	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(21)
Indische Rupie	US-Dollar	19.610.000	234.888	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(91)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.						
Türkische Lira	US-Dollar	560.000	177.47	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(88)
US-Dollar	Chilenischer Peso	41.534	38.690.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(2.188)
US-Dollar	Chilenischer Peso	229.274	205.200.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.612)
US-Dollar	Chilenischer Peso	161.290	143.510.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(882)
US-Dollar	Chilenischer Peso	222.974	204.191.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(7.771)
US-Dollar	Chilenischer Peso	30.519	27.770.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(862)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	65.982	480.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(1.749)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	88.529	640.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.779)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	118.082	470.840.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.516)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	932.935	3.927.656.145	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(64.729)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	15.286	62.440.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(574)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	253.149	1.024.360.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(7.049)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	38.889	164.920.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(3.002)
US-Dollar	Tschechische Krone	36.231	850.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(1.699)
US-Dollar	Tschechische Krone	21.526	490.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(340)
US-Dollar	Tschechische Krone	39.876	920.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.177)
US-Dollar	Euro	107.841	100.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.903)
US-Dollar	Ungarischer Forint	31.838	11.420.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(795)
US-Dollar	Ungarischer Forint	14.866	5.240.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(107)
US-Dollar	Ungarischer Forint	3.315	1.226.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(188)
US-Dollar	Ungarischer Forint	12.372	4.590.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(744)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	205.740	3.239.340.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(4.632)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	100.582	1.580.770.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(2.078)
US-Dollar	Koreanischer Won	21.941	28.860.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(447)
US-Dollar	Koreanischer Won	218.428	292.038.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(8.117)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	122.318	570.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(2.710)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	132.142	608.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(1.220)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	452.838	2.086.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(4.718)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	245.857	4.264.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(2.055)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	245.482	4.347.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(7.255)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	69.698	1.220.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.233)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	783.695	14.427.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(55.099)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	80.483	1.450.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(3.821)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	163.766	620.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(3.422)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	18.285	70.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(591)
US-Dollar	Polnischer Zloty	139.748	557.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.660)
US-Dollar	Polnischer Zloty	67.432	280.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(3.653)
US-Dollar	Polnischer Zloty	7.057	30.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(559)
US-Dollar	Rumänischer Leu	45.066	210.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.485)
US-Dollar	Rumänischer Leu	221.729	1.010.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(2.158)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	894.857	16.811.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(17.867)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	36.613	690.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(849)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	28.705	540.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(614)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	90.758	1.720.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.626)
US-Dollar	Thailändischer Baht	45.758	1.590.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(1.142)
US-Dollar	Thailändischer Baht	90.542	3.230.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(4.734)
US-Dollar	Thailändischer Baht	14.783	530.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(850)
US-Dollar	Türkische Lira	58.928	1.891.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(705)
US-Dollar	Hongkong-Dollar	455.440	3.542.626	26. Aug. 24	Goldman Sachs	(458)
US-Dollar	Taiwan-Dollar	230.045	6.930.000	4. Dez. 24	HSBC Bank plc	(3.533)
USD						(293.362)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 2.554.238			
(31. Dezember 2022: 3.737.054)			
2.554.238	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	2.554.238	8,39
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		2.554.238	8,39
Anleihen			
Angola - 163.750			
(31. Dezember 2022: 176.056)			
200.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 9.125% 26-Nov-2049	163.750	0,54
Argentinien - 431.348			
(31. Dezember 2022: 800.990)			
1.248.240	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.625% 09-Jul-2035	431.348	1,42
Australien - 180.334			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	180.334	0,59
Brasilien - 2.452.240			
(31. Dezember 2022: 4.042.151)			
200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 8.500% 12-Jan-2031	186.250	0,61
6.507.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	1.340.811	4,40
1.499.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	309.854	1,02
200.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	176.080	0,58
300.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	230.625	0,76
200.000	CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	208.620	0,68
Chile - 1.260.858			
(31. Dezember 2022: 442.283)			
245.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.300% 01-Oct-2028	245.122	0,80
280.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	306.502	1,01
175.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 6.000% 01-Apr-2033	209.155	0,69
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 5.950% 08-Jan-2034	203.274	0,67
150.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	119.834	0,39
200.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	176.971	0,58
China - 334.208			
(31. Dezember 2022: 1.637.363)			
990.000	China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	161.347	0,53
200.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	172.861	0,57
Kolumbien - 2.045.936			
(31. Dezember 2022: 2.469.570)			
4.589.400.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	1.045.462	3,43
1.634.700.000	Colombian TES 9.250% 28-May-2042	383.025	1,26
255.000	Ecopetrol SA 8.625% 19-Jan-2029	272.042	0,89
1.540.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	345.407	1,14
Tschechische Republik - 706.041			
(31. Dezember 2022: 224.697)			
7.960.000	Czech Republic Government Bond 4.500% 11-Nov-2032	376.132	1,24
6.800.000	Czech Republic Government Bond 5.500% 12-Dec-2028	329.909	1,08
Ecuador - 416.659			
(31. Dezember 2022: 615.190)			
550.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 6.000% 31-Jul-2030	257.020	0,84

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Ecuador Forts.			
302.102	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2040	96.673	0,32
134.743	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 6.000% 31-Jul-2030	62.966	0,21
Ägypten - 293.605			
(31. Dezember 2022: -)			
500.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	293.605	0,96
Gabun - 167.288			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Gabon Government International Bond 'REGS' 7.000% 24-Nov-2031	167.288	0,55
Ghana - 87.926			
(31. Dezember 2022: 301.120)			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.750% 07-Apr-2029	87.926	0,29
Guatemala - 207.300			
(31. Dezember 2022: -)			
213.000	Guatemala Government Bond 'REGS' 4.500% 03-May-2026	207.300	0,68
Hongkong - 181.935			
(31. Dezember 2022: 175.049)			
200.000	Prudential Funding Asia Plc 3.125% 14-Apr-2030	181.935	0,60
Ungarn - 630.067			
(31. Dezember 2022: 654.226)			
73.440.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	181.893	0,60
22.340.000	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	61.396	0,20
229.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	269.978	0,89
100.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6.000% 16-May-2029	116.800	0,38
Indien - 201.286			
(31. Dezember 2022: 191.185)			
220.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	201.286	0,66
Indonesien - 840.783			
(31. Dezember 2022: 1.613.089)			
5.969.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	433.938	1,42
400.000	Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	406.845	1,34
Israel - 760.871			
(31. Dezember 2022: -)			
300.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	254.017	0,84
300.000	Israel Government International Bond 'EMTN' 6.500% 06-Nov-2031	323.742	1,06
200.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	183.112	0,60
Libanon - 112.610			
(31. Dezember 2022: 110.781)			
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.200% 17-May-2033	24.923	0,08
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034	24.910	0,08
600.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.000% 20-Mar-2028	37.320	0,12
400.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.150% 20-Nov-2031	25.457	0,09
Macau - 475.706			
(31. Dezember 2022: 459.144)			
300.000	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	297.822	0,98
200.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	177.884	0,58

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Malaysia - 463.284			
(31. Dezember 2022: 472.235)			
1.925.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	463.284	1,52
Mexiko - 3.469.616			
(31. Dezember 2022: 3.736.948)			
200.000	Alpek SAB de CV 'REGS' 3.250% 25-Feb-2031	171.545	0,56
14.200.000	Mexican Bonos 5.000% 06-Mar-2025	793.138	2,60
16.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	879.402	2,89
6.600.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	380.577	1,25
9.846.100	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	553.512	1,82
200.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	165.672	0,54
250.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	199.936	0,66
250.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	178.082	0,58
147.000	Petroleos Mexicanos 10.000% 07-Feb-2033	147.752	0,49
Moldawien - 195.026			
(31. Dezember 2022: 200.823)			
280.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	195.026	0,64
Marokko - 228.504			
(31. Dezember 2022: 381.443)			
300.000	OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	228.504	0,75
Nigeria - 481.272			
(31. Dezember 2022: 748.086)			
500.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	481.272	1,58
Panama - 364.232			
(31. Dezember 2022: 755.426)			
250.000	Panama Government International Bond 4.500% 19-Jan-2063	164.179	0,54
200.000	Panama Government International Bond 6.875% 31-Jan-2036	200.053	0,66
Peru - 660.338			
(31. Dezember 2022: 770.443)			
200.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.875% 24-May-2026	198.174	0,65
600.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	146.695	0,48
439.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	315.469	1,04
Polen - 116.605			
(31. Dezember 2022: -)			
100.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	116.605	0,38
Republik Korea - 301.034			
(31. Dezember 2022: 734.406)			
382.700.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	301.034	0,99
Rumänien - 448.638			
(31. Dezember 2022: 779.088)			
780.000	Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	188.934	0,62
290.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	259.704	0,85
Russland - 350.476			
(31. Dezember 2022: 295.051)			
68.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026	350.476	1,15
Saudi-Arabien - 724.200			
(31. Dezember 2022: 510.546)			
400.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 4.750% 18-Jan-2028	404.035	1,33
300.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	320.165	1,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Senegal - 348.065			
(31. Dezember 2022: 461.811)			
340.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 4.750% 13-Mar-2028	348.065	1,14
Singapur - 230.825			
(31. Dezember 2022: -)			
250.000	Republic of Overseas Bank Ltd 'GMTN' FRN 1.750% 16-Mar-2031	230.825	0,76
Slowenien - 254.881			
(31. Dezember 2022: -)			
250.000	Slovenia Government International Bond 'REGS' 5.000% 19-Sep-2033	254.881	0,84
Südafrika - 1.386.164			
(31. Dezember 2022: 3.532.516)			
16.780.646	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	845.637	2,78
5.825.000	Republic of South Africa Government Bond 8.250% 31-Mar-2032	278.935	0,91
1.240.300	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	57.328	0,19
200.000	Sasol Financing USA LLC 'REGS' 8.750% 03-May-2029	204.264	0,67
Supranational - 170.918			
(31. Dezember 2022: 188.854)			
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4.700% 22-Oct-2031	170.918	0,56
Schweden - 186.725			
(31. Dezember 2022: -)			
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	186.725	0,61
Thailand - 813.206			
(31. Dezember 2022: 727.504)			
200.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	182.126	0,60
23.477.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	631.080	2,07
Türkei - 1.491.116			
(31. Dezember 2022: 411.422)			
250.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	228.560	0,75
200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama SA 'REGS' 8.509% 14-Jan-2029	212.400	0,70
200.000	Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 10.500% 06-Dec-2028	212.750	0,70
200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	198.300	0,65
11.250.000	Türkiye Government Bond 12.600% 01-Oct-2025	272.222	0,89
2.373.237	Türkiye Government Bond 26.200% 05-Oct-2033	83.755	0,28
7.537.000	Türkiye Government Bond 31.080% 08-Nov-2028	283.129	0,93
Ukraine - 348.200			
(31. Dezember 2022: 511.537)			
900.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2034	213.795	0,70
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2029	55.461	0,18
175.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 7.750% 01-Aug-2041	78.944	0,26
Vereinigte Arabische Emirate - 822.653			
(31. Dezember 2022: 406.176)			
200.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 'GMTN' 4.500% 14-Sep-2027	196.811	0,65
200.000	DP World Crescent Ltd 'REGS' 3.750% 30-Jan-2030	188.526	0,62
400.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	437.316	1,43

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %

Anleihen Forts.

Vereinigte Staaten von Amerika - 443.062			
(31. Dezember 2022: –)		443.062	1,46
450.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	443.062	1,46

Gesamtanlagen in Anleihen	26.249.791	86,20

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %

Offene Terminkontrakte - 252.339

(31. Dezember 2022: 123.744)				
	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	708.094	24.921	0,08
	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.196.508	11.189	0,04
	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.404.687	216.229	0,71

Offene Terminkontrakte insgesamt	252.339	0,83

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 753.322 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 61.556)	753.322	2,47

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt	29.809.690	97,89

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %

Offene Terminkontrakte - (21.687)

(31. Dezember 2022: (47.614))			
Euro-Bund Short Futures Contracts	(757.420)	(21.687)	(0,07)
Exp Mar-2024			

Offene Terminkontrakte insgesamt	(21.687)	(0,07)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (435.811) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (844.024))	(435.811)	(1,43)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt	(457.498)	(1,50)

Nettoumlaufvermögen	1.098.301	3,61

Summe Nettovermögen	30.450.493	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Ltd.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	92,94
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,81
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,43
Sonstiges Umlaufvermögen	3,82
Gesamtvermögen	100,00

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

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Euro	US-Dollar	190.000	208.238	23. Jan. 24	Morgan Stanley	1.703
Euro	US-Dollar	263.000	284.972	23. Jan. 24	Morgan Stanley	5.630
Euro	US-Dollar	510.000	556.518	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	7.006
Brasilianischer Real	US-Dollar	110.000	22.002	2. Feb. 24	Goldman Sachs International	601
Chilenischer Peso	US-Dollar	463.080.000	506.098	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	17.203
Chilenischer Peso	US-Dollar	258.270.000	290.059	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.798
Chinesischer Yuan	US-Dollar	6.058.000	833.371	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	21.451
Chinesischer Yuan	US-Dollar	190.000	26.600	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	210
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	473.070.000	113.175	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	6.990
Tschechische Krone	US-Dollar	499.000	21.896	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	371
Tschechische Krone	US-Dollar	310.000	13.437	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	397
Euro	US-Dollar	591.000	634.599	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	19.897
Ungarischer Forint	US-Dollar	49.072.000	139.581	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	643
Indonesische Rupiah	US-Dollar	539.140.000	33.739	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	1.274
Indonesische Rupiah	US-Dollar	467.810.000	30.336	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	45
Indonesische Rupiah	US-Dollar	378.140.000	24.206	20. Mrz. 24	Merrill Lynch International	352
Indonesische Rupiah	US-Dollar	11.513.276.492	723.969	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	23.738
Koreanischer Won	US-Dollar	185.210.000	143.039	20. Mrz. 24	Merrill Lynch International	635
Koreanischer Won	US-Dollar	636.925.000	487.195	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	6.891
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	70.000	15.138	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	216
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	4.984.350	1.057.238	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	36.062
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	120.000	25.703	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	618
Mexikanischer Peso	US-Dollar	10.310.000	585.327	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	14.102
Mexikanischer Peso	US-Dollar	1.163.000	65.676	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	1.941
Mexikanischer Peso	US-Dollar	570.000	31.058	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	2.082
Peruanischer neuer Sol	US-Dollar	845.620	219.243	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	8.784
Philippinischer Peso	US-Dollar	530.000	9.327	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	246
Polnischer Zloty	US-Dollar	110.000	27.427	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	499
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.962.000	698.026	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	53.949
Rumänischer Leu	US-Dollar	200.000	43.890	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	445
Rumänischer Leu	US-Dollar	817.000	173.210	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	7.895
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.240.000	262.522	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	12.349
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	350.000	18.190	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	813
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	7.976.000	423.443	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	9.601
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	7.321.000	384.610	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	12.871
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	10.343.000	560.142	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	1.413
Thailändischer Baht	US-Dollar	880.000	24.769	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	1.188
Thailändischer Baht	US-Dollar	12.615.154	352.882	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	19.230
Türkische Lira	US-Dollar	1.660.000	51.838	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	510
Türkische Lira	US-Dollar	140.000	4.374	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	41
US-Dollar	Chilenischer Peso	299.905	262.210.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	3.596
US-Dollar	Türkische Lira	93.636	2.960.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	293
US-Dollar	Türkische Lira	167.140	5.272.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	888
US-Dollar	Türkische Lira	261.521	8.252.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	1.295

USD **307.762**

US-Dollar	Euro	232.622	220.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(10.467)
US-Dollar	Euro	1.943.474	1.831.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(79.689)
US-Dollar	Brasilianischer Real	728.942	3.598.132	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(10.388)
Chinesischer Yuan	US-Dollar	100.000	14.137	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(26)
Türkische Lira	US-Dollar	590.000	18.698	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(93)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.						
US-Dollar	Chilenischer Peso	287.385	257.210.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(3.274)
US-Dollar	Chilenischer Peso	268.426	245.814.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(9.355)
US-Dollar	Chilenischer Peso	193.835	172.467.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.060)
US-Dollar	Chilenischer Peso	30.794	28.020.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(870)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	74.230	540.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(1.967)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	156.428	623.740.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(2.008)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.287.608	5.420.828.272	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(89.337)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	36.130	153.220.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(2.790)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	328.301	1.328.460.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(9.141)
US-Dollar	Tschechische Krone	52.854	1.240.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(2.478)
US-Dollar	Tschechische Krone	59.124	1.386.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.724)
US-Dollar	Euro	108.920	101.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(2.932)
US-Dollar	Ungarischer Forint	42.233	15.618.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.395)
US-Dollar	Ungarischer Forint	16.938	5.970.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(122)
US-Dollar	Ungarischer Forint	18.653	6.920.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.121)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	283.887	4.469.750.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(6.392)
US-Dollar	Koreanischer Won	293.719	392.702.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(10.914)
US-Dollar	Koreanischer Won	23.408	30.790.000	20. Mrz. 24	Bank of America Merrill Lynch	(477)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	17.167	80.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(380)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	560.078	2.580.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(5.836)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	21.197	100.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(738)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	68.556	1.200.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.213)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.793.692	33.020.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(126.109)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	39.409	710.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(1.871)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	228.847	3.969.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(1.912)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	7.836	30.000	20. Mrz. 24	Citigroup Global Markets Limited	(253)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	142.635	540.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(2.980)
US-Dollar	Polnischer Zloty	23.524	100.000	20. Mrz. 24	Barclays Bank PLC	(1.863)
US-Dollar	Rumänischer Leu	283.198	1.290.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(2.757)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	61.022	1.150.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(1.416)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	19.136	360.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(409)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	31.660	600.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(916)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.616.716	30.372.000	20. Mrz. 24	Goldman Sachs International	(32.280)
US-Dollar	Thailändischer Baht	39.139	1.360.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(977)
US-Dollar	Thailändischer Baht	13.389	480.000	20. Mrz. 24	Morgan Stanley	(770)
US-Dollar	Türkische Lira	70.988	2.278.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(849)
USD						(433.549)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	67	74	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	168	184	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	66	72	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	11.736	12.626	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	336
USD						338
EUR						306
Euro	US-Dollar	91	101	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	62	68	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	153	167	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	60	66	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.680	11.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	305
USD						307
EUR						278
Euro	US-Dollar	84	94	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	135.628	171.980	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	908
Pfund Sterling	US-Dollar	334.007	424.755	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.013
Pfund Sterling	US-Dollar	23.137.691	29.052.897	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	441.344
USD						443.265
GBP						347.754
Pfund Sterling	US-Dollar	189.929	242.618	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(510)
Pfund Sterling	US-Dollar	132.751	169.280	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
US-Dollar	Pfund Sterling	67.541	53.485	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(637)
US-Dollar	Pfund Sterling	135.279	106.950	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.053)
USD						(2.258)
GBP						(1.771)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Pfund Sterling	127	100	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	100	127	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	5	6	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	200	254	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	523	663	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	1.289	1.639	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	464	591	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	8.263	10.437	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	96
Pfund Sterling	US-Dollar	81.027	101.742	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.546
US-Dollar	Pfund Sterling	212	166	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						1.650
GBP						1.294
Pfund Sterling	US-Dollar	735	939	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(2)
GBP						(2)

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 2.345.587			
(31. Dezember 2022: 2.165.146)			
3.124.289	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund^	2.345.587	1,26
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		2.345.587	1,26
Anleihen			
Australien - 2.615.819			
(31. Dezember 2022: -)			
1.547.000	National Australia Bank Ltd 'EMTN' 3.263% 13-Feb-2026	1.554.163	0,83
433.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	465.344	0,25
566.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 4.375% 03-May-2033	596.312	0,32
Österreich - 8.838.865			
(31. Dezember 2022: 7.134.954)			
700.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	739.973	0,40
1.310.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Feb-2031	1.101.936	0,59
231.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Oct-2040	144.800	0,08
400.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.250% 20-Oct-2036	293.486	0,16
750.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.500% 20-Apr-2027	707.931	0,38
600.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.500% 20-Feb-2029	548.030	0,29
400.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.700% 20-Apr-2071	191.709	0,10
195.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.750% 20-Mar-2051	118.948	0,06
3.530.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.900% 20-Feb-2032	3.107.675	1,67
170.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 1.850% 23-May-2049	139.212	0,08
1.700.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 2.900% 20-Feb-2033	1.745.165	0,94
Belgien - 9.946.600			
(31. Dezember 2022: 5.725.970)			
500.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 3.875% 18-Mar-2031	518.878	0,28
1.100.000	KBC Bank NV 'EMTN' 3.125% 22-Feb-2027	1.110.499	0,60
1.000.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0.625% 07-Dec-2031	904.624	0,48
920.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.000% 22-Oct-2031	761.314	0,41
1.500.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.400% 22-Jun-2040	1.000.882	0,54
250.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.650% 22-Jun-2071	112.920	0,06
4.350.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.000% 22-Jun-2026	4.211.126	2,26
80.955	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.700% 22-Jun-2050	60.431	0,03
950.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 3.000% 22-Jun-2033	980.780	0,53
270.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 3.450% 22-Jun-2043	285.146	0,15
Bermudas - 346.206			
(31. Dezember 2022: -)			
335.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	346.206	0,19
Kanada - 1.670.160			
(31. Dezember 2022: 1.545.202)			
2.000.000	Province of Quebec Canada 'EMTN' 0.250% 05-May-2031	1.670.160	0,90
Kroatien - 201.553			
(31. Dezember 2022: -)			
190.000	Croatia Government International Bond 4.000% 14-Jun-2035	201.553	0,11

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Dänemark - 986.145			
(31. Dezember 2022: -)			
394.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 3.500% 26-Nov-2026	399.053	0,22
251.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 4.250% 05-Oct-2033	267.048	0,14
310.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 4.500% 09-Nov-2028	320.044	0,17
Estland - 367.337			
(31. Dezember 2022: -)			
340.000	Estonia Government International Bond 4.000% 12-Oct-2032	367.337	0,20
Finnland - 7.320.563			
(31. Dezember 2022: -)			
300.000	Finland Government Bond '144A' 0.125% 15-Sep-2031	251.555	0,14
2.350.000	Finland Government Bond '144A' 0.500% 15-Sep-2028	2.163.022	1,16
4.420.000	Finland Government Bond '144A' 3.000% 15-Sep-2033	4.588.151	2,46
299.000	Fortum Oyj 'EMTN' 4.500% 26-May-2033	317.835	0,17
Frankreich - 29.117.554			
(31. Dezember 2022: 34.441.154)			
700.000	ALD SA 'EMTN' 4.875% 06-Oct-2028	741.087	0,40
800.000	Arkea Home Loans SFH SA 'EMTN' 3.000% 30-Mar-2027	806.415	0,43
1.100.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 3.375% 04-Jan-2026	1.100.084	0,59
800.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	809.136	0,43
300.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.625% 02-Dec-2024	301.128	0,16
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.125% 13-Mar-2029	519.587	0,28
500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	487.347	0,26
800.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.125% 26-Sep-2032	839.236	0,45
700.000	BPCE SFH SA 1.750% 27-May-2032	642.472	0,35
400.000	BPCE SFH SA 3.250% 12-Apr-2028	407.405	0,22
1.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.000% 25-Nov-2030	1.177.505	0,63
900.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 2.750% 12-Apr-2028	901.655	0,48
2.800.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 'EMTN' 0.875% 31-Aug-2027	2.619.326	1,41
300.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.125% 07-Mar-2030	313.455	0,17
300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1.875% 13-Oct-2036	242.507	0,13
400.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	432.232	0,23
1.300.000	French Republic Government Bond OAT 0.500% 25-May-2029	1.187.212	0,64
4.130.000	French Republic Government Bond OAT 3.500% 25-Nov-2033	4.475.144	2,40
210.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.500% 25-May-2072	88.645	0,05
3.850.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.750% 25-May-2053	2.171.708	1,17
3.260.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 3.000% 25-May-2054	3.201.858	1,72
500.000	L'Oreal SA 'EMTN' 3.125% 19-May-2025	498.935	0,27
500.000	Orange SA 'EMTN' 3.875% 11-Sep-2035	533.268	0,29
700.000	Orano SA 'EMTN' 5.375% 15-May-2027	732.302	0,39
676.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 02-Oct-2029	711.757	0,38
400.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 3.750% 04-Jul-2035	419.136	0,23
1.100.000	Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027	1.009.483	0,54
1.100.000	Societe Generale SFH SA 1.375% 05-May-2028	1.039.133	0,56
300.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	280.798	0,15
400.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	427.598	0,23
Deutschland - 23.371.893			
(31. Dezember 2022: 32.317.149)			
500.000	Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	527.137	0,28

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Deutschland Forts.			
300.000	Bayer AG FRN 7.000% 25-Sep-2083	310.452	0,17
726.000	BMW Finance NV 'EMTN' 3.250% 22-Nov-2026	732.095	0,39
274.900	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.800% 15-Aug-2053	248.573	0,13
506.066	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.800% 15-Aug-2053	456.732	0,25
1.250.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.500% 04-Jul-2044	1.294.125	0,70
120.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 4.000% 23-Nov-2043	130.920	0,07
800.000	Deutsche Boerse AG 3.875% 28-Sep-2033	850.824	0,46
237.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	214.584	0,11
2.479.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 1.250% 04-May-2029	2.332.779	1,25
4.300.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	4.293.851	2,31
768.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 07-Jun-2032	703.665	0,38
3.784.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.000% 15-Nov-2029	3.697.259	1,99
1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.000% 15-Jun-2029	877.530	0,47
1.111.000	Land Berlin 0.625% 20-Mar-2026	1.064.456	0,57
500.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	521.490	0,28
2.214.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 'EMTN' 2.000% 15-Jun-2032	2.124.392	1,14
400.000	Volkswagen International Finance NV 1.875% 30-Mar-2027	382.704	0,21
616.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.625% 19-Jul-2029	530.099	0,28
720.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 4.750% 25-Sep-2031	767.632	0,41
300.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	317.551	0,17
500.000	Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	476.919	0,26
600.000	Wintershall Dea Finance BV 1.823% 25-Sep-2031	516.124	0,28
Griechenland - 418.091			
(31. Dezember 2022: -)		418.091	0,22
398.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	418.091	0,22
Ungarn - 614.060			
(31. Dezember 2022: -)		614.060	0,33
575.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	614.060	0,33
Irland - 3.266.707			
(31. Dezember 2022: 7.110.336)		3.266.707	1,75
1.503.000	AIB Group Plc FRN 3.625% 04-Jul-2026	1.504.060	0,81
400.000	Ireland Government Bond 0.400% 15-May-2035	318.632	0,17
300.000	Ireland Government Bond 1.500% 15-May-2050	227.499	0,12
755.000	Ireland Government Bond 2.400% 15-May-2030	763.554	0,41
422.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 30-Jun-2029	452.962	0,24
Italien - 12.532.260			
(31. Dezember 2022: 15.313.978)		12.532.260	6,73
153.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	158.006	0,08
563.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	590.835	0,32
1.508.000	Banco BPM SpA 'EMTN' 0.750% 15-Mar-2027	1.399.831	0,75
583.000	CA Auto Bank SpA/Ireland 'EMTN' 4.750% 25-Jan-2027	602.504	0,32
293.000	Coca-Cola HBC Finance BV 'EMTN' 2.750% 23-Sep-2025	290.227	0,16
399.000	Hera SpA 'EMTN' 4.250% 20-Apr-2033	414.964	0,22
840.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.050% 01-Aug-2027	818.236	0,44
1.760.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.800% 15-Apr-2026	1.797.453	0,97
1.500.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.600% 01-Aug-2031	1.225.908	0,66
163.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Mar-2037	114.282	0,06
1.598.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.250% 01-Mar-2038	1.467.230	0,79

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Italien Forts.			
2.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.000% 30-Oct-2031	2.084.093	1,12
112.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.000% 01-Feb-2037	113.417	0,06
689.000	Leasys SpA 4.375% 07-Dec-2024	689.878	0,37
746.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	765.396	0,41
Luxemburg - 1.081.335			
(31. Dezember 2022: 760.859)		1.081.335	0,58
265.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.750% 12-Mar-2029	223.845	0,12
900.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	857.490	0,46
Niederlande - 6.971.228			
(31. Dezember 2022: 7.845.650)		6.971.228	3,75
683.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	655.347	0,35
602.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 4.500% 23-Jan-2034	632.828	0,34
500.000	Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 'EMTN' 3.250% 28-May-2027	508.107	0,27
530.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.000% 15-Jul-2031	450.267	0,24
660.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.500% 15-Jan-2040	489.621	0,26
2.425.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.750% 15-Jul-2027	2.312.310	1,24
1.140.000	Netherlands Government Bond '144A' 2.000% 15-Jan-2054	1.029.580	0,56
420.000	Netherlands Government Bond '144A' 4.000% 15-Jan-2037	490.694	0,27
428.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	402.474	0,22
Polen - 1.537.752			
(31. Dezember 2022: -)		1.537.752	0,83
600.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	633.752	0,34
870.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 3.875% 14-Feb-2033	904.000	0,49
Portugal - 308.465			
(31. Dezember 2022: -)		308.465	0,17
300.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN' 3.875% 26-Jun-2028	308.465	0,17
Rumänien - 869.066			
(31. Dezember 2022: 782.929)		869.066	0,47
475.000	Romanian Government International Bond 'EMTN' 2.875% 11-Mar-2029	431.112	0,23
475.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	437.954	0,24
Slowakei - 1.258.709			
(31. Dezember 2022: -)		1.258.709	0,68
850.000	Slovakia Government Bond 1.000% 14-May-2032	721.119	0,39
520.000	Slovakia Government Bond 3.750% 23-Feb-2035	537.590	0,29
Spanien - 22.867.178			
(31. Dezember 2022: 18.516.958)		22.867.178	12,29
400.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.875% 02-Apr-2030	426.340	0,23
200.000	Aena SME SA 'EMTN' 4.250% 13-Oct-2030	212.750	0,12
700.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	735.364	0,40
600.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	588.418	0,32
800.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 6.000% 16-Aug-2033	812.696	0,44
500.000	Banco Santander SA 'EMTN' 4.875% 18-Oct-2031	532.650	0,29
600.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	527.691	0,28
1.200.000	Spain Government Bond 0.000% 31-Jan-2025	1.161.504	0,62
1.500.000	Spain Government Bond 0.000% 31-May-2025	1.440.240	0,77
860.000	Spain Government Bond '144A' 0.700% 30-Apr-2032	725.758	0,39
7.160.000	Spain Government Bond '144A' 1.400% 30-Apr-2028	6.838.373	3,67

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Spanien Forts.			
230.000	Spain Government Bond '144A' 2.550% 31-Oct-2032	224.255	0,12
6.100.000	Spain Government Bond '144A' 3.150% 30-Apr-2033	6.200.467	3,33
285.000	Spain Government Bond '144A' 3.450% 30-Jul-2066	266.332	0,14
1.202.000	Spain Government Bond '144A' 3.900% 30-Jul-2039	1.273.044	0,68
900.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	901.296	0,49
Supranational - 18.420.159			
(31. Dezember 2022: 11.804.208)		18.420.159	9,90
2.600.000	European Financial Stability Facility 0.875% 05-Sep-2028	2.424.417	1,30
620.000	European Investment Bank 0.375% 15-Sep-2027	576.798	0,31
2.500.000	European Investment Bank 1.500% 15-Jun-2032	2.304.877	1,24
1.800.000	European Investment Bank 2.250% 15-Mar-2030	1.781.660	0,96
2.060.241	European Stability Mechanism 1.000% 23-Jun-2027	1.963.563	1,06
202.000	European Stability Mechanism 3.000% 23-Aug-2033	208.834	0,11
750.000	European Union 0.000% 04-Jul-2035	547.834	0,29
368.736	European Union 0.700% 06-Jul-2051	209.741	0,11
700.000	European Union 1.250% 04-Feb-2043	524.529	0,28
1.625.000	European Union 1.625% 04-Dec-2029	1.551.420	0,83
1.141.153	European Union 2.625% 04-Feb-2048	1.062.733	0,57
2.181.039	European Union 3.125% 04-Dec-2030	2.264.486	1,22
813.000	European Union 3.250% 04-Jul-2034	853.516	0,46
211.581	European Union 4.000% 04-Apr-2044	240.117	0,13
940.000	International Bank for Reconstruction & Development 'EMTN' 3.450% 13-Sep-2038	1.002.336	0,54
880.000	International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 3.100% 14-Apr-2038	903.298	0,49
Schweden - 1.580.774			
(31. Dezember 2022: -)		1.580.774	0,85
411.000	Assa Abloy AB 'EMTN' 3.875% 13-Sep-2030	431.883	0,23
867.000	Stadshypotek AB 'EMTN' 3.125% 04-Apr-2028	879.281	0,47
260.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.625% 22-Feb-2032	269.610	0,15
Schweiz - 3.281.052			
(31. Dezember 2022: 3.054.021)		3.281.052	1,76
700.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 05-Nov-2028	616.518	0,33
1.229.000	UBS Group AG FRN 2.125% 13-Oct-2026	1.194.796	0,64
364.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	340.698	0,18
1.100.000	Zuercher Kantonalbank FRN 4.467% 15-Sep-2027	1.129.040	0,61
Vereinigtes Königreich - 7.708.454			
(31. Dezember 2022: 5.128.681)		7.708.454	4,14
327.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 4.918% 08-Aug-2030	341.046	0,18
470.000	Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029	405.112	0,22
296.000	BAT Capital Corp 7.081% 02-Aug-2053	287.950	0,15
148.330	Brass No 10 Plc FRN 0.669% 16-Apr-2069	130.357	0,07
200.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	179.329	0,10
427.000	DS Smith Plc 'EMTN' 4.375% 27-Jul-2027	438.990	0,24
840.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	771.163	0,41
415.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	430.208	0,23
691.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	716.951	0,39
521.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 3.250% 02-Feb-2026	523.441	0,28
334.000	National Gas Transmission Plc 'EMTN' 4.250% 05-Apr-2030	347.368	0,19
459.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.530% 20-Sep-2028	466.211	0,25
1.061.000	Nationwide Building Society 3.625% 03/15/28 3.625% 15-Mar-2028	1.095.448	0,59
548.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 'EMTN' 3.875% 14-Sep-2033	580.718	0,31
258.000	RELX Finance BV 3.750% 12-Jun-2031	268.352	0,14
280.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 4.250% 27-Feb-2031	291.430	0,16

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Anleihen Forts.				
Vereinigtes Königreich Forts.				
435.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 4.625% 29-Oct-2028	434.380	0,23	
Vereinigte Staaten von Amerika - 6.391.037				
(31. Dezember 2022: 9.008.586)		6.391.037	3,43	
318.000	Air Products and Chemicals Inc 4.000% 03-Mar-2035	336.672	0,18	
415.000	AT&T Inc 1.800% 14-Sep-2039	316.983	0,17	
386.000	AT&T Inc 4.300% 18-Nov-2034	408.788	0,22	
280.000	Carrier Global Corp 'REGS' 4.500% 29-Nov-2032	299.669	0,16	
650.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	615.524	0,33	
1.044.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.867 % 03-Aug-2027	1.072.794	0,57	
254.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN' 4.300% 15-Feb-2029	261.889	0,14	
275.000	Prologis Euro Finance LLC 4.625% 23-May-2033	294.019	0,16	
289.000	Realty Income Corp 5.125% 06-Jul-2034	319.229	0,17	
101.563	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20-Mar-2025	91.257	0,05	
697.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.250% 16-Jun-2031	724.253	0,39	
211.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	223.142	0,12	
300.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	277.767	0,15	
1.170.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026	1.149.051	0,62	
Gesamtanlagen in Anleihen		173.889.022	93,43	
Zinsswaps - 1.108.919				
(31. Dezember 2022: -)				
1.560.000	IRS EUR 05-Dec-2053	47.301	0,02	
1.670.000	IRS EUR 07-Dec-2053	29.808	0,02	
1.510.000	IRS EUR 28-Jul-2053	173.364	0,09	
87.000.000	IRS Receive Fixed 2.881% Pay 3 Month SEK STIBOR 05-Dec-2028	181.083	0,10	
7.640.000	IRS Receive Fixed 2.892% Pay Three Month EURIBOR 14-Feb-2033	259.923	0,14	
87.000.000	IRS Receive Fixed 3.609% Pay 3 Month SEK STIBOR 03-Oct-2028	417.440	0,22	
Zinsswaps insgesamt		1.108.919	0,59	
		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR		
Offene Terminkontrakte - 1.187.842				
(31. Dezember 2022: 766.719)				
95	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2024	11.319.250	405.577	0,22
26	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.772.900	10.895	0,01
4	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	566.880	21.407	0,01
68	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	4.897.075	144.828	0,08
171	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	18.280.419	605.135	0,32
Offene Terminkontrakte insgesamt		1.187.842	0,64	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 263.162 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 857.087)		263.162	0,14	
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		178.794.532	96,06	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Zinsswaps - (174.375)			
(31. Dezember 2022: -)			
3.040.000	IRS Receive Three Month EURIBOR Pay 2.384% 13-Feb-2053	(24.345)	(0,01)
2.200.000	IRS USD 05-Dec-2053	(46.577)	(0,02)
2.500.000	IRS USD 07-Dec-2053	(34.586)	(0,02)
2.455.000	IRS USD 28-Jul-2053	(68.867)	(0,04)
Zinsswaps insgesamt		(174.375)	(0,09)
		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	
Offene Terminkontrakte - (1.305.355)			
(31. Dezember 2022: (940.665))			
(175)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(14.856.208)	(638.841) (0,34)
(80)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(9.542.400)	(102.713) (0,06)
(77)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(10.565.940)	(178.160) (0,10)
(32)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.208.320)	(146.909) (0,08)
(201)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(21.415.545)	(21.208) (0,01)
(11)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(10.367.734)	(4.260) (0,00)
(38)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.598.543)	(213.264) (0,11)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(1.305.355)	(0,70)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (27.826) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (86.989))		(27.826)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(1.507.556)	(0,80)
Nettoumlaufvermögen		8.835.331	4,74
Summe Nettovermögen		186.122.307	100,00
^Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist JPMorgan Chase Bank. Der Kontrahent für Zinsswaps ist JPMorgan Chase Bank.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		92,86	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,63	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,72	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,79	
Gesamtvermögen		100,00	

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Kontrahent		
BNY Mellon Euroland Bond Fund						
Euro	US-Dollar	89.006	96.000	10. Jan. 24	HSBC Bank plc	2.076
Euro	US-Dollar	40.085	44.000	10. Jan. 24	Barclays Bank PLC	242
Euro	US-Dollar	240.235	256.000	10. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	8.421
Euro	US-Dollar	73.083	80.000	10. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	641
Kanadischer Dollar	Euro	920.000	627.457	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	1.300
Japanischer Yen	Euro	257.605.000	1.615.925	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	41.004
Schwedische Krone	Euro	949.000	83.264	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.967
Schwedische Krone	Euro	1.718.000	152.508	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	1.788
Schwedische Krone	Euro	877.000	77.524	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	1.241
Schwedische Krone	Euro	491.000	43.051	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.047
Euro	US-Dollar	957.925	1.014.000	18. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	40.038
Euro	US-Dollar	1.093.728	1.174.000	7. Feb. 24	HSBC Bank plc	31.883
Euro	Pfund Sterling	451.859	390.000	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	2.274
Euro	US-Dollar	404.326	443.000	22. Feb. 24	HSBC Bank plc	3.870
Euro	US-Dollar	475.176	520.000	22. Feb. 24	HSBC Bank plc	5.114
EUR						142.906
Euro	US-Dollar	80.041	89.000	10. Jan. 24	HSBC Bank plc	(551)
Kanadischer Dollar	Euro	530.000	362.854	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(636)
Chinesischer Yuan	Euro	530.000	68.046	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(651)
Euro	Tschechische Krone	8.131	201.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(4)
Euro	Japanischer Yen	915.383	145.000.000	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(17.265)
Euro	Schwedische Krone	353.480	4.000.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(5.766)
Euro	Schwedische Krone	103.764	1.186.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(2.752)
Euro	Pfund Sterling	50.521	44.000	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(201)
EUR						(27.826)
BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	5.314	5.653	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	74
Schweizer Franken	Euro	3.835	4.055	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	78
Schweizer Franken	Euro	5.572	5.880	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	125
Schweizer Franken	Euro	5.647	5.968	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	118
Schweizer Franken	Euro	5.352	5.631	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	137
Schweizer Franken	Euro	1.623	1.720	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Schweizer Franken	Euro	1.013.178	1.074.183	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.783
EUR						18.344
CHF						17.032
BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	29.966	31.878	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	418
Schweizer Franken	Euro	31.163	32.885	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	700
Schweizer Franken	Euro	31.583	33.380	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	658
Schweizer Franken	Euro	30.257	31.834	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	776
Schweizer Franken	Euro	5.660.975	6.001.834	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99.360
EUR						101.912
CHF						94.623

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 1.349.380			
(31. Dezember 2022: 1.215.130)			
5.766	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund^	935.651	1,60
322.080	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund^	413.729	0,71
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.349.380	2,31
Anleihen			
Australien - 1.503.002			
(31. Dezember 2022: 394.345)			
500.000	Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.125% 10-Mar-2028	460.830	0,79
100.000	Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.250% 01-Mar-2033	80.834	0,14
100.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	107.574	0,18
158.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	170.977	0,29
300.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'EMTN' 1.750% 11-Apr-2028	273.936	0,47
200.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028	188.513	0,32
209.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 4.375% 03-May-2033	220.338	0,38
Österreich - 513.000			
(31. Dezember 2022: 561.859)			
300.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	301.500	0,52
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	211.500	0,36
Belgien - 207.662			
(31. Dezember 2022: 728.355)			
200.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 3.875% 18-Mar-2031	207.662	0,36
Dänemark - 722.989			
(31. Dezember 2022: -)			
179.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 3.500% 26-Nov-2026	181.420	0,31
113.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 4.250% 05-Oct-2033	120.283	0,21
150.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 1.000% 15-May-2031	140.287	0,24
145.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 4.500% 09-Nov-2028	149.894	0,26
130.000	Danske Bank A/S FRN 4.000% 12-Jan-2027	131.105	0,22
Finnland - 204.200			
(31. Dezember 2022: -)			
191.000	Fortum Oyj 'EMTN' 4.500% 26-May-2033	204.200	0,35
Frankreich - 11.494.219			
(31. Dezember 2022: 9.229.298)			
200.000	ALD SA 'EMTN' 4.875% 06-Oct-2028	211.817	0,36
100.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	101.181	0,17
150.000	AXA SA 'EMTN' FRN 3.375% 06-Jul-2047	146.999	0,25
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.100% 08-Oct-2027	89.629	0,15
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.750% 10-Nov-2031	212.402	0,36
200.000	Banque Stellantis France SACA 'EMTN' 4.000% 21-Jan-2027	203.416	0,35
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.250% 13-Apr-2027	185.766	0,32
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	292.557	0,50
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 3.875% 10-Jan-2031	206.832	0,35
500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.125% 26-Sep-2032	527.493	0,90
100.000	Bouygues SA 5.375% 30-Jun-2042	119.314	0,20
200.000	BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	188.036	0,32
300.000	BPCE SA 0.625% 28-Apr-2025	288.985	0,50
200.000	BPCE SA 'EMTN' 0.375% 02-Feb-2026	188.534	0,32
400.000	BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042	363.704	0,62
200.000	BPCE SA FRN 2.125% 13-Oct-2046	163.304	0,28

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Frankreich Forts.			
400.000	Cie de Saint-Gobain SA 'EMTN' 3.750% 29-Nov-2026	407.254	0,70
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.125% 07-Mar-2030	104.669	0,18
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.375% 27-Nov-2033	105.225	0,18
300.000	Credit Agricole SA 'EMTN' FRN 5.500% 28-Aug-2033	315.390	0,54
200.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 3.375% 19-Sep-2027	200.822	0,34
200.000	Electricite de France SA 'EMTN' 3.750% 05-Jun-2027	204.142	0,35
200.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.625% 25-Jan-2043	210.953	0,36
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	108.158	0,19
200.000	Engie SA 'EMTN' 4.250% 06-Sep-2034	212.168	0,36
200.000	Engie SA 'EMTN' 4.500% 06-Sep-2042	215.784	0,37
100.000	Engie SA 'EMTN' 4.500% 06-Sep-2042	107.892	0,19
200.000	Gecina SA 2.000% 30-Jun-2032	186.806	0,32
100.000	Gecina SA 'EMTN' 0.875% 25-Jan-2033	83.257	0,14
200.000	Gecina SA 'EMTN' 0.875% 30-Jun-2036	148.331	0,25
100.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.625% 01-Jul-2030	83.586	0,14
300.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.625% 01-Jul-2030	250.757	0,43
100.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Aug-2032	88.116	0,15
300.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1.250% 13-Jun-2028	277.591	0,48
100.000	Orange SA 1.200% 11-Jul-2034	82.871	0,14
200.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	193.511	0,33
200.000	Orano SA 'EMTN' 5.375% 15-May-2027	209.404	0,36
200.000	Pernod Ricard SA 'EMTN' 3.750% 15-Sep-2033	209.666	0,36
288.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 02-Oct-2029	303.358	0,52
200.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 0.000% 09-Sep-2027	180.030	0,31
200.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 3.750% 04-Jul-2035	209.797	0,36
200.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 4.250% 06-Dec-2030	203.800	0,35
100.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	93.556	0,16
200.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	214.993	0,37
100.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	110.829	0,19
100.000	TDF Infrastructure SASU 2.500% 07-Apr-2026	97.663	0,17
200.000	Thales SA 'EMTN' 0.000% 26-Mar-2026	186.436	0,32
300.000	Thales SA 'EMTN' 3.625% 14-Jun-2029	307.550	0,53
300.000	Thales SA 'EMTN' 4.250% 18-Oct-2031	318.884	0,55
200.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025	195.753	0,34
280.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.369% 06-Oct-2026	273.319	0,47
300.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	275.164	0,47
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.750% 25-Oct-2028	89.922	0,15
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	84.819	0,15
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 4.125% 11-Dec-2030	103.059	0,18
500.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.500% 20-Jan-2029	449.100	0,77
300.000	Vinci SA 'EMTN' 3.375% 04-Feb-2025	299.865	0,51
Deutschland - 8.680.336			
(31. Dezember 2022: 4.222.400)			
200.000	Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	211.050	0,36
300.000	BASF SE 'EMTN' 4.000% 08-Mar-2029	313.825	0,54
100.000	BASF SE 'EMTN' 4.250% 08-Mar-2032	106.762	0,18
184.000	Bayer AG 'EMTN' 4.625% 26-May-2033	192.104	0,33
160.000	Bayer AG 'EMTN' 4.625% 26-May-2033	167.047	0,29
200.000	Bayer AG FRN 3.125% 12-Nov-2079	181.450	0,31
100.000	Bayer AG FRN 7.000% 25-Sep-2083	103.875	0,18
231.000	BMW Finance NV 'EMTN' 3.250% 22-Nov-2026	233.106	0,40
90.000	BMW Finance NV 'EMTN' 3.250% 22-Jul-2030	92.300	0,16
266.000	Continental AG 4.000% 01-Jun-2028 'EMTN' 4.000% 01-Jun-2028	274.767	0,47
150.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 4.000% 23-Nov-2043	163.837	0,28

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Deutschland Forts.			
400.000	Deutsche Boerse AG 3.875% 28-Sep-2033	428.236	0,73
100.000	E.ON SE 'EMTN' 0.350% 28-Feb-2030	85.079	0,15
124.000	E.ON SE 'EMTN' 4.000% 29-Aug-2033	130.829	0,22
300.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 2.125% 31-Aug-2081	234.271	0,40
67.000	EnBW International Finance BV 'EMTN' 4.049% 22-Nov-2029	70.444	0,12
200.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3.722% 27-Apr-2030	204.517	0,35
190.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 5.125% 05-Oct-2030	204.845	0,35
575.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Mar-2024	570.621	0,98
60.000	Heidelberg Materials AG 3.750% 31-May-2032	60.746	0,10
65.000	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA 'EMTN' 4.875% 21-Nov-2033	69.340	0,12
500.000	Infineon Technologies AG 0.625% 17-Feb-2025	483.549	0,83
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029	93.112	0,16
100.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.375% 17-Jan-2026	93.593	0,16
100.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.750% 30-Jun-2031	79.637	0,14
100.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 1.500% 17-Jan-2034	78.615	0,13
300.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.700% 30-May-2031	313.921	0,54
292.000	Roadster Finance DAC 'EMTN' 1.625% 09-Dec-2024	281.926	0,48
100.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	104.829	0,18
100.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	104.364	0,18
100.000	Sartorius Finance BV 4.875% 14-Sep-2035	105.816	0,18
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 3.000% 08-Sep-2033	300.995	0,51
400.000	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 4.375% 03-May-2028	413.312	0,71
100.000	Volkswagen International Finance NV 4.125% 16-Nov-2038	103.928	0,18
100.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 4.375% 15-May-2030	105.464	0,18
300.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 14-Jun-2027	286.733	0,49
200.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029	184.136	0,31
100.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 4.375% 28-Mar-2031	90.863	0,16
100.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 7.875% 06-Sep-2032	113.210	0,19
233.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 4.750% 25-Sep-2031	249.656	0,43
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	83.208	0,14
100.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	66.045	0,11
100.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	105.883	0,18
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	88.050	0,15
500.000	Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	477.420	0,82
200.000	Wintershall Dea Finance BV 1.823% 25-Sep-2031	173.020	0,30
Griechenland - 134.445			
(31. Dezember 2022: -)		134.445	0,23
128.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	134.445	0,23
Hongkong - 85.425			
(31. Dezember 2022: 77.668)		85.425	0,15
100.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	85.425	0,15
Irland - 926.726			
(31. Dezember 2022: 1.904.366)		926.726	1,59
239.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.250% 04-Apr-2028	229.231	0,39
238.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	220.387	0,38
210.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	199.136	0,34
100.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	105.831	0,18
160.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 30-Jun-2029	172.141	0,30

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Italien - 2.764.463			
(31. Dezember 2022: 2.001.830)		2.764.463	4,73
128.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.625% 25-Jan-2028	118.315	0,20
151.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	156.015	0,27
232.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	245.015	0,42
180.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.875% 28-Sep-2034	135.999	0,23
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 1.125% 17-Oct-2034	77.802	0,13
155.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.875% 08-Jun-2030	123.022	0,21
160.000	Eni SpA 'EMTN' 4.250% 19-May-2033	168.341	0,29
229.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	209.191	0,36
110.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.750% 11-Feb-2030	94.820	0,16
200.000	Genertel SpA FRN 4.250% 14-Dec-2047	199.000	0,34
180.000	Hera SpA 'EMTN' 4.250% 20-Apr-2033	187.325	0,32
162.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	145.882	0,25
120.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 5.125% 29-Aug-2031	128.109	0,22
163.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.500% 26-Jul-2026	166.036	0,28
231.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	237.085	0,41
120.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.925% 18-Jan-2028	111.531	0,19
260.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024	260.975	0,45
Japan - 658.552			
(31. Dezember 2022: 1.070.814)		658.552	1,13
200.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.541% 23-Oct-2028	176.652	0,30
500.000	Asahi Group Holdings Ltd 1.151% 19-Sep-2025	481.900	0,83
Luxemburg - 808.993			
(31. Dezember 2022: 974.046)		808.993	1,38
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028	84.020	0,14
245.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	189.900	0,33
168.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	157.421	0,27
101.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	96.013	0,16
200.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	176.470	0,30
105.000	SELP Finance Sarl 'EMTN' 3.750% 10-Aug-2027	105.169	0,18
Niederlande - 3.283.067			
(31. Dezember 2022: 2.301.471)		3.283.067	5,62
235.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	210.266	0,36
100.000	Heineken NV 'EMTN' 3.875% 23-Sep-2030	104.775	0,18
899.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	806.650	1,38
100.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 4.500% 23-Jan-2034	105.277	0,18
375.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.500% 04-Apr-2028	383.852	0,66
346.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	322.624	0,55
330.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 0.875% 08-Nov-2039	229.248	0,39
200.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.125% 17-Nov-2029	193.486	0,33
250.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	235.426	0,40
145.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	136.706	0,24
300.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	267.489	0,46
163.000	Viterra Finance BV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2025	153.632	0,26
150.000	Viterra Finance BV 'EMTN' 1.000% 24-Sep-2028	133.636	0,23
Norwegen - 265.088			
(31. Dezember 2022: -)		265.088	0,45
256.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.500% 19-Jul-2028	265.088	0,45
Polen - 211.050			
(31. Dezember 2022: 83.259)		211.050	0,36
200.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	211.050	0,36
Portugal - 511.010			
(31. Dezember 2022: 261.893)		511.010	0,87
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN' 3.875% 26-Jun-2028	103.023	0,17

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Portugal Forts.				
285.000	EDP Servicios Financieros Espana SA 'EMTN' 4.125% 04-Apr-2029	296.946	0,51	
100.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	111.041	0,19	
Slowakei - 106.457				
(31. Dezember 2022: 90.689)				
113.000	Zapadoslovenska Energetika AS 1.750% 02-Mar-2028	106.457	0,18	
Südafrika - 302.904				
(31. Dezember 2022: 287.434)				
150.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026	144.450	0,25	
150.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 4.750% 21-Sep-2032	158.454	0,27	
Spanien - 3.884.395				
(31. Dezember 2022: 3.454.324)				
300.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.875% 02-Apr-2030	320.706	0,55	
100.000	Aena SME SA 'EMTN' 4.250% 13-Oct-2030	106.775	0,18	
200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	210.104	0,36	
300.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.125% 27-Mar-2025	290.731	0,50	
200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	181.043	0,31	
200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.250% 07-Feb-2029	207.650	0,36	
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.500% 08-Sep-2029	104.679	0,18	
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 4.875% 18-Oct-2031	106.612	0,18	
300.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.000% 19-Jul-2029	314.937	0,54	
400.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 6.125% 30-May-2034	424.168	0,73	
300.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.000% 15-Sep-2027	274.689	0,47	
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Sep-2032	85.528	0,15	
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	87.960	0,15	
119.000	FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027	116.598	0,20	
100.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.875% 25-Apr-2028	101.100	0,17	
200.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	182.652	0,31	
100.000	Merlin Properties Socimi SA 1.875% 04-Dec-2034	79.449	0,14	
200.000	Merlin Properties Socimi SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	170.539	0,29	
200.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	200.286	0,34	
300.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 7.250% 15-Nov-2027	318.189	0,54	
Schweden - 640.572				
(31. Dezember 2022: 177.618)				
192.000	Akelius Residential Property AB 'EMTN' 1.750% 07-Feb-2025	186.201	0,32	
173.000	Assa Abloy AB 'EMTN' 3.875% 13-Sep-2030	181.882	0,31	
185.000	Investor AB 'EMTN' 1.500% 12-Sep-2030	168.720	0,29	
100.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.625% 22-Feb-2032	103.769	0,18	
Schweiz - 2.381.231				
(31. Dezember 2022: 1.437.674)				
270.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN' 5.500% 20-Aug-2026	283.998	0,49	
300.000	Holcim Finance Luxembourg SA 1.500% 06-Apr-2025	292.052	0,50	
300.000	Holcim Finance Luxembourg SA FRN (Perpetual) 3.000% 05-Apr-2024	299.001	0,51	
100.000	UBS Group AG 'EMTN' 0.625% 18-Jan-2033	75.735	0,13	
200.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 29-Jan-2026	191.743	0,33	
260.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	238.329	0,41	
200.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 4.375% 11-Jan-2031	206.894	0,35	
420.000	UBS Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	485.499	0,83	
300.000	Zuercher Kantonalbank FRN 4.467% 15-Sep-2027	307.980	0,53	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Arabische Emirate - 96.129				
(31. Dezember 2022: 94.004)				
100.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 2.375% 25-Sep-2026	96.129	0,16	
Vereinigtes Königreich - 7.853.964				
(31. Dezember 2022: 4.798.976)				
149.000	AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	157.611	0,27	
270.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.375% 04-Dec-2045	263.700	0,45	
290.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 1.375% 24-Jan-2026	281.640	0,48	
155.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 4.918% 08-Aug-2030	162.247	0,28	
150.000	Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032	122.389	0,21	
95.000	BAT Capital Corp 7.081% 02-Aug-2053	92.244	0,16	
160.000	BP Capital Markets BV 'EMTN' 4.323% 12-May-2035	170.892	0,29	
350.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029	328.221	0,56	
100.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.125% 12-Sep-2029	89.834	0,15	
115.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.500% 23-Jun-2027	108.707	0,19	
280.000	Diageo Finance Plc 'EMTN' 3.500% 26-Jun-2025	280.273	0,48	
147.000	DS Smith Plc 'EMTN' 4.500% 27-Jul-2030	153.684	0,26	
216.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	198.090	0,34	
348.000	Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025	336.977	0,58	
300.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.500% 11-Feb-2030	268.061	0,46	
100.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.856% 23-May-2033	106.398	0,18	
170.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	176.875	0,30	
126.000	Imperial Brands Finance Netherlands BV 'EMTN' 5.250% 15-Feb-2031	131.087	0,22	
150.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027	144.838	0,25	
300.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 3.375% 26-Feb-2026	297.149	0,51	
300.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 1.625% 08-Oct-2024	294.916	0,51	
340.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027	328.221	0,56	
315.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	327.471	0,56	
100.000	National Gas Transmission Plc 'EMTN' 4.250% 05-Apr-2030	104.311	0,18	
216.000	National Gas Transmission Plc 'EMTN' 4.250% 05-Apr-2030	224.760	0,39	
100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	103.137	0,18	
231.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 'EMTN' 3.875% 14-Sep-2033	244.977	0,42	
123.000	RELX Finance BV 3.750% 12-Jun-2031	128.504	0,22	
100.000	Rentokil Initial Finance BV 'EMTN' 4.375% 27-Jun-2030	106.045	0,18	
260.000	Rentokil Initial Plc 'EMTN' 0.500% 14-Oct-2028	230.675	0,40	
200.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	181.288	0,31	
130.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	110.553	0,19	
690.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.875% 29-May-2026	653.723	1,12	
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	94.965	0,16	
100.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 2.250% 16-May-2034	94.013	0,16	
345.000	Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	343.361	0,59	
217.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 4.625% 29-Oct-2028	216.691	0,37	
206.000	Yorkshire Building Society 0.625% 21-Sep-2025	195.436	0,33	
Vereinigte Staaten von Amerika - 7.599.491				
(31. Dezember 2022: 6.803.488)				
150.000	AbbVie Inc 2.125% 17-Nov-2028	144.773	0,25	
100.000	American Medical Systems Europe BV 1.875% 08-Mar-2034	87.334	0,15	
190.000	American Tower Corp 1.375% 04-Apr-2025	184.509	0,32	
200.000	AT&T Inc 1.800% 14-Sep-2039	153.026	0,26	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
260.000	AT&T Inc 2.600 % 19-May-2038	223.540	0,38
146.000	AT&T Inc 4.300% 18-Nov-2034	155.435	0,27
153.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	144.037	0,25
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026	95.534	0,16
125.000	Booking Holdings Inc 4.125% 12-May-2033	134.298	0,23
200.000	Booking Holdings Inc 4.500% 15-Nov-2031	217.817	0,37
114.000	Carrier Global Corp 'REGS' 4.500% 29-Nov-2032	122.549	0,21
290.000	Celanese US Holdings LLC 1.250% 11-Feb-2025	281.478	0,48
256.000	Celanese US Holdings LLC 5.337% 19-Jan-2029	269.043	0,46
115.000	Celanese US Holdings LLC 5.337% 19-Jan-2029	120.772	0,21
150.000	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	155.742	0,27
186.000	CRH SMW Finance DAC 'EMTN' 4.250% 11-Jul-2035	197.171	0,34
140.000	Dow Chemical Co/The 0.500% 15-Mar-2027	128.392	0,22
120.000	Exxon Mobil Corp 0.835% 26-Jun-2032	99.803	0,17
230.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	218.017	0,37
170.000	Fiserv Inc 4.500% 24-May-2031	180.476	0,31
150.000	Fiserv Inc 4.500% 24-May-2031	159.490	0,27
264.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.867 % 03-Aug-2027	271.471	0,46
96.000	General Electric Co 'EMTN' 4.125% 19-Sep-2035	103.324	0,18
211.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	186.968	0,32
173.000	Honeywell International Inc 3.750% 17-Mar-2032	180.699	0,31
100.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	107.050	0,18
320.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 4.457% 13-Nov-2031	339.290	0,58
300.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.000% 15-Oct-2025	283.514	0,49
200.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032	165.056	0,28
120.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039	91.963	0,16
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 2.250% 07-Mar-2039	85.389	0,15
129.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.950% 07-May-2032	122.636	0,21
190.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 5.148% 25-Jan-2034	209.988	0,36
300.000	Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030	306.876	0,53
100.000	Philip Morris International Inc 1.875% 06-Nov-2037	75.403	0,13
200.000	Philip Morris International Inc 3.125% 03-Jun-2033	194.562	0,33
174.000	Procter & Gamble Co/The 3.250% 02-Aug-2031	179.631	0,31
293.000	Realty Income Corp 5.125% 06-Jul-2034	325.733	0,56
134.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.250% 16-Jun-2031	139.226	0,24
200.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.875% 01-Oct-2031	171.011	0,29
400.000	Utah Acquisition Sub Inc 2.250% 22-Nov-2024	393.048	0,67
185.000	Veralto Corp 'REGS' 4.150% 19-Sep-2031	193.417	0,33
Gesamtanlagen in Anleihen		55.839.370	95,61
Credit Default Swaps - 106.853			
(31. Dezember 2022: 36.589)			
(2.750.000)	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	53.427	0,09
(2.750.000)	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	53.426	0,09
Credit Default Swaps insgesamt		106.853	0,18

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 4.574				
(31. Dezember 2022: 141.369)				
23	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.744.130	4.574	0,01
Offene Terminkontrakte insgesamt			4.574	0,01
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 55.225 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 100.878)			55.225	0,09
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			57.355.402	98,20

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Credit Default Swaps - (106.853)			
(31. Dezember 2022: (14.684))			
1.080.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(20.982)	(0,04)
550.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(10.685)	(0,02)
960.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(18.651)	(0,03)
960.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(18.651)	(0,03)
1.950.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(37.884)	(0,06)
Credit Default Swaps insgesamt		(106.853)	(0,18)

		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung			

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (103.192)				
(31. Dezember 2022: (72.043))				
(17)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.335.800)	(51.843)	(0,09)
(2)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(283.760)	(22.112)	(0,04)
(34)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.622.870)	(4.173)	(0,01)
(3)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(319.878)	(14.477)	(0,02)
(1)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(121.084)	(10.587)	(0,02)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(103.192)	(0,18)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (11.878) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (11.771))			(11.878)	(0,02)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(221.923)	(0,38)
Nettoumlaufvermögen			1.267.438	2,18
Summe Nettovermögen			58.400.917	100,00

*Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.
Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.
Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs und Morgan Stanley.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,51
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,01
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,28
Sonstiges Umlaufvermögen	2,20
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon European Credit Fund						
Euro	US-Dollar	312.533	333.000	10. Jan. 24	Morgan Stanley	12.014
Euro	US-Dollar	537.436	569.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	24.114
Euro	US-Dollar	402.943	433.000	7. Feb. 24	BNP Paribas	12.637
Euro	US-Dollar	483.934	530.000	22. Feb. 24	Morgan Stanley	6.460
EUR						55.225
US-Dollar	Euro	319.000	299.663	18. Jan. 24	Morgan Stanley	(11.878)
EUR						(11.878)

BNY MELLON FLOATING RATE CREDIT FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 1.317.282		1.317.282	4,22
13.104	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	1.317.282	4,22
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.317.282	4,22
Anleihen			
Österreich - 429.731		429.731	1,38
450.000	Benteler International AG '144A' 10.500% 21-Mar-2028	429.731	1,38
Finnland - 380.625		380.625	1,22
375.000	PHM Group Holding Oy '144A' FRN 11.420% 19-Jun-2026	380.625	1,22
Frankreich - 3.359.887		3.359.887	10,75
228.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 7.000% 01-May-2029	241.395	0,77
400.000	CNP Assurances SACA FRN (Perpetual) 2.650% 21-Mar-2024	324.052	1,04
600.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Dec-2027	534.755	1,71
375.000	Forvia SE 2.375% 15-Jun-2029	343.271	1,10
375.000	IPD 3 BV 'REGS' FRN 8.675% 15-Jun-2028	381.688	1,22
375.000	Kapla Holding SAS 'REGS' FRN 9.465% 15-Jul-2027	383.550	1,23
375.000	Lion/Polaris Lux 4 SA 'REGS' FRN 7.925% 01-Jul-2026	375.820	1,20
369.000	Paprec Holding SA 'REGS' 7.250% 17-Nov-2029	397.232	1,27
375.000	Parts Europe SA 'REGS' FRN 7.993% 20-Jul-2027	378.124	1,21
Deutschland - 2.146.582		2.146.582	6,87
375.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' FRN 8.752% 15-May-2030	385.428	1,23
400.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 1.875% 29-Jun-2080	374.341	1,20
430.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	422.026	1,35
375.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' FRN 8.715% 15-Jul-2027	380.771	1,22
200.000	ZF Europe Finance BV 'EMTN' 6.125% 13-Mar-2029	213.086	0,68
400.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.000% 06-May-2027	370.930	1,19
Guatemala - 378.626		378.626	1,21
450.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028	378.626	1,21
Irland - 991.503		991.503	3,17
375.000	Bosphorus CLO VII DAC FRN 7.685% 17-Oct-2036	377.230	1,20
375.000	Nassau Euro CLO I DAC FRN 6.625% 15-Dec-2034	365.273	1,17
249.000	OCP Euro Clo 2022-6 DAC '2022-6X CR' FRN 0.000% 20-Jul-2036	249.000	0,80
Israel - 412.671		412.671	1,32
375.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.375% 15-Sep-2029	412.671	1,32
Italien - 2.244.262		2.244.262	7,18
375.000	Conceria Pasubio SpA 'REGS' FRN 8.393% 30-Sep-2028	363.984	1,17
375.000	EVOCA SpA 'REGS' FRN 8.218% 01-Nov-2026	371.578	1,19
375.000	Fiber Bidco Spa 'REGS' FRN 9.893% 25-Oct-2027	382.691	1,22
375.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 'REGS' FRN 7.965% 15-Jan-2028	376.172	1,20
375.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 9.393% 06-Feb-2028	373.665	1,20
375.000	Reno de Medici SpA 'REGS' FRN 9.175% 14-Dec-2026	376.172	1,20
Luxemburg - 1.170.583		1.170.583	3,75
425.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.875% 01-May-2026	413.497	1,32
375.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' FRN 9.175% 01-May-2028	379.702	1,22

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Luxemburg Forts.			
375.000	PLT VII Finance Sarl 'REGS' FRN 8.590% 05-Jan-2026	377.384	1,21
Niederlande - 2.094.768		2.094.768	6,71
250.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	232.277	0,74
375.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' FRN 5.975% 01-Mar-2026	374.492	1,20
375.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' FRN 7.752% 15-Aug-2026	376.328	1,21
450.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	384.680	1,23
375.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	329.885	1,06
450.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	397.106	1,27
Nigeria - 184.118		184.118	0,59
250.000	IHS Holding Ltd 'REGS' 6.250% 29-Nov-2028	184.118	0,59
Norwegen - 1.575.402		1.575.402	5,04
5.000.000	Aker Horizons ASA FRN 8.020% 15-Aug-2025	432.194	1,38
4.000.000	Hoegh LNG Holdings Ltd FRN 10.720% 30-Jan-2025	371.789	1,19
4.500.000	SFL Corp Ltd '144A' FRN 9.090% 21-Jan-2025	409.437	1,31
4.000.000	Wallenius Wilhelmsen ASA FRN 7.970% 31-Aug-2028	361.982	1,16
Polen - 465.593		465.593	1,49
500.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	465.593	1,49
Portugal - 360.620		360.620	1,15
400.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.500% 14-Mar-2082	360.620	1,15
Slowenien - 377.150		377.150	1,21
375.000	United Group BV 'REGS' FRN 8.843% 01-Feb-2029	377.150	1,21
Spanien - 1.477.331		1.477.331	4,73
375.000	Grifols Escrow Issuer SA 'REGS' 3.875% 15-Oct-2028	344.188	1,10
400.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.450% 09-Nov-2026	364.900	1,17
407.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	398.133	1,27
400.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.502% 05-Feb-2027	370.110	1,19
Schweden - 1.574.214		1.574.214	5,04
400.000	Assemblin Group AB 'REGS' FRN 8.964% 05-Jul-2029	408.552	1,31
375.000	Ren10 Holding AB 'REGS' FRN 8.343% 01-Feb-2027	375.235	1,20
375.000	Verisure Holding AB 'REGS' 7.125% 01-Feb-2028	396.055	1,27
400.000	Ytinrete BidCo AB FRN 10.931% 12-Jul-2028	394.372	1,26
Tansania - 223.440		223.440	0,72
250.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	223.440	0,72
Vereinigtes Königreich - 3.772.082		3.772.082	12,07
300.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 8.450% 31-Jan-2028	364.061	1,17
275.000	B&M European Value Retail SA 8.125% 15-Nov-2030	338.696	1,08
375.000	Galaxy Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jul-2026	418.913	1,34
350.000	Greene King Finance Plc FRN 7.139% 15-Dec-2034	319.272	1,02
400.000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 7.583% 15-Jun-2036	369.275	1,18
400.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 10.000% 11-Oct-2028	481.674	1,54
375.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' FRN 9.752% 31-Jul-2025	367.821	1,18
375.000	TVL Finance Plc 'REGS' FRN 9.452% 28-Apr-2028	384.026	1,23
332.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	354.617	1,13

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
375.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	373.727	1,20
Vereinigte Staaten von Amerika - 3.157.154			
375.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 2.000% 01-Sep-2028	333.014	1,07
450.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	401.168	1,28
590.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	579.871	1,86
165.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 8.000% 15-Feb-2031	149.377	0,48
450.000	Avis Budget Finance Plc 'REGS' 7.250% 31-Jul-2030	482.699	1,54
350.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	390.190	1,25
375.000	OI European Group BV 'REGS' 6.250% 15-May-2028	393.375	1,26
400.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 9.500% 15-Jul-2028	427.460	1,37
Gesamtanlagen in Anleihen		26.776.342	85,71
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)			
Luxemburg - 502.190			
500.000	Albion Financing 3 S.a r.l. (Albion Financing LLC) 2023-B Incremental Euro Term Loan 9.252% 16-Aug-2026	502.190	1,61
Niederlande - 1.502.243			
500.000	PEARLS (Netherlands) Bidco B.V. - Caldic BV EUR Term Loan 7.448% 26-Feb-2029	493.750	1,58
500.000	Villa Dutch Bidco House of HR Group B.V. Term Loan 9.472% 03-Nov-2029	499.235	1,60
508.333	WP/AP Telecom Holdings IV B.V. Term Loan 7.725% 31-Mar-2029	509.258	1,63
Vereinigte Staaten von Amerika - 958.233			
498.750	Arsenal AIC Parent LLC Term Loan 9.856% 27-Jul-2030	454.328	1,45
500.000	Windsor Holdings III LLC Term Loan 8.368% 21-Jun-2030	503.905	1,61
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		2.962.666	9,48
Credit Default Swaps - 15.621			
(150.000)	CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2026	5.207	0,02
(300.000)	CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2026	10.414	0,03
Credit Default Swaps insgesamt		15.621	0,05
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 54.658 (siehe unten)		54.658	0,18
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		31.126.569	99,64
Zinsswaps - (264.588)			
500.000	IRS Receive 1 Year USD SOFR-Compounded Pay Fixed 4.543% 03-Jan-2026	(4.070)	(0,01)
270.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.119% 30-Jun-2029	(9.425)	(0,03)
350.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.119% 30-Jun-2029	(12.218)	(0,04)
510.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.247% 03-Dec-2027	(14.468)	(0,05)
315.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.277% 30-Dec-2027	(9.631)	(0,03)
335.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.317% 30-Sep-2027	(9.864)	(0,03)
390.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.335% 30-Jun-2027	(10.899)	(0,04)
Zinsswaps Forts.			
400.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.335% 30-Jun-2027	(11.179)	(0,04)
775.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.335% 30-Jun-2027	(21.659)	(0,07)
380.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.398% 30-Mar-2027	(10.242)	(0,03)
375.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.398% 30-Mar-2027	(10.107)	(0,03)
170.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.398% 30-Mar-2027	(4.582)	(0,01)
375.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.398% 30-Mar-2027	(10.107)	(0,03)
360.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.398% 30-Mar-2027	(9.703)	(0,03)
410.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.451% 30-Dec-2026	(10.407)	(0,03)
400.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.510% 30-Sep-2026	(9.455)	(0,03)
450.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.510% 30-Sep-2026	(10.637)	(0,03)
435.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.562% 30-Jun-2026	(9.343)	(0,03)
435.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.628% 30-Mar-2026	(8.511)	(0,03)
535.123	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 3.832% 30-Jun-2025	(5.728)	(0,02)
400.000	IRS Receive 6 Month EURIBOR Pay Fixed 4.075% 30-Jun-2024	(95)	(0,00)
270.000	IRS Receive GBP SONIA Pay Fixed 4.559% 03-Jul-2030	(22.590)	(0,07)
275.000	IRS Receive GBP SONIA Pay Fixed 5.107% 03-Oct-2027	(17.139)	(0,06)
350.000	IRS Receive GBP SONIA Pay Fixed 5.758% 03-Jul-2025	(8.150)	(0,03)
330.000	IRS Receive GBP SONIA Pay Fixed 5.867% 03-Nov-2024	(3.007)	(0,01)
300.000	IRS Receive USD SOFR Pay Fixed 4.372% 07-Jul-2026	(3.031)	(0,01)
400.000	IRS Receive USD SOFR Pay Fixed 4.372% 07-Jul-2026	(4.041)	(0,01)
200.000	IRS Receive USD SOFR Pay Fixed 4.372% 07-Jul-2026	(2.021)	(0,01)
430.000	IRS Receive USD SOFR Pay Fixed 4.805% 08-Jul-2025	(2.279)	(0,01)
Zinsswaps insgesamt		(264.588)	(0,85)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (131.197) (siehe unten)		(131.197)	(0,42)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(395.785)	(1,27)
Nettoumlaufvermögen		509.731	1,63
Summe Nettovermögen		31.240.515	100,00
* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss. Die Kontrahenten für Zinsswaps sind Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley. 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		87,56	
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		9,23	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,22	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,99	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund						
Euro	US-Dollar	149.799	164.000	10. Jan. 24	Morgan Stanley	1.293
Norwegische Krone	Euro	102.000	8.721	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	372
Norwegische Krone	Euro	3.154.000	267.074	12. Jan. 24	Morgan Stanley	14.085
Euro	US-Dollar	687.702	739.000	7. Feb. 24	BNP Paribas	19.301
Euro	US-Dollar	1.926.606	2.110.000	22. Feb. 24	Morgan Stanley	19.241
EUR						54.292
Euro	Norwegische Krone	1.718.430	20.550.000	12. Jan. 24	BNP Paribas	(113.474)
Euro	Pfund Sterling	3.291.327	2.869.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(16.003)
US-Dollar	Euro	174.000	158.225	22. Feb. 24	Morgan Stanley	(935)
EUR						(130.412)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	63	67	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	10.375	11.000	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	182
EUR						183
CHF						170
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	63	66	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	10.366	10.990	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	182
EUR						183
CHF						170
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	71	82	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	10.564	12.330	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(137)
EUR						(138)
GBP						(120)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	70	81	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	10.380	12.115	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(135)
EUR						(136)
GBP						(118)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	73	67	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	10.558	9.815	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(255)
EUR						(256)
USD						(283)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	73	66	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	10.549	9.806	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(254)
EUR						(255)
USD						(282)

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen			
Australischer Dollar - 28.590.403			
(31. Dezember 2022: 16.729.162)			
13.570.000	Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	7.543.137	1,55
7.198.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Nov-2033	4.515.404	0,93
5.780.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	3.798.478	0,78
2.600.000	Housing Australia 'MTN' 5.785% 08-Nov-2038	1.993.116	0,41
4.710.000	New South Wales Treasury Corp 4.250% 20-Feb-2036	3.053.427	0,63
570.000	New South Wales Treasury Corp 4.250% 20-Feb-2036	369.523	0,07
4.680.000	Queensland Treasury Corp '144A' 4.500% 22-Aug-2035	3.148.231	0,65
5.820.000	Queensland Treasury Corp '144A' 5.250% 21-Jul-2036	4.169.087	0,85
Kanadischer Dollar - 20.502.527			
(31. Dezember 2022: 24.382.250)			
11.380.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 0.950% 15-Jun-2025	8.193.235	1,68
6.150.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 3.800% 15-Jun-2027	4.672.139	0,96
8.443.013	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	7.637.153	1,57
Kolumbianischer Peso - 2.421.965			
(31. Dezember 2022: 4.929.019)			
10.952.900.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	2.421.965	0,50
Dänische Krone - 24.806.549			
(31. Dezember 2022: 12.910.791)			
63.100.000	Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029	8.564.171	1,76
109.390.000	Denmark Government Bond 2.250% 15-Nov-2033	16.242.378	3,33
Euro - 86.817.101			
(31. Dezember 2022: 57.687.019)			
6.806.233	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	7.417.036	1,52
4.270.000	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 1.625% 20-Jul-2027	4.577.979	0,94
1.260.000	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 1.625% 20-Jul-2027	1.350.600	0,28
3.550.000	European Union 0.450% 04-Jul-2041	2.588.066	0,53
7.100.000	FMS Wertmanagement 'EMTN' 0.375% 29-Apr-2030	6.896.608	1,41
3.191.562	French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-May-2045	3.711.972	0,76
5.870.000	Ireland Government Bond 1.100% 15-May-2029	6.154.665	1,26
4.530.000	Ireland Government Bond 2.000% 18-Feb-2045	4.366.769	0,90
5.680.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030	5.668.049	1,16
5.280.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	4.314.687	0,89
9.940.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	12.312.045	2,53
6.250.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 31-Jul-2035	6.045.446	1,24
2.170.000	Mexico Government International Bond 3.375% 23-Feb-2031	2.336.856	0,48
5.120.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	5.488.351	1,13
5.200.000	SNCF Reseau 'EMTN' 1.125% 25-May-2030	5.232.795	1,07
3.180.000	Spain Government Bond '144A' 1.900% 31-Oct-2052	2.451.017	0,50
4.765.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	5.904.160	1,21
Indische Rupie - 6.732.633			
(31. Dezember 2022: 1.916.405)			
213.850.000	International Bank for Reconstruction & Development 'EMTN' 6.000% 16-Jan-2025	2.547.941	0,52

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Indische Rupie Forts.			
350.340.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	4.184.692	0,86
Indonesische Rupiah - 14.370.268			
(31. Dezember 2022: 5.664.890)			
70.691.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	4.551.964	0,93
150.946.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	9.818.304	2,02
Japanischer Yen - 23.639.300			
(31. Dezember 2022: 20.546.130)			
2.067.350.000	Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	9.965.244	2,04
1.468.300.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	7.703.751	1,58
955.400.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Mar-2040	5.970.305	1,23
Malaysischer Ringgit - 7.181.856			
(31. Dezember 2022: 1.941.550)			
22.620.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	4.898.055	1,00
10.400.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	2.283.801	0,47
Mexikanischer neuer Peso - 6.937.387			
(31. Dezember 2022: 7.115.788)			
1.278.000.000	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	6.937.387	1,42
Neuseeländischer Dollar - 58.497.041			
(31. Dezember 2022: 37.106.425)			
6.820.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	4.205.814	0,86
4.430.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.420% 18-Oct-2028	2.668.610	0,55
13.667.000	New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	7.299.256	1,50
6.970.000	New Zealand Government Bond 1.750% 15-May-2041	2.904.037	0,59
11.500.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2025	7.067.604	1,45
2.530.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.500% 20-Sep-2040	1.995.052	0,41
3.576.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	3.067.821	0,63
5.690.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.000% 15-Apr-2037	2.517.218	0,52
7.640.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	4.782.236	0,98
19.090.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-May-2031	10.169.801	2,09
7.670.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.750% 15-Apr-2025	4.698.643	0,96
11.320.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4.500% 15-Apr-2027	7.120.949	1,46
Norwegische Krone - 9.808.927			
(31. Dezember 2022: 2.756.768)			
31.640.000	Norway Government Bond '144A' 1.375% 19-Aug-2030	2.768.083	0,57
73.320.000	Norway Government Bond '144A' 1.750% 13-Mar-2025	7.040.844	1,44
Peruanischer neuer Sol - 4.852.875			
(31. Dezember 2022: -)			
18.310.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	4.852.875	1,00
Pfund Sterling - 19.317.379			
(31. Dezember 2022: 11.676.560)			
1.790.000	Affordable Housing Finance Plc 'EMTN' 3.800% 20-May-2042	2.133.022	0,44
4.730.000	Council Of Europe Development Bank 0.750% 22-Jul-2027	5.406.500	1,11
3.296.727	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	4.261.156	0,87

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Pfund Sterling Forts.			
4.257.883	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	5.405.918	1,11
1.727.737	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.750% 22-Nov-2047	2.110.783	0,43
Schwedische Krone - 10.346.933			
(31. Dezember 2022: 7.779.508)			
55.610.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 12-May-2025	5.402.147	1,11
27.130.000	Sweden Inflation Linked Bond 3.500% 01-Dec-2028	4.944.786	1,01
Uruguayischer Peso - 3.467.558			
(31. Dezember 2022: -)			
145.628.496	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	3.467.558	0,71
US-Dollar - 147.555.326			
(31. Dezember 2022: 182.543.559)			
6.400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026	5.923.449	1,21
4.130.000	Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	3.979.357	0,82
3.630.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 6.387% 05-Aug-2026	3.684.245	0,76
2.900.000	Colombia Government International Bond 8.125% 21-May-2024	2.933.781	0,60
4.400.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' 3.875% 28-Oct-2041	4.090.658	0,84
3.948.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 5.593% 10-Feb-2026	3.943.878	0,81
3.186.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 5.693% 20-Mar-2028	3.169.853	0,65
3.328.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	3.083.947	0,63
3.032.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 6.421% 17-Jun-2026	3.076.551	0,63
4.980.000	Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024	4.779.163	0,98
2.620.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	2.780.475	0,57
10.680.000	Province of British Columbia Canada 2.250% 02-Jun-2026	10.172.592	2,09
2.031.000	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	1.997.093	0,41
2.609.000	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	2.565.443	0,53
4.950.000	Republic of Italy Government International Bond 1.250% 17-Feb-2026	4.581.337	0,94
3.640.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 5.528% 31-Jul-2025	3.635.232	0,74
9.101.092	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jan-2031	8.146.967	1,67
3.076.043	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15-Feb-2044	2.782.631	0,57
10.627.500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	10.233.641	2,10
9.550.000	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	6.342.916	1,30
14.980.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	13.893.365	2,85
10.980.000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	10.627.010	2,18
13.600.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	11.255.063	2,31
12.980.000	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	10.772.132	2,21
20.390.000	United States Treasury Strip Principal (Zero Coupon) 0.000% 15-May-2043	9.104.547	1,87
Gesamtanlagen in Anleihen		475.846.028	97,62

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Optionen auf Futures - 139.766			
(31. Dezember 2022: -)			
225	U.S. 10 Year Treasury Note Future Put 23-Feb-2024 111.000	123.047	0,03
107	U.S. Treasury Bond Future Put 23-Feb-2024 113.000	16.719	0,00

Optionen auf Futures insgesamt 139.766 0,03

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %

Offene Terminkontrakte - 1.787.205				
(31. Dezember 2022: 1.538.359)				
230	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	18.247.868	519.964	0,11
417	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	85.814.039	743.824	0,15
242	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	26.302.375	523.417	0,11

Offene Terminkontrakte insgesamt 1.787.205 0,37

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 9.533.527
(siehe unten) (31. Dezember 2022: 9.740.353) 9.533.527 1,95

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum
beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 487.306.526 99,97**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %

Offene Terminkontrakte - (1.881.824)				
(31. Dezember 2022: (92.838))				
(150)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(14.049.415)	(581.787)	(0,12)
(97)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(14.763.204)	(415.920)	(0,08)
(85)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(12.415.213)	(370.561)	(0,08)
(6)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(6.219.161)	(39.873)	(0,01)
(252)	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(18.312.095)	(175.607)	(0,04)
(84)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(9.482.813)	(298.076)	(0,06)

Offene Terminkontrakte insgesamt (1.881.824) (0,39)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (12.193.375)
(siehe unten) (31. Dezember 2022: (7.331.433)) (12.193.375) (2,50)

**Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum
beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (14.075.199) (2,89)**

Nettoumlaufvermögen 14.237.509 2,92

Summe Nettovermögen 487.468.836 100,00

Der Kontrahent für Optionen auf Futures 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	93,91
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,38
Außerbörbliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,88
Sonstiges Umlaufvermögen	3,83
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Global Bond Fund						
Australischer Dollar	US-Dollar	5.164.628	3.393.932	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	123.426
Australischer Dollar	US-Dollar	334.016	227.400	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	81
Australischer Dollar	US-Dollar	1.293.519	869.441	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	11.507
Australischer Dollar	US-Dollar	6.497.176	4.359.709	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	65.177
Australischer Dollar	US-Dollar	825.592	550.456	16. Feb. 24	UBS AG	11.811
Australischer Dollar	US-Dollar	6.683.329	4.456.497	16. Feb. 24	UBS AG	95.168
Australischer Dollar	US-Dollar	6.949.989	4.596.229	16. Feb. 24	UBS AG	137.044
Kanadischer Dollar	US-Dollar	6.208.197	4.580.899	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	105.839
Kanadischer Dollar	US-Dollar	4.141.039	3.026.448	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	99.736
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	13.862.795.411	3.451.092	16. Feb. 24	State Street Bank	93.944
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	1.903.632.437	459.482	16. Feb. 24	State Street Bank	27.321
Dänische Krone	US-Dollar	18.548.896	2.724.554	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	38.907
Euro	US-Dollar	4.303.471	4.713.958	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	61.862
Euro	US-Dollar	24.482.903	26.226.599	16. Feb. 24	State Street Bank	943.540
Euro	US-Dollar	173.769	188.281	16. Feb. 24	UBS AG	4.561
Euro	US-Dollar	512.061	560.680	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	7.585
Euro	US-Dollar	4.897.565	5.307.197	16. Feb. 24	State Street Bank	127.923
Euro	US-Dollar	6.688.808	7.320.385	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	102.584
Indonesische Rupiah	US-Dollar	32.656.979.297	2.089.041	16. Feb. 24	State Street Bank	23.147
Japanischer Yen	US-Dollar	545.125.909	3.850.180	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	28.724
Japanischer Yen	US-Dollar	3.559.947.880	23.975.183	16. Feb. 24	State Street Bank	1.356.021
Japanischer Yen	US-Dollar	8.616.467.804	58.029.331	16. Feb. 24	State Street Bank	3.282.102
Japanischer Yen	US-Dollar	708.639.392	4.856.626	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	185.776
Japanischer Yen	US-Dollar	119.356.344	829.528	16. Feb. 24	State Street Bank	19.766
Japanischer Yen	US-Dollar	133.987.320	901.071	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	52.331
Japanischer Yen	US-Dollar	320.073.721	2.181.015	16. Feb. 24	The Bank of New York Mellon	96.505
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	4.727.002	1.016.472	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	17.884
Mexikanischer Peso	US-Dollar	28.285.056	1.621.937	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	34.643
Mexikanischer Peso	US-Dollar	9.150.827	524.976	16. Feb. 24	State Street Bank	10.964
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.368.347	827.294	16. Feb. 24	State Street Bank	37.632
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	567.189	351.263	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	7.254
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	5.396.428	3.256.200	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	154.855
Norwegische Krone	US-Dollar	17.641.870	1.647.792	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	92.523
Peruanischer neuer Sol	US-Dollar	2.124.646	565.967	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	8.572
Pfund Sterling	US-Dollar	896.183	1.134.208	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	8.261
Pfund Sterling	US-Dollar	2.183.189	2.739.581	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	43.585
Pfund Sterling	US-Dollar	7.489.327	9.179.743	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	367.779
Schwedische Krone	US-Dollar	11.183.748	1.073.067	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	46.430
Schwedische Krone	US-Dollar	44.325.139	4.061.867	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	375.096
Schwedische Krone	US-Dollar	49.967.503	4.911.197	16. Feb. 24	UBS AG	90.568
US-Dollar	Australischer Dollar	677.324	993.820	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	485
USD						8.398.919
Koreanischer Won	US-Dollar	6.064.404.245	4.713.512	16. Feb. 24	State Street Bank	(36.164)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.205.212	1.831.538	16. Feb. 24	UBS AG	(42.152)
US-Dollar	Australischer Dollar	1.015.920	1.497.566	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(3.994)
US-Dollar	Australischer Dollar	218.326	329.296	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(5.941)
US-Dollar	Australischer Dollar	481.756	717.071	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(6.604)
Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum	Kontrahent		Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Australischer Dollar	19.526.380	30.283.787	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.098.322)
US-Dollar	Australischer Dollar	944.638	1.467.033	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(54.481)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	425.451	567.000	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.593)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	621.874	850.287	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(20.030)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	24.660.745	33.950.202	16. Feb. 24	State Street Bank	(969.192)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	2.722.315	11.283.452.393	16. Feb. 24	State Street Bank	(163.123)
US-Dollar	Dänische Krone	833.532	5.664.284	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(10.347)
US-Dollar	Dänische Krone	275.924	1.879.633	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(4.109)
US-Dollar	Dänische Krone	20.192.539	140.447.226	16. Feb. 24	UBS AG	(731.642)
US-Dollar	Dänische Krone	3.170.119	21.837.414	16. Feb. 24	UBS AG	(83.274)
US-Dollar	Dänische Krone	489.342	3.334.025	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(7.369)
US-Dollar	Dänische Krone	620.884	4.245.233	16. Feb. 24	State Street Bank	(11.581)
US-Dollar	Euro	2.281.679	2.074.082	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(20.053)
US-Dollar	Euro	10.881.370	9.907.989	16. Feb. 24	The Bank of New York Mellon	(114.117)
US-Dollar	Euro	864.048	782.830	16. Feb. 24	State Street Bank	(4.705)
US-Dollar	Euro	218.067	201.679	16. Feb. 24	UBS AG	(5.749)
US-Dollar	Euro	307.645	279.819	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.886)
US-Dollar	Euro	842.886	774.712	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(16.858)
US-Dollar	Euro	5.109.460	4.765.977	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(179.629)
US-Dollar	Euro	4.593.150	4.198.138	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(65.774)
US-Dollar	Euro	3.211.979	2.921.343	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(30.010)
US-Dollar	Indische Rupie	6.835.569	570.927.230	16. Feb. 24	State Street Bank	(18.507)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	10.172.768	159.585.290.305	16. Feb. 24	State Street Bank	(148.890)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	745.264	11.543.340.996	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.336)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	873.010	13.514.096.295	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.055)
US-Dollar	Japanischer Yen	725.929	103.159.176	16. Feb. 24	State Street Bank	(8.112)
US-Dollar	Japanischer Yen	4.503.473	643.764.285	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(77.304)
US-Dollar	Japanischer Yen	749.862	105.549.351	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.186)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.582.763	230.759.785	16. Feb. 24	The Bank of New York Mellon	(59.233)
US-Dollar	Japanischer Yen	893.376	126.093.676	16. Feb. 24	State Street Bank	(3.857)
US-Dollar	Japanischer Yen	605.517	86.470.181	16. Feb. 24	State Street Bank	(9.771)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.240.020	180.762.805	16. Feb. 24	UBS AG	(46.218)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.547.421	224.726.939	16. Feb. 24	State Street Bank	(51.649)
US-Dollar	Japanischer Yen	3.694.031	547.269.100	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(200.123)
US-Dollar	Japanischer Yen	10.388.995	1.513.340.848	16. Feb. 24	State Street Bank	(379.350)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	7.863.918	36.514.528	16. Feb. 24	State Street Bank	(126.142)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	448.539	8.005.845	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(20.342)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.202.034	20.962.988	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(25.713)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	537.744	894.867	16. Feb. 24	State Street Bank	(27.896)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	4.417.241	7.186.207	16. Feb. 24	State Street Bank	(125.124)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	518.895	825.148	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(2.677)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	598.947	960.753	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(8.340)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	52.155.209	87.990.324	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.463.024)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	918.566	1.544.728	16. Feb. 24	State Street Bank	(57.848)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	905.961	1.458.778	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(16.125)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	372.212	598.877	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(6.335)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	3.834.768	6.243.527	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(111.733)
US-Dollar	Norwegische Krone	10.526.158	117.898.489	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.104.160)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	782.356	2.937.905	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(12.102)
US-Dollar	Pfund Sterling	3601.38	289.327	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(8.701)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.403.758	1.107.831	16. Feb. 24	State Street Bank	(8.523)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.281.291	1.021.796	16. Feb. 24	UBS AG	(21.312)
US-Dollar	Pfund Sterling	15.359.401	12.535.442	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(620.995)

Aufstellung der Wertpapierbeständee zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Schwedische Krone	18.620.851	203.176.308	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.717.172)
USD						(12.181.554)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged)						
Australischer Dollar	US-Dollar	65	45	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	74	51	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	62	42	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	226	152	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Australischer Dollar	US-Dollar	10.374	6.814	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	243
USD						245
AUD						360
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.465	4.945	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	4.216	4.623	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
Euro	US-Dollar	15.921	17.527	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	117
Euro	US-Dollar	727.766	783.321	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23.175
USD						23.344
EUR						21.074
Euro	US-Dollar	5.090	5.659	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(19)
USD						(19)
EUR						(17)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	871	965	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	833	913	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	3.105	3.418	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23
Euro	US-Dollar	141.667	152.481	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.511
USD						4.545
EUR						4.103
Euro	US-Dollar	1.005	1.117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
USD						(4)
EUR						(4)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.814	2.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	1.736	1.904	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	7.086	7.800	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
Euro	US-Dollar	323.037	347.696	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.287
USD						10.360
EUR						9.353

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	2.102	2.337	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	31.717	28.976	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(394)
USD						(402)
EUR						(363)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR Z (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	62	69	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	72	80	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	59	65	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	220	243	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.049	10.816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	320
USD						323
EUR						292
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	51	64	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	15	12	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	19.282	24.569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Pfund Sterling	US-Dollar	12	15	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	5	6	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	18.466	23.379	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	157
Pfund Sterling	US-Dollar	8	10	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	3.046.547	3.823.903	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	59.155
US-Dollar	Pfund Sterling	64	51	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	26	21	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						59.320
GBP						46.544
Pfund Sterling	US-Dollar	22.423	28.697	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(117)
Pfund Sterling	US-Dollar	67.307	85.949	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(161)
US-Dollar	Pfund Sterling	551	435	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	524	417	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
USD						(289)
GBP						(227)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	6.676	8.506	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Pfund Sterling	US-Dollar	25.725	32.765	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23
Pfund Sterling	US-Dollar	19.875	25.176	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	156
Pfund Sterling	US-Dollar	6.035	7.641	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	51
Pfund Sterling	US-Dollar	34.895	44.169	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	307
Pfund Sterling	US-Dollar	95.992	120.308	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.041

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	902.661	1.132.983	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.527
USD						20.108
GBP						15.777
US-Dollar	Pfund Sterling	32.761	25.725	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(25)
Pfund Sterling	US-Dollar	7.534	9.642	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(39)
Pfund Sterling	US-Dollar	21.631	27.621	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.917	5.467	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(51)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.173	4.858	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.068	7.931	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.005	4.775	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(82)
USD						(308)
GBP						(242)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	22.566	28.738	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22
US-Dollar	Pfund Sterling	211.052	165.000	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	758
Pfund Sterling	US-Dollar	328.874	419.040	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	135
Pfund Sterling	US-Dollar	11.480	14.622	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Pfund Sterling	US-Dollar	48.404	61.653	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	41
Pfund Sterling	US-Dollar	5.333	6.747	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	50
Pfund Sterling	US-Dollar	315.351	399.262	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.677
Pfund Sterling	US-Dollar	7125	9.053	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	28
Pfund Sterling	US-Dollar	12.715	16.094	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	112
Pfund Sterling	US-Dollar	23.395	29.701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	118
Pfund Sterling	US-Dollar	48.928	61.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.040
Pfund Sterling	US-Dollar	14	18	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	52.084.422	65.374.262	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.011.332
US-Dollar	Pfund Sterling	17.781	13.919	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	40
USD						1.016.363
GBP						797.460
US-Dollar	Pfund Sterling	14.620	11.480	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
Pfund Sterling	US-Dollar	165.000	211.064	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(759)
Pfund Sterling	US-Dollar	383.216	490.443	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.005)
Pfund Sterling	US-Dollar	69.929	89.331	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(201)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.147.217	1.464.955	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.739)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.742	22.566	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(20)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.907	3.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.483	18.538	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(146)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.534	6.745	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Pfund Sterling	77.437	60.942	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(239)
US-Dollar	Pfund Sterling	11.497	9.083	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.730	3.726	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Pfund Sterling	98.974	78.970	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.679)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	141.002	112.130	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.917)
US-Dollar	Pfund Sterling	75.675	60.092	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(918)
USD						(10.799)
GBP						(8.473)

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 26.247.550			
(31. Dezember 2022: –)			
197.336	iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF	26.247.550	2,52
Niederlande - 789.838			
(31. Dezember 2022: –)			
182.003	iShares USD Corp Bond ESG UCITS ETF	789.838	0,08
Vereinigtes Königreich - 50.305.161			
(31. Dezember 2022: –)			
163.529	iShares EUR Corp Bond ESG UCITS ETF	850.106	0,08
473.526	iShares USD Corp Bond UCITS ETF	49.455.055	4,76
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		77.342.549	7,44
Anleihen			
Australien - 9.059.105			
(31. Dezember 2022: 13.981.295)			
1.069.186	Metro Finance 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 5.864% 20-Jun-2027	724.642	0,07
927.569	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 6.352% 22-Jan-2053	630.147	0,06
1.114.137	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 6.098% 15-Jan-2063	751.694	0,07
562.668	RESIMAC Premier Series 2020-1 '2020-1X C' FRN 7.195% 07-Feb-2052	383.863	0,04
1.227.478	Ruby Bond Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 5.804% 12-Mar-2053	828.692	0,08
1.423.000	Santos Finance Ltd 'EMTN' 5.250% 13-Mar-2029	1.393.878	0,13
771.630	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 6.298% 15-Jun-2052	525.497	0,05
3.285.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 4.375% 03-May-2033	3.820.692	0,37
Österreich - 4.615.608			
(31. Dezember 2022: 4.204.879)			
400.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0.050% 01-Sep-2027	385.665	0,04
1.200.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 5.750% 27-Jan-2028	1.417.041	0,14
1.300.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	1.295.891	0,12
1.300.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	1.517.011	0,14
Belgien - 9.363.121			
(31. Dezember 2022: 2.558.942)			
5.200.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 3.875% 18-Mar-2031	5.957.275	0,57
3.000.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 4.250% 28-Nov-2029	3.405.846	0,33
Bermudas - 1.743.260			
(31. Dezember 2022: –)			
1.528.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	1.743.260	0,17
Kanada - 21.805.403			
(31. Dezember 2022: 3.121.471)			
5.000.000	Bank of Nova Scotia/The 5.650% 01-Feb-2034	5.197.894	0,50
20.000	Canadian Government Bond 2.000% 01-Dec-2051	12.158	–
6.215.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 5.001% 28-Apr-2028	6.260.727	0,60
3.178.000	Canadian Pacific Railway Co 3.100% 02-Dec-2051	2.309.942	0,22
2.690.000	Enbridge Inc 5.700% 08-Mar-2033	2.802.812	0,27
2.367.000	GFL Environmental Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2031	2.442.091	0,24
59.000	Rogers Communications Inc 3.800% 15-Mar-2032	54.374	0,01
3.112.000	Rogers Communications Inc 4.550% 15-Mar-2052	2.725.405	0,26
Chile - 1.254.723			
(31. Dezember 2022: 671.816)			
1.418.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	1.254.723	0,12

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Dänemark - 7.353.404			
(31. Dezember 2022: –)			
5.310.000	Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 4.250% 05-Oct-2033	6.236.761	0,60
1.150.000	Orsted AS FRN 1.750% 09-Dec-3019	1.116.643	0,11
Finnland - 6.943.561			
(31. Dezember 2022: –)			
5.917.000	Fortum Oyj 'EMTN' 4.500% 26-May-2033	6.943.561	0,67
Frankreich - 80.752.663			
(31. Dezember 2022: 21.091.130)			
1.400.000	ALD SA 'EMTN' 4.875% 06-Oct-2028	1.636.245	0,16
3.600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.750% 10-Nov-2031	4.214.899	0,40
5.300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 3.625% 01-Sep-2029	5.871.970	0,56
9.095.000	BPCE SA 'REGS' FRN 7.003% 19-Oct-2034	9.898.332	0,95
3.100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.375% 27-Nov-2033	3.593.204	0,35
6.100.000	Danone SA 'EMTN' 3.706% 13-Nov-2029	7.024.368	0,68
2.500.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.625% 25-Jan-2043	2.907.515	0,28
1.200.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	1.432.669	0,14
1.764.000	Electricite de France SA 'REGS' 6.900% 23-May-2053	2.005.211	0,19
5.000.000	Kering SA 'EMTN' 3.625% 05-Sep-2031	5.712.445	0,55
1.500.000	Kering SA 'EMTN' 3.875% 05-Sep-2035	1.741.293	0,17
2.500.000	Kering SA 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2032	3.332.224	0,32
2.700.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 5.500% 05-Mar-2034	3.119.028	0,30
800.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	856.627	0,08
5.100.000	Orano SA 'EMTN' 5.375% 15-May-2027	5.889.949	0,57
4.600.000	Pernod Ricard SA 'EMTN' 3.750% 15-Sep-2033	5.291.175	0,51
2.656.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 02-Oct-2029	3.087.185	0,30
2.100.000	Sogecap SA FRN 6.500% 16-May-2044	2.518.179	0,24
2.500.000	Suez SACA 'EMTN' 2.375% 24-May-2030	2.604.707	0,25
2.100.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	2.478.246	0,24
600.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	733.661	0,07
500.000	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc '144A' 4.750% 17-Sep-2044	359.215	0,03
1.447.000	WEA Finance LLC '144A' 3.500% 15-Jun-2029	1.233.194	0,12
1.562.000	WEA Finance LLC '144A' 4.125% 20-Sep-2028	1.394.015	0,13
2.678.000	WEA Finance LLC '144A' 4.625% 20-Sep-2048	1.817.107	0,17
Deutschland - 47.300.329			
(31. Dezember 2022: 19.597.548)			
419.324	Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025	444.095	0,04
9.165.769	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.700% 15-Aug-2032	9.918.306	0,95
576.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.625% 06-Nov-2030	590.100	0,06
1.740.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.875% 24-May-2030	1.816.563	0,18
2.830.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 2.750% 19-Mar-2029	3.135.483	0,30
1.476.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 3.250% 19-May-2033	1.681.403	0,16
1.127.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 4.000% 23-Nov-2043	1.357.370	0,13
4.000.000	Deutsche Boerse AG 3.875% 28-Sep-2033	4.696.336	0,45
4.300.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	4.467.617	0,43
800.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.875% 17-Jan-2029	772.379	0,08
1.200.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	1.381.678	0,13
4.400.000	Sartorius Finance BV 4.875% 14-Sep-2035	5.127.913	0,49
3.700.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	4.260.246	0,41
1.600.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	1.468.046	0,14
1.400.000	Vonovia SE 1.000% 16-Jun-2033	1.179.320	0,11
1.300.000	Vonovia SE 1.875% 28-Jun-2028	1.328.364	0,13
2.500.000	Vonovia SE 'EMTN' 0.625% 14-Dec-2029	2.281.618	0,22
1.100.000	Vonovia SE 'EMTN' 0.750% 01-Sep-2032	926.077	0,09
400.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	467.415	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Griechenland - 5.109.539			
(31. Dezember 2022: -)			
4.406.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	5.109.539	0,49
Ungarn - 515.888			
(31. Dezember 2022: -)			
460.000	Hungary Government International Bond 'REGS' 6.750% 25-Sep-2052	515.888	0,05
Irland - 14.953.802			
(31. Dezember 2022: 13.364.044)			
613.029	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 6.500% 02-May-2030	776.335	0,07
526.024	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 7.250% 02-May-2030	658.040	0,06
160.195	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 6.876% 24-Feb-2058	175.656	0,02
275.942	Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 5.594% 17-Aug-2031	289.285	0,03
1.031.000	Mulcair Securities No 3 DAC FRN 5.719% 24-Apr-2065	1.128.731	0,11
2.725.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	2.846.275	0,27
1.929.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	2.249.854	0,22
40.248	Retiro Mortgage Securities DAC FRN 5.000% 30-Jul-2075	44.381	-
838.000	Richmond Park CLO 1 DAC FRN 5.465% 14-Jul-2031	920.439	0,09
325.608	Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 6.871% 17-May-2031	403.600	0,04
594.804	Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 5.716% 22-Dec-2030	627.151	0,06
1.546.960	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 6.971% 17-Aug-2031	1.898.506	0,18
348.000	Toro European CLO 4 DAC FRN 6.065% 15-Jul-2030	383.676	0,04
2.100.999	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 6.420% 22-Jul-2029	2.551.873	0,25
Italien - 23.278.465			
(31. Dezember 2022: 10.129.061)			
2.054.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.000% 04-Dec-2028	2.087.258	0,20
2.450.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.875% 26-Sep-2029	2.411.867	0,23
1.027.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	1.170.853	0,11
3.233.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	3.745.529	0,36
4.019.000	CA Auto Bank SPA/Ireland 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2024	4.328.097	0,42
5.316.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	6.021.183	0,58
3.100.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	3.513.678	0,34
Japan - 2.497.496			
(31. Dezember 2022: 1.794.960)			
60.950.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040	379.162	0,04
1.814.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 'EMTN' FRN 4.636% 07-Jun-2031	2.118.334	0,20
Luxemburg - 11.006.203			
(31. Dezember 2022: 2.244.832)			
2.602.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	2.226.607	0,21
978.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 17-Jan-2030	925.194	0,09
161.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 2.000% 17-Jan-2034	139.585	0,01
2.825.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	2.971.354	0,29
3.546.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	3.451.751	0,33
1.168.000	SELP Finance Sarl 'EMTN' 3.750% 10-Aug-2027	1.291.712	0,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Niederlande - 24.634.916			
(31. Dezember 2022: 17.579.642)			
1.266.000	ASR Nederland NV 3.625% 12-Dec-2028	1.416.608	0,14
1.065.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	1.328.431	0,13
4.858.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	4.785.128	0,46
601.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	637.367	0,06
5.058.000	ING Groep NV FRN 6.114% 11-Sep-2034	5.318.781	0,51
6.048.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 4.500% 23-Jan-2034	7.018.604	0,67
3.758.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	4.129.997	0,40
Polen - 3.964.576			
(31. Dezember 2022: -)			
3.400.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	3.964.576	0,38
Portugal - 2.696.381			
(31. Dezember 2022: 597.594)			
2.200.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	2.696.381	0,26
Rumänien - 3.079.345			
(31. Dezember 2022: 2.537.557)			
635.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	568.662	0,05
1.413.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.000% 28-Jan-2032	1.210.172	0,11
700.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	712.495	0,07
504.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Sep-2033	588.016	0,06
Spanien - 30.271.071			
(31. Dezember 2022: 4.953.182)			
1.500.000	Aena SME SA 'EMTN' 4.250% 13-Oct-2030	1.761.490	0,17
5.200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	5.332.101	0,51
2.300.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	2.667.360	0,26
8.200.000	Banco Santander SA FRN 1.722% 14-Sep-2027	7.424.382	0,71
1.300.000	CaixaBank SA 'EMTN' 4.375% 29-Nov-2033	1.507.430	0,15
300.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 0.750% 15-Nov-2026	307.247	0,03
3.400.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Sep-2032	3.220.266	0,31
100.000	Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029	100.990	0,01
4.900.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	4.757.445	0,46
1.900.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	2.014.810	0,19
1.215.000	Telefonica Emisiones SA 5.520% 01-Mar-2049	1.177.550	0,11
Supranational - 44.666.133			
(31. Dezember 2022: 3.650.386)			
4.300.000	European Financial Stability Facility 0.000% 13-Oct-2027	4.338.400	0,42
1.373.000	European Financial Stability Facility 2.750% 17-Aug-2026	1.525.464	0,15
2.992.000	European Investment Bank 0.000% 17-Jun-2027	3.045.797	0,29
2.882.000	European Investment Bank 0.000% 28-Mar-2028	2.879.709	0,28
5.556.000	European Investment Bank 0.375% 15-Sep-2027	5.706.161	0,55
69.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 13-Nov-2026	74.162	0,01
1.007.549	European Stability Mechanism 0.000% 15-Dec-2026	1.036.787	0,10
6.500.000	European Union 0.000% 02-Jun-2028	6.477.401	0,62
5.125.211	European Union 2.000% 04-Oct-2027	5.575.544	0,53
2.306.667	European Union 2.750% 05-Oct-2026	2.566.422	0,25
169.285	European Union 2.750% 04-Feb-2033	189.363	0,02
2.865.822	European Union 3.375% 04-Nov-2042	2.866.534	0,27
4.206.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.000% 21-Feb-2030	3.997.834	0,38
4.400.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.010% 24-Apr-2028	4.386.555	0,42
Schweiz - 13.067.379			
(31. Dezember 2022: 6.210.213)			
765.000	Swiss Confederation Government Bond 0.500% 27-Jun-2032	896.418	0,09
200.000	UBS Group AG 0.875% 03-Nov-2031	178.659	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Schweiz Forts.			
2.173.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	2.195.191	0,21
2.194.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 4.750% 17-Mar-2032	2.553.779	0,24
1.174.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	1.213.070	0,12
4.738.000	UBS Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	6.030.262	0,58
Thailand - 2.731.898			
(31. Dezember 2022: 637.904)		2.731.898	0,26
3.000.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	2.731.898	0,26
Vereinigtes Königreich - 95.586.828			
(31. Dezember 2022: 29.277.358)		95.586.828	9,19
2.628.000	AA Bond Co Ltd 5.500% 31-Jul-2027	3.186.889	0,31
2.602.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 8.450% 31-Jan-2028	3.485.857	0,33
632.586	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 5.579% 17-Mar-2039	755.044	0,07
5.031.000	Astrazeneca Finance LLC 1.200% 28-May-2026	4.658.813	0,45
620.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 6.720% 25-Jul-2058	790.585	0,08
1.356.000	Barclays Plc FRN 7.437% 02-Nov-2033	1.521.976	0,15
2.000.000	BNI Finance BV 3.875% 01-Dec-2030	2.305.269	0,22
6.479.000	BNI Finance BV 3.875% 01-Dec-2030	7.467.918	0,72
526.000	Canada Square Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 6.820% 17-Jun-2058	664.545	0,06
1.840.000	CPUK Finance Ltd 6.136% 28-Aug-2031	2.439.782	0,23
5.750.000	Diageo Finance Plc 'EMTN' 2.500% 27-Mar-2032	6.107.742	0,59
635.000	Direct Line Insurance Group Plc FRN (Perpetual) 4.750% 07-Dec-2027	635.576	0,06
787.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	797.611	0,08
3.860.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	4.521.375	0,43
2.233.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	2.555.455	0,25
5.140.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	5.887.402	0,57
1.900.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	2.178.749	0,21
496.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	564.383	0,05
3.465.000	National Grid Plc 'EMTN' 3.245% 30-Mar-2034	3.647.651	0,35
200.000	NatWest Markets Plc '144A' 0.800% 12-Aug-2024	194.186	0,02
678.000	Newday Funding Master Issuer PLC - Series 2021-2 6.847% 15-Jul-2029	861.173	0,08
2.200.000	Northumbrian Water Finance Plc 'EMTN' 4.500% 14-Feb-2031	2.709.533	0,26
2.584.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4.870% 06-May-2026	3.201.804	0,31
722.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 8.250% 06-Nov-2028	991.087	0,10
3.042.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 'EMTN' 3.875% 14-Sep-2033	3.558.719	0,34
378.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 7.600% 23-Jan-2029	460.379	0,04
6.380.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 7.018% 08-Feb-2030	6.746.823	0,65
1.348.000	SW Finance I Plc 7.375% 12-Dec-2041	1.843.076	0,18
766.000	Thames Water Utilities Finance Plc 8.250% 25-Apr-2040	1.098.328	0,11
770.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 1.250% 31-Jan-2032	641.813	0,06
631.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	659.554	0,06
642.997	Tower Bridge Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 6.720% 20-Nov-2063	810.614	0,08
3.788.000	Unilever Capital Corp 'EMTN' 3.400% 06-Jun-2033	4.316.986	0,41
5.950.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 1.250% 28-Feb-2031	5.881.479	0,57
1.750.000	United Kingdom Gilt 1.250% 22-Oct-2041	1.448.800	0,14
1.110.000	United Kingdom Gilt 1.250% 31-Jul-2051	755.183	0,07
448.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	439.658	0,04
2.614.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 7.625% 23-Aug-2029	3.546.544	0,34
1.180.000	Wessex Water Services Finance Plc 1.500% 17-Sep-2029	1.248.467	0,12

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika - 434.645.346			
(31. Dezember 2022: 198.334.194)		434.645.346	41,79
2.870.000	3M Co 'MTN' 1.500% 02-Jun-2031	2.699.631	0,26
1.438.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.375% 15-Aug-2031	1.299.035	0,13
2.734.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 4.700% 01-Jul-2030	2.673.295	0,26
92.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 5.150% 15-Apr-2053	89.268	0,01
2.258.000	American Tower Corp 2.100% 15-Jun-2030	1.898.965	0,18
2.500.000	American Tower Corp 2.900% 15-Jan-2030	2.230.453	0,21
200.000	AT&T Inc 3.500% 01-Jun-2041	159.487	0,02
2.780.000	AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032	3.088.022	0,30
2.500.000	AT&T Inc 3.550% 15-Sep-2055	1.809.172	0,17
2.500.000	AT&T Inc 3.950% 30-Apr-2031	2.869.511	0,28
2.727.000	AutoZone Inc 6.550% 01-Nov-2033	3.035.265	0,29
188.000	Avangrid Inc 3.800% 01-Jun-2029	188.743	0,02
1.500.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.654% 26-Oct-2031	1.359.771	0,13
3.760.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.694% 22-Mar-2031	3.480.058	0,33
500.000	Bank of America Corp FRN 4.571% 27-Apr-2033	478.051	0,05
3.015.000	Bank of America Corp FRN 5.872% 15-Sep-2034	3.165.839	0,30
1.047.000	Bristol-Myers Squibb Co 6.250% 15-Nov-2053	1.204.072	0,12
1.102.000	Bristol-Myers Squibb Co 6.400% 15-Nov-2063	1.283.542	0,12
4.620.000	Capital One Financial Corp FRN 7.624% 30-Oct-2031	5.088.568	0,49
634.000	Carrier Global Corp '144A' 5.900% 15-Mar-2034	687.618	0,07
470.000	Carrier Global Corp '144A' 6.200% 15-Mar-2054	546.540	0,05
920.000	Carrier Global Corp 'REGS' 4.125% 29-May-2028	1.047.033	0,10
963.000	Carrier Global Corp 'REGS' 4.500% 29-Nov-2032	1.137.782	0,11
4.000.000	CenterPoint Energy Resources Corp 5.400% 01-Mar-2033	4.185.421	0,40
3.867.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.700% 01-Apr-2051	2.528.851	0,24
1.760.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.800% 01-Mar-2050	1.366.363	0,13
750.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.250% 01-Apr-2053	631.922	0,06
2.400.000	Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024	2.566.012	0,25
8.460.000	Citigroup Inc FRN 2.572% 03-Jun-2031	7.241.321	0,70
600.000	Citigroup Inc FRN 6.270% 17-Nov-2033	643.415	0,06
6.731.000	Columbia Pipelines Operating Co LLC '144A' 5.927% 15-Aug-2030	6.974.583	0,67
1.811.000	Columbia Pipelines Operating Co LLC '144A' 6.036% 15-Nov-2033	1.900.568	0,18
836.000	Columbia Pipelines Operating Co LLC '144A' 6.544% 15-Nov-2053	925.710	0,09
180.000	Comcast Corp 4.800% 15-May-2033	182.678	0,02
100.000	Commonwealth Edison Co 4.000% 01-Mar-2049	84.636	0,01
652.000	Commonwealth Edison Co 5.300% 01-Feb-2053	666.662	0,06
1.796.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 15-Mar-2034	1.889.321	0,18
2.227.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.900% 15-Nov-2053	2.463.981	0,24
7.182.000	Corebridge Financial Inc 5.750% 15-Jan-2034	7.382.079	0,71
876.000	Crown Castle Inc 3.650% 01-Sep-2027	834.173	0,08
2.700.000	Crown Castle Inc 3.800% 15-Feb-2028	2.567.669	0,25
3.044.000	CVS Health Corp 3.250% 15-Aug-2029	2.839.585	0,27
80.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	78.786	0,01
2.370.000	CVS Health Corp 5.050% 25-Mar-2048	2.228.985	0,21
455.000	Duke Energy Indiana LLC 5.400% 01-Apr-2053	466.258	0,04
3.500.000	Energy Transfer LP 4.400% 15-Mar-2027	3.426.463	0,33
5.000.000	Energy Transfer LP 5.250% 15-Apr-2029	5.046.876	0,49
1.065.000	Energy Transfer LP 6.400% 01-Dec-2030	1.139.890	0,11
3.472.000	Energy Transfer LP 6.550% 01-Dec-2033	3.773.109	0,36
4.100.000	Entergy Corp 2.400% 15-Jun-2031	3.439.837	0,33
5.467.000	Eversource Energy 5.950% 01-Feb-2029	5.733.451	0,55
2.400.000	Exelon Corp 4.100% 15-Mar-2052	1.954.884	0,19
3.820.000	Exelon Corp 5.600% 15-Mar-2053	3.885.612	0,37
1.453.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350% 06-Mar-2030	1.564.596	0,15
4.500.000	Gilead Sciences Inc 3.500% 01-Feb-2025	4.429.934	0,43

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
2.508.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.992% 27-Jan-2032	2.031.023	0,20	
5.000.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.615% 22-Apr-2032	4.206.039	0,40	
7.307.000	Intercontinental Exchange Inc 2.100% 15-Jun-2030	6.290.823	0,61	
1.166.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 5.450% 15-Aug-2030	1.177.674	0,11	
413.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 5.500% 15-Aug-2033	414.249	0,04	
2.073.000	J M Smucker Co/The 6.200% 15-Nov-2033	2.266.854	0,22	
5.135.000	J M Smucker Co/The 6.500% 15-Nov-2053	5.956.977	0,57	
5.400.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 4.457% 13-Nov-2031	6.294.033	0,61	
829.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	842.142	0,08	
4.200.000	Linde Plc 3.625% 12-Jun-2034	4.855.275	0,47	
3.000.000	Linde Plc 'EMTN' 1.375% 31-Mar-2031	2.991.199	0,29	
3.274.000	Merck & Co Inc 0.500% 02-Nov-2024	3.516.655	0,34	
830.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031	726.736	0,07	
2.280.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 1.928% 28-Apr-2032	1.838.346	0,18	
4.500.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 3.622% 01-Apr-2031	4.150.294	0,40	
1.770.000	Nasdaq Inc 5.550% 15-Feb-2034	1.843.610	0,18	
137.000	Nasdaq Inc 5.950% 15-Aug-2053	148.010	0,01	
1.872.000	Nasdaq Inc 6.100% 28-Jun-2063	2.035.244	0,20	
414.000	NiSource Inc 5.000% 15-Jun-2052	390.002	0,04	
1.442.000	NiSource Inc 5.400% 30-Jun-2033	1.490.684	0,14	
825.000	Norfolk Southern Corp 5.550% 15-Mar-2034	873.494	0,08	
1.148.000	Norfolk Southern Corp 5.950% 15-Mar-2064	1.288.381	0,12	
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 3.700% 15-May-2050	81.441	0,01	
3.590.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 4.550% 15-Sep-2032	3.565.404	0,34	
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 4.600% 01-Jun-2052	93.969	0,01	
1.340.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	1.374.419	0,13	
6.689.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.340% 19-May-2063	6.790.203	0,65	
3.020.000	Piedmont Natural Gas Co Inc 5.400% 15-Jun-2033	3.113.426	0,30	
3.900.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 5.939% 18-Aug-2034	4.064.961	0,39	
1.435.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.037% 28-Oct-2033	1.502.726	0,14	
1.025.000	Public Service Enterprise Group Inc 6.125% 15-Oct-2033	1.104.851	0,11	
1.581.000	Realty Income Corp 4.875% 06-Jul-2030	1.850.601	0,18	
1.313.000	Realty Income Corp 5.125% 06-Jul-2034	1.601.103	0,15	
320.000	Regency Centers LP 2.950% 15-Sep-2029	287.586	0,03	
897.000	Regency Centers LP 3.700% 15-Jun-2030	835.638	0,08	
200.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.607% 13-Dec-2051	135.553	0,01	
5.175.000	Ryder System Inc 6.600% 01-Dec-2033	5.751.027	0,55	
2.300.000	Starbucks Corp 3.800% 15-Aug-2025	2.259.035	0,22	
1.999.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.250% 16-Jun-2031	2.293.082	0,22	
2.972.000	Tapestry Inc 7.700% 27-Nov-2030	3.135.923	0,30	
1.239.000	Tapestry Inc 7.850% 27-Nov-2033	1.325.502	0,13	
1.146.000	Targa Resources Corp 6.125% 15-Mar-2033	1.209.900	0,12	
3.630.000	Targa Resources Corp 6.500% 30-Mar-2034	3.931.471	0,38	
2.677.000	Texas Instruments Inc 5.050% 18-May-2063	2.759.834	0,27	
167.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.750% 12-Sep-2024	180.351	0,02	
3.020.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	2.867.074	0,28	
2.100.000	Travelers Cos Inc/The 3.050% 08-Jun-2051	1.552.302	0,15	
1.224.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.122% 26-Jan-2034	1.190.758	0,11	
2.654.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.867% 08-Jun-2034	2.714.664	0,26	
1.488.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	1.548.379	0,15	
804.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 7.161% 30-Oct-2029	869.834	0,08	
2.505.400	United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025	2.327.624	0,22	
7.742.900	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	5.013.377	0,48	
6.675.000	United States Treasury Note/Bond 1.250% 30-Nov-2026	6.175.157	0,59	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
7.670.400	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	7.600.410	0,73	
11.464.400	United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028	10.970.222	1,05	
26.385.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-Aug-2028	25.279.097	2,43	
3.552.700	United States Treasury Note/Bond 3.250% 30-Jun-2027	3.474.360	0,33	
40.551.900	United States Treasury Note/Bond 3.500% 31-Jan-2028	39.948.374	3,84	
1.840.000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 31-Oct-2027	1.853.153	0,18	
24.000.000	United States Treasury Note/Bond 4.500% 15-Nov-2033	25.250.624	2,43	
40.570.000	United States Treasury Note/Bond 4.750% 15-Nov-2043	43.682.478	4,20	
100.000	UnitedHealth Group Inc 5.875% 15-Feb-2053	113.770	0,01	
1.581.000	US Bancorp FRN 5.836% 12-Jun-2034	1.634.696	0,16	
1.600.000	US Bancorp FRN 5.850% 21-Oct-2033	1.652.901	0,16	
2.720.000	Verizon Communications Inc 4.250% 31-Oct-2030	3.188.615	0,31	
880.000	Verizon Communications Inc 4.272% 15-Jan-2036	831.392	0,08	
2.500.000	Warnermedia Holdings Inc 5.050% 15-Mar-2042	2.213.370	0,21	
2.205.000	Warnermedia Holdings Inc 5.141% 15-Mar-2052	1.903.911	0,18	
4.840.000	Wells Fargo & Co FRN 5.389% 24-Apr-2034	4.872.404	0,47	
3.530.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 5.557% 25-Jul-2034	3.603.352	0,35	
950.000	WPC Eurobond BV 0.950% 01-Jun-2030	873.946	0,08	
Gesamtanlagen in Anleihen		902.896.443	86,81	
Total Return Swaps				
Europa - 2.378.590 (31. Dezember 2022: -)		2.378.590	0,23	
400.000	iBoxx EUR Corporates Index 20-Mar-2024	2.176	0,00	
17.300.000	iBoxx EUR Corporates Index 20-Mar-2024	94.094	0,01	
4.100.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	85.379	0,01	
105.500.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	2.196.941	0,21	
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.799.554 (31. Dezember 2022: -)				
1.800.000	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index 20-Mar-2024	55.513	0,01	
56.550.000	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index 20-Mar-2024	1.744.041	0,17	
Total Return Swaps insgesamt		4.178.144	0,41	
Credit Default Swaps - 6.258.930 (31. Dezember 2022: 1.804.766)				
2.840.000	CDS Apache Corporation 1.000% 20-Dec-2028	47.890	0,01	
70.000	CDS Intesa SanPaolo SpA 1.000% 20-Dec-2028	2.739	0,00	
2.390.000	CDS Intesa SanPaolo SpA 1.000% 20-Dec-2028	93.513	0,01	
80.000	CDS M.D.C. Holdings Inc 1.000% 20-Dec-2028	553	0,00	
2.770.000	CDS M.D.C. Holdings Inc 1.000% 20-Dec-2028	19.150	0,00	
2.740.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2028	79.358	0,01	
80.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2028	2.317	0,00	
2.860.000	CDS Unicredit SpA 1.000% 20-Dec-2028	96.569	0,01	
90.000	CDS Unicredit SpA 1.000% 20-Dec-2028	3.039	0,00	
(3.960.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2028	46.152	0,00	
(120.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2028	1.398	0,00	
(2.420.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2028	180.884	0,02	
(70.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2028	5.232	0,00	
(70.000)	CDS Ziggo Bond Company B.V. 5.000% 20-Dec-2028	3.568	0,00	
(2.310.000)	CDS Ziggo Bond Company B.V. 5.000% 20-Dec-2028	117.737	0,01	
(34.650)	CDX North American High Yield Index Series 41 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	2.021	0,00	
(1.727.550)	CDX North American High Yield Index Series 41 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	100.773	0,01	
(1.850.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	35.885	0,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Credit Default Swaps Forts.				
(279.430.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	5.420.152	0,52	
Credit Default Swaps insgesamt		6.258.930	0,60	
Währungsoptionen - 13.743				
(31. Dezember 2022: -)				
1.471.000	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 159.350	56	0,00	
644.000	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 185.200	-	0,00	
(644.000)	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 188.000	-	0,00	
1.244.000	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 149.100	186	0,00	
343.920.500	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 141.700	13.501	0,00	
Währungsoptionen insgesamt		13.743	0,00	
Zinsswaps - 338.311				
(31. Dezember 2022: 244.045)				
1.770.000	IRS Receive Fixed 3.696% Pay 3 Month SEK STIBOR 03-Oct-2028	10.049	0,00	
57.820.000	IRS Receive Fixed 3.696% Pay 3 Month SEK STIBOR 03-Oct-2028	328.262	0,03	
Zinsswaps insgesamt		338.311	0,03	
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung			
Offene Terminkontrakte - 2.183.148				
(31. Dezember 2022: 2.219.011)				
16	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.499.475	64.208	0,01
25	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2024	3.288.392	117.825	0,01
348	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2024	40.931.888	53.470	0,01
172	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	13.674.320	334.637	0,03
822	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	169.261.359	1.160.756	0,11
125	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	13.596.680	151.618	0,02
68	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	8.495.750	46.308	0,00
65	UK Long Gilt Long Futures Contracts Exp Mar-2024	8.504.790	254.326	0,02
Offene Terminkontrakte insgesamt		2.183.148	0,21	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 12.944.059 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 3.565.148)			12.944.059	1,24
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.006.155.327	96,74	
		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %	
Bestände	Beschreibung			
Total Return Swaps				
Europa - (794.718) (31. Dezember 2022: -)				
1.000.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024	(27.123)	(0,00)	
28.300.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024	(767.595)	(0,07)	
Total Return Swaps insgesamt		(794.718)	(0,07)	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps - (9.461.735)			
(31. Dezember 2022: (3.373.387))			
5.060.000	CDS Barrick Gold Corporation 1.000% 20-Dec-2028	(128.070)	(0,01)
30.000	CDS Beazer Homes USA Inc 5.000% 20-Dec-2028	(2.694)	(0,00)
970.000	CDS Beazer Homes USA Inc 5.000% 20-Dec-2028	(87.104)	(0,01)
4.410.000	CDS BorgWarner Inc 1.000% 20-Dec-2028	(62.890)	(0,01)
130.000	CDS BorgWarner Inc 1.000% 20-Dec-2028	(1.854)	(0,00)
5.140.000	CDS British American Tobacco plc 1.000% 20-Dec-2028	(46.274)	(0,01)
3.170.000	CDS Canadian Natural Resources Limited 1.000% 20-Dec-2028	(55.075)	(0,01)
4.940.000	CDS Imperial Brands Plc 1.000% 20-Dec-2028	(45.509)	(0,00)
40.000	CDS KB Home 5.000% 20-Dec-2028	(6.228)	(0,00)
1.390.000	CDS KB Home 5.000% 20-Dec-2028	(216.435)	(0,02)
(3.840.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2028	(117.048)	(0,01)
2.360.000	CDS Lennar Corp 5.000% 20-Dec-2028	(443.230)	(0,04)
90.000	CDS PulteGroup Inc 5.000% 20-Dec-2028	(16.877)	(0,00)
2.870.000	CDS PulteGroup Inc 5.000% 20-Dec-2028	(538.184)	(0,05)
(2.710.000)	CDS Rolls Royce Plc 1.000% 20-Dec-2028	(23.405)	(0,00)
2.900.000	CDS Toll Brothers Finance Corp 1.000% 20-Dec-2028	(4.812)	(0,00)
90.000	CDS Toll Brothers Finance Corp 1.000% 20-Dec-2028	(149)	(0,00)
2.740.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2028	(489.663)	(0,05)
80.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2028	(14.297)	(0,00)
170.000	CDS Yum! Brands Inc 1.000% 20-Dec-2028	(1.671)	(0,00)
5.550.000	CDS Yum! Brands Inc 1.000% 20-Dec-2028	(54.557)	(0,01)
2.635.000	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(51.112)	(0,01)
101.700.000	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(1.972.692)	(0,19)
4.840.000	iTraxx Europe Crossover Index Series 40 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	(425.633)	(0,04)
135.000	iTraxx Europe Crossover Index Series 40 Version 1 5.000% 20-Dec-2028	(11.872)	(0,00)
151.185.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(3.241.547)	(0,31)
3.820.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(81.904)	(0,01)
7.410.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(158.877)	(0,02)
1.400.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(30.017)	(0,00)
58.510.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(983.327)	(0,10)
2.240.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(37.646)	(0,00)
(285.000)	iTraxx Europe Sub Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(3.208)	(0,00)
(9.585.000)	iTraxx Europe Sub Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(107.874)	(0,01)
Credit Default Swaps insgesamt		(9.461.735)	(0,92)
Währungsoptionen - (57.146)			
(31. Dezember 2022: -)			
(1.471.000)	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 162.000	(1)	(0,00)
(1.471.000)	Euro/Yen Put 04-Jan-2024 155.650	(7.243)	(0,00)
(644.000)	Sterling/Yen Put 02-Jan-2024 180.000	(3.883)	(0,00)
(1.244.000)	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 153.000	(21)	(0,00)
(1.244.000)	US Dollar/Yen Put 25-Jan-2024 143.900	(34.051)	(0,00)
(343.920.500)	Yen/US Dollar Call 16-Jan-2024 138.790	(10.704)	(0,00)
(343.920.500)	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 145.500	(1.243)	(0,00)
Währungsoptionen insgesamt		(57.146)	(0,00)
Zinsswaps - (27.325)			
(31. Dezember 2022: -)			
130.000	IRS Receive 1 Year GBP SONIA-Compound Pay 3.450% 21-Dec-2028	(516)	(0,00)
6.750.000	IRS Receive 1 Year GBP SONIA-Compound Pay 3.450% 21-Dec-2028	(26.809)	(0,00)
Zinsswaps insgesamt		(27.325)	(0,00)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (3.701.085)				
(31. Dezember 2022: (1.212.847))				
(989)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(130.230.703)	(1.237.361)	(0,12)
(749)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(113.461.546)	(2.140.411)	(0,21)
(8)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.251.615)	(65.252)	(0,01)
(22)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.193.971)	(111.499)	(0,01)
(2)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.080.993)	(21.137)	(0,00)
(79)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(8.918.359)	(31.920)	(0,00)
(365)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(43.075.703)	(91.099)	(0,01)
(33)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.408.594)	(2.406)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(3.701.085)	(0,36)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (9.074.585) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.921.723))			(9.074.585)	(0,87)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(23.116.594)	(2,22)
Nettoumlaufvermögen			57.021.733	5,48
Summe Nettovermögen			1.040.060.466	100,00
Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Goldman Sachs und HSBC Bank plc. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited. Die Kontrahenten für Zinsswaps sind BNP Paribas und Goldman Sachs. Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Barclays Bank Plc, Goldman Sachs und JPMorgan Chase Bank. Die Kontrahenten für Total Return Swaps sind Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.				
Portfolioanalyse			% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				91,48
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				0,20
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				2,21
Sonstiges Umlaufvermögen				6,11
Gesamtvermögen			100,00	

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (B)	Betrag (S)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund						
Australischer Dollar	US-Dollar	18.000	12.182	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	88
Australischer Dollar	US-Dollar	393.000	265.258	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	2.646
Euro	US-Dollar	2.195.000	2.420.250	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	3.966
Euro	US-Dollar	2.243.000	2.458.898	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	18.330
Euro	US-Dollar	507.000	548.212	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	11.732
Euro	US-Dollar	101.000	108.910	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	2.637
Euro	US-Dollar	170.000	187.459	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	294
Euro	US-Dollar	183.000	197.765	12. Jan. 24	Morgan Stanley	4.345
Japanischer Yen	US-Dollar	67.138.000	470.782	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	6.148
Japanischer Yen	US-Dollar	151.719.000	1.066.521	12. Jan. 24	BNP Paribas	11.249
Japanischer Yen	US-Dollar	952.000	6.676	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	87
Japanischer Yen	US-Dollar	2.160.000	15.246	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	98
Pfund Sterling	US-Dollar	1.900.000	2.394.851	12. Jan. 24	Morgan Stanley	27.131
Pfund Sterling	US-Dollar	2.620.000	3.312.445	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	27.340
US-Dollar	Australischer Dollar	20.477	30.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	26
US-Dollar	Euro	2.591.336	2.330.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	18.023
US-Dollar	Euro	157.037	142.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	209
US-Dollar	Euro	2.385.517	2.158.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	2.165
US-Dollar	Pfund Sterling	44.620	35.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	4
US-Dollar	Pfund Sterling	344.062	269.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	1.161
Australischer Dollar	US-Dollar	1.594.775	1.048.799	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	38.614
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.540.979	1.137.143	19. Jan. 24	Morgan Stanley	26.105
Chinesischer Yuan	US-Dollar	1.902.316	266.391	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	902
Euro	Pfund Sterling	1.205.242	1.039.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	7.006
Euro	US-Dollar	2.547.000	2.741.292	19. Jan. 24	Morgan Stanley	72.530
Euro	US-Dollar	2.191.162	2.368.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	52.707
Japanischer Yen	US-Dollar	468.162.000	3.318.737	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	10.735
Japanischer Yen	US-Dollar	324.064.000	2.227.187	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	77.489
Japanischer Yen	US-Dollar	1.438.147.825	9.844.504	19. Jan. 24	Morgan Stanley	383.309
Pfund Sterling	Euro	405.000	465.227	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	2.322
Pfund Sterling	Euro	1.039.000	1.193.509	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	5.956
Pfund Sterling	US-Dollar	348.900	437.175	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	7.596
US-Dollar	Taiwan-Dollar	1.951.854	59.473.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs	9.641
USD						832.591
Euro	Schweizer Franken	549.879	520.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(11.660)
Euro	Schweizer Franken	29.609	28.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(628)
Euro	US-Dollar	130.000	143.767	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(191)
US-Dollar	Australischer Dollar	3.691.523	5.547.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(89.817)
US-Dollar	Australischer Dollar	240.911	362.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(5.862)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	253.674	343.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(5.222)
US-Dollar	Euro	114.952	105.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(1.012)
US-Dollar	Euro	11.050.606	10.248.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(267.552)
US-Dollar	Euro	223.471	207.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(5.145)
US-Dollar	Euro	1.189.688	1.102.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(27.389)
US-Dollar	Euro	5.143.738	4.767.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(121.061)
US-Dollar	Euro	573.997	523.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.618)
US-Dollar	Euro	7.391.037	6.852.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(176.490)
US-Dollar	Euro	135.972.995	125.851.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.020.130)
US-Dollar	Euro	9.753.125	9.025.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(214.320)
US-Dollar	Euro	4.385.459	4.059.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(97.407)
US-Dollar	Euro	4.386.675	4.060.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(97.294)
US-Dollar	Euro	135.978.291	125.852.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(3.015.938)
US-Dollar	Euro	21.798.439	20.117.000	12. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(419.300)
US-Dollar	Euro	47.477	44.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(1.117)
US-Dollar	Euro	211.015	192.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(1.035)
US-Dollar	Euro	5.813.300	5.310.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(51.202)
US-Dollar	Euro	64.439	59.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(722)
US-Dollar	Euro	8.401.742	7.681.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(81.355)
US-Dollar	Euro	11.074.993	10.077.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(54.309)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Forts.						
US-Dollar	Euro	315.024	288.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.050)
US-Dollar	Euro	438.048	400.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(3.723)
US-Dollar	Euro	707.133	645.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(5.222)
US-Dollar	Euro	33.986	31.000	12. Jan. 24	HSBC Bank plc	(251)
US-Dollar	Euro	736.139	674.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(8.244)
US-Dollar	Euro	17.015.700	15.549.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(157.021)
US-Dollar	Euro	1.024.198	936.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(9.545)
US-Dollar	Euro	8.985.721	8.226.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(99.288)
US-Dollar	Japanischer Yen	3.034.131	429.261.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(15.221)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.341.425	195.515.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(47.460)
US-Dollar	Japanischer Yen	20.569	2.998.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(728)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.556.188	1.237.000	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(20.650)
US-Dollar	Pfund Sterling	409.074	324.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(3.938)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.232.146	972.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(6.889)
US-Dollar	Pfund Sterling	31.637.747	24.958.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(176.891)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.494.717	1.960.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.748)
US-Dollar	Pfund Sterling	124.545	99.000	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(1.653)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.078.082	847.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(1.611)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.768.577	2.200.000	12. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(35.823)
US-Dollar	Pfund Sterling	122.129	97.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(1.519)
US-Dollar	Pfund Sterling	608.406	478.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(914)
US-Dollar	Pfund Sterling	211.289	166.000	12. Jan. 24	Morgan Stanley	(316)
Euro	Australischer Dollar	639.030	1.048.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(8.615)
US-Dollar	Australischer Dollar	437.066	666.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(17.053)
US-Dollar	Euro	1.304.978	1.195.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(15.209)
US-Dollar	Euro	22.373.487	20.652.477	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(442.527)
US-Dollar	Euro	3.777.468	3.508.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(98.027)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.705.358	5.313.804	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(68.575)
US-Dollar	Schweizer Franken	624.526	543.245	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(22.606)
US-Dollar	Brasilianischer Real	232.572	1.148.000	2. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(3.314)
USD						(9.049.407)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse AUD K (Acc) (Hedged)						
Australischer Dollar	US-Dollar	87	60	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	83	55	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Australischer Dollar	US-Dollar	124	84	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Australischer Dollar	US-Dollar	10.203	6.703	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	253
USD						255
AUD						374
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	2.692.379	2.012.583	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19.621
Kanadischer Dollar	US-Dollar	4.067.973	3.031.617	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	38.883
Kanadischer Dollar	US-Dollar	330.029.556	243.386.767	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.719.101
USD						5.777.605
CAD						7.655.616
Kanadischer Dollar	US-Dollar	2.962.367	2.246.429	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10.438)
USD						(10.438)
CAD						(13.831)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF I (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	78	91	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schweizer Franken	US-Dollar	122	142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF I (Acc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	US-Dollar	10.088	11.509	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	499
USD						506
CHF						426
Schweizer Franken	US-Dollar	78	93	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
CHF						(1)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF I (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	78	91	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schweizer Franken	US-Dollar	122	142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	10.088	11.509	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	499
USD						506
CHF						426
Schweizer Franken	US-Dollar	78	93	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
CHF						(1)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	844.725	979.676	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25.809
Schweizer Franken	US-Dollar	196.889	227.520	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.839
Schweizer Franken	US-Dollar	86.897	100.503	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.931
Schweizer Franken	US-Dollar	307.435	355.960	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9.984
Schweizer Franken	US-Dollar	106.447	121.586	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.118
Schweizer Franken	US-Dollar	25.225.780	28.779.534	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.246.976
USD						1.297.657
CHF						1.091.394
Schweizer Franken	US-Dollar	201.720	241.777	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.667)
US-Dollar	Schweizer Franken	3.624	3.162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(140)
US-Dollar	Schweizer Franken	10.372	8.868	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(184)
USD						(1.991)
CHF						(1.675)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	3.432	4.066	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16
Schweizer Franken	US-Dollar	4.331	5.062	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	87
Schweizer Franken	US-Dollar	163.192	188.580	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.668
Schweizer Franken	US-Dollar	8.911	10.306	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	301
Schweizer Franken	US-Dollar	43.537	50.095	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.728
Schweizer Franken	US-Dollar	254.091	294.195	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8.251
Schweizer Franken	US-Dollar	20.947.531	23.898.575	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.035.491

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	US-Dollar	23.830	27.871	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	494
USD						1.052.036
CHF						884.815
Schweizer Franken	US-Dollar	162.690	194.997	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.345)
US-Dollar	Schweizer Franken	5.067	4.331	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(88)
US-Dollar	Schweizer Franken	603	515	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Schweizer Franken	9.553	8.205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(213)
US-Dollar	Schweizer Franken	500	434	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Schweizer Franken	4.069	3.432	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(16)
USD						(1.689)
CHF						(1.421)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	553	500	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	19.988	22.020	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	55
Euro	US-Dollar	39.988	44.062	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	101
Euro	US-Dollar	6.000	6.593	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	33
Euro	US-Dollar	35.820	39.417	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	143
Euro	US-Dollar	115.730	126.543	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.273
Euro	US-Dollar	175.789	193.466	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	680
Euro	US-Dollar	8.928	9.652	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	208
Euro	US-Dollar	10.000	10.779	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	266
Euro	US-Dollar	14.536.624	15.639.024	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	415.603
USD						418.363
EUR						378.969
US-Dollar	Euro	22.011	19.988	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(54)
Euro	US-Dollar	500	553	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	120.179	133.498	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(769)
US-Dollar	Euro	7.943	7.291	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(110)
US-Dollar	Euro	11.227	10.416	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(277)
USD						(1.211)
EUR						(1.097)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	19.963	21.820	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	228
Euro	US-Dollar	243	266	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	370	408	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	30.468	32.778	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	871
USD						1.103
EUR						999

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	433	480	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
USD						(3)
EUR						(3)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	81	89	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	124	136	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.191	10.964	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	291
USD						292
EUR						265
Euro	US-Dollar	86	95	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	82	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	125	138	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.290	11.071	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	294
USD						295
EUR						267
Euro	US-Dollar	87	97	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	199.161	180.000	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	441
Euro	US-Dollar	303.125	333.786	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	993
Euro	US-Dollar	25.000	27.266	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	345
Euro	US-Dollar	101.960	111.486	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.121
Euro	US-Dollar	155.960	171.643	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	603
Euro	US-Dollar	12.767.521	13.735.759	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	365.024
USD						368.527
EUR						333.826
Euro	US-Dollar	180.000	199.231	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(434)
Euro	US-Dollar	111.116	123.431	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(711)
USD						(1.145)
EUR						(1.037)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	82	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	126	139	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.307	11.088	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	295
USD						296
EUR						268
Euro	US-Dollar	88	98	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	248.527	273.690	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	671
US-Dollar	Euro	29.011	26.219	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	64
Euro	US-Dollar	124.290	136.926	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	343
Euro	US-Dollar	440.305	484.842	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.443
Euro	US-Dollar	66.000	72.210	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	682
Euro	US-Dollar	117.865	129.517	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	657
Euro	US-Dollar	66.563	72.754	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	760
Euro	US-Dollar	21.605.647	23.563.871	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	297.969
Euro	US-Dollar	546.200	601.062	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.176
Euro	US-Dollar	510.261	557.934	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.612
Euro	US-Dollar	769.903	847.323	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.978
Euro	US-Dollar	3.497.645	3.781.342	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	81.549
Euro	US-Dollar	60.513.173	65.102.250	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.730.075
US-Dollar	Euro	26.211	23.681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	57
USD						2.125.036
EUR						1.924.938
US-Dollar	Euro	136.874	124.290	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(336)
Euro	US-Dollar	23.681	26.201	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
Euro	US-Dollar	26.219	29.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)
Euro	US-Dollar	703.917	781.926	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4.502)
US-Dollar	Euro	273.795	248.527	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(685)
US-Dollar	Euro	110.293	100.162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(328)
US-Dollar	Euro	3.444	3.148	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Euro	2.969	2.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	11.369	10.425	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(144)
US-Dollar	Euro	12.152	11.043	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(44)
US-Dollar	Euro	2.790	2.561	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(39)
US-Dollar	Euro	47.675	44.098	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.028)
USD						(7.274)
EUR						(6.589)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.332	4.737	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	48
Euro	US-Dollar	6.606	7.271	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	26

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	543.109	584.297	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15.528
USD						15.602
EUR						14.133
Euro	US-Dollar	4.587	5.095	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
USD						(29)
EUR						(26)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	24.175.836	171.196	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	542
Japanischer Yen	US-Dollar	38.682.464	274.342	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	448
Japanischer Yen	US-Dollar	3.215.129.313	22.067.947	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	771.451
Japanischer Yen	US-Dollar	9.780.000	69.257	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	217
USD						772.658
JPY						108.944.778
US-Dollar	Japanischer Yen	69.169	9.780.000	4. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(216)
Japanischer Yen	US-Dollar	23.375.311	166.257	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(205)
US-Dollar	Japanischer Yen	24.554	3.490.000	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(238)
USD						(659)
JPY						(92.919)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse SGD H (Inc) (Hedged) (Q)						
Singapur- Dollar	US-Dollar	25.889	19.461	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	166
Singapur- Dollar	US-Dollar	38.232	28.833	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	152
Singapur- Dollar	US-Dollar	3.162.707	2.355.597	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	42.069
USD						42.387
SGD						55.940
Singapur- Dollar	US-Dollar	26.649	20.245	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(43)
USD						(43)
SGD						(57)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling I (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	91	116	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	83	105	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	126	160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.260	12.882	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	196
USD						196
GBP						154
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling I (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	91	116	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling I (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	83	105	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	126	160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.260	12.882	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	196
USD						196
GBP						154
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	93	118	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	128	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.408	13.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
USD						199
GBP						156
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling K (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	93	118	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	128	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.408	13.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
USD						199
GBP						156
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	94	120	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	128	164	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.424	13.090	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
USD						199
GBP						156
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	93	119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	128	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.357	13.005	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	198
USD						198
GBP						155
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	1.178	1.497	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Pfund Sterling	95	75	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	666	848	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	17	22	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	7.553.967	9.485.157	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	144.089
Pfund Sterling	US-Dollar	1.881	2.365	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	33
Pfund Sterling	US-Dollar	34.343	43.379	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	398
Pfund Sterling	US-Dollar	61.290	77.942	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	186
Pfund Sterling	US-Dollar	13.474	17.079	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	97
Pfund Sterling	US-Dollar	17.993	22.759	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	177
Pfund Sterling	US-Dollar	65.001	82.712	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	146
Pfund Sterling	US-Dollar	90.865	114.493	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.079
Pfund Sterling	US-Dollar	7.454	9.457	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44
Pfund Sterling	US-Dollar	6.696	8.507	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	28
Pfund Sterling	US-Dollar	75	95	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	1.345	1.712	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	3	3	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	73	57	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						146.285
GBP						114.765
US-Dollar	Pfund Sterling	1.712	1.345	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	68.656	87.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(185)
Pfund Sterling	US-Dollar	17.806	22.746	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
Pfund Sterling	US-Dollar	92.618	118.103	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(41)
US-Dollar	Pfund Sterling	848	666	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.497	1.178	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.751	1.378	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.214	4.109	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.006	796	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	574	454	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.032	1.603	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Pfund Sterling	904	716	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.027	2.408	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42)
US-Dollar	Pfund Sterling	719	572	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.613	2.878	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(56)
USD						(454)
GBP						(356)
BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	585.063	741.579	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.217
Pfund Sterling	US-Dollar	36.499	46.415	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	111
Pfund Sterling	US-Dollar	4.516.245	5.670.834	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	86.146
USD						90.474
GBP						70.979
Pfund Sterling	US-Dollar	44.367	56.675	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(119)
Pfund Sterling	US-Dollar	55.403	70.648	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	9.933	7.866	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(94)
					USD	(237)
					GBP	(237)

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

BNP Mellon Global Credit Fund Antenneklasse Sterling £ (Hedge)						
Pfund Sterling	US-Dollar	93	119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	128	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.421	13.086	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
USD						199
GBP						156

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	93	119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	84	107	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	128	163	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.421	13.086	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
USD						199
GBP						156

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Euro - 1.944.120			
(31. Dezember 2022: -)			
18.600	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF	1.944.120	1,06
Pfund Sterling - 5.126.696			
(31. Dezember 2022: 5.104.833)			
2.923.763	BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	5.126.696	2,81
Schweizer Franken - 1.901.930			
(31. Dezember 2022: -)			
147.600	Xtrackers USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	1.901.930	1,04
US-Dollar - 7.148.580			
(31. Dezember 2022: 14.292.057)			
344.000	iShares China CNY Bond UCITS ETF	1.800.100	0,99
61.000	iShares J.P.Morgan USD EM Bond UCITS ETF	5.348.480	2,93
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		16.121.326	8,83
Anleihen			
Australischer Dollar - 5.055.450			
(31. Dezember 2022: 5.774.311)			
6.440.000	Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	3.579.794	1,96
2.060.000	Queensland Treasury Corp '144A' 5.250% 21-Jul-2036	1.475.656	0,81
Brasilianischer Real - 4.591.378			
(31. Dezember 2022: 3.307.615)			
31.000.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	4.591.378	2,51
Kanadischer Dollar - 4.727.788			
(31. Dezember 2022: 33.514.607)			
1.460.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 0.950% 15-Jun-2025	1.051.153	0,58
2.375.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.253% 15-Mar-2027	1.792.856	0,98
2.082.552	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	1.883.779	1,03
Kolumbianischer Peso - 2.552.755			
(31. Dezember 2022: 4.308.503)			
6.267.400.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	1.430.234	0,78
5.076.400.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	1.122.521	0,62
Euro - 20.901.583			
(31. Dezember 2022: 31.388.510)			
995.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 4.625% 23-Jul-2029	1.137.745	0,62
620.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025	681.108	0,37
256.000	ams-OSRAM AG 'REGS' 10.500% 30-Mar-2029	308.194	0,17
170.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029	151.693	0,08
130.000	Benteler International AG 'REGS' 9.375% 15-May-2028	153.879	0,08
998.000	CBRE Global Investors Open-Ended Funds SCA SICAV-SIF-Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028	979.907	0,54
150.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	140.659	0,08
900.000	Cie de Saint-Gobain SA 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	971.552	0,53
190.000	Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029	186.562	0,10
2.522.677	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	2.749.067	1,51
300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 3.750% 05-Jun-2027	339.192	0,19
2.341.442	European Union 0.450% 04-Jul-2041	1.706.988	0,94

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
1.080.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 1.744% 19-Jul-2024	1.179.502	0,65
150.000	Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029	154.524	0,08
338.000	Heimstadten Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	129.760	0,07
801.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	920.669	0,50
209.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	240.872	0,13
180.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	190.717	0,10
170.000	Loxam SAS 'EMTN' 6.375% 15-May-2028	195.977	0,11
592.000	Orsted AS 'EMTN' 3.250% 13-Sep-2031	650.935	0,36
1.830.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	1.961.657	1,07
656.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	120.842	0,07
1.490.000	Spain Government Bond '144A' 1.900% 31-Oct-2052	1.148.432	0,63
200.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	220.694	0,12
200.000	Teleperformance SE 'EMTN' 5.250% 22-Nov-2028	232.004	0,13
1.201.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	1.214.827	0,67
530.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	507.091	0,28
810.000	Universal Music Group NV 'EMTN' 3.000% 30-Jun-2027	898.762	0,49
1.400.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029	1.427.772	0,78
Indische Rupie - 1.602.257			
(31. Dezember 2022: 2.108.284)			
134.140.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	1.602.257	0,88
Indonesische Rupiah - 4.732.623			
(31. Dezember 2022: 5.145.871)			
27.697.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	1.783.477	0,98
45.340.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	2.949.146	1,61
Japanischer Yen - 5.029.848			
(31. Dezember 2022: -)			
593.350.000	Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	2.860.124	1,56
386.650.000	Japan Government Forty Year Bond 1.000% 20-Mar-2062	2.169.724	1,19
Malaysischer Ringgit - 2.679.521			
(31. Dezember 2022: -)			
11.810.000	Malaysia Government Bond 4.498% 15-Apr-2030	2.679.521	1,47
Mexikanischer neuer Peso - 7.363.314			
(31. Dezember 2022: 8.673.532)			
70.000.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	3.715.486	2,03
672.000.000	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	3.647.828	2,00
Neuseeländischer Dollar - 13.857.448			
(31. Dezember 2022: 24.527.989)			
3.010.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	1.856.232	1,02
3.730.000	New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	1.992.114	1,09
5.900.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	3.662.275	2,01
3.530.000	New Zealand Government Bond 1.750% 15-May-2041	1.470.768	0,81
950.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.500% 20-Sep-2040	749.130	0,41
1.200.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	1.029.470	0,56
2.920.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	1.827.765	1,00
2.240.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3.500% 14-Apr-2033	1.269.694	0,69

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Norwegische Krone – 2.840.505				
(31. Dezember 2022: –)				
11.920.000	Norway Government Bond '144A' 1.375% 19-Aug-2030	2.840.505	1,56	
18.720.000	Norway Government Bond '144A' 1.750% 13-Mar-2025	1.042.843	0,57	
		1.797.662	0,99	
Peruanischer neuer Sol – 2.207.780				
(31. Dezember 2022: 3.324.527)				
8.330.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	2.207.780	1,21	
Pfund Sterling – 16.478.088				
(31. Dezember 2022: 32.112.974)				
176.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	212.461	0,11	
1.100.000	AT&T Inc 2.900 % 04-Dec-2026	1.336.856	0,73	
510.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 9.250% 15-Sep-2028	651.620	0,36	
700.000	Commonwealth Bank of Australia FRN 5.770% 16-Jan-2025	892.771	0,49	
719.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024	903.473	0,49	
160.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	190.814	0,10	
490.000	Direct Line Insurance Group Plc FRN (Perpetual) 4.750% 07-Dec-2027	490.387	0,27	
512.000	Hiscox Ltd 6.000% 22-Sep-2027	671.679	0,37	
110.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 10.875% 15-Dec-2027	146.609	0,08	
480.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 6.625% 31-May-2033	645.104	0,35	
558.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024	652.500	0,36	
132.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	162.644	0,09	
200.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 5.250% 15-Jan-2027	236.134	0,13	
1.450.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	1.787.882	0,98	
1.360.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 30-Mar-2027	1.765.305	0,97	
530.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024	658.598	0,36	
500.000	Mobico Group Plc 2.375% 20-Nov-2028	559.629	0,31	
415.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	468.187	0,26	
293.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 5.625% 28-Jan-2026	381.995	0,21	
686.000	Nationwide Building Society FRN 5.770% 10-Jan-2025	876.025	0,48	
520.000	Nestle Holdings Inc 5.250% 21-Sep-2026	678.315	0,37	
530.000	Nestle Holdings Inc 5.250% 21-Sep-2026	691.521	0,38	
715.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	661.549	0,36	
590.000	Welltower OP LLC 4.800% 20-Nov-2028	756.030	0,41	
Uruguayischer Peso – 1.241.312				
(31. Dezember 2022: –)				
52.131.894	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	1.241.312	0,68	
US-Dollar – 62.307.794				
(31. Dezember 2022: 144.272.375)				
740.000	American Express Co 2.500% 30-Jul-2024	727.603	0,40	
180.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	173.736	0,10	
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	199.445	0,11	
190.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	176.910	0,10	
574.000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.550% 30-May-2033	570.573	0,31	
1.870.000	Asian Development Bank 'GMTN' 4.000% 12-Jan-2033	1.868.752	1,02	
1.740.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 6.406% 27-Aug-2026	1.767.463	0,97	
1.270.000	Bank of Montreal '144A' 3.750% 25-Jul-2025	1.248.657	0,68	
1.700.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 6.387% 05-Aug-2026	1.725.404	0,94	
692.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Aug-2025	694.573	0,38	
140.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	143.232	0,08	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
160.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	146.343	0,08	
170.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	171.159	0,09	
170.000	Civitas Resources Inc '144A' 8.375% 01-Jul-2028	177.671	0,10	
1.309.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.214% 27-May-2025	1.279.259	0,70	
230.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	236.032	0,13	
1.298.674	Greenland Global Investment Ltd 'EMTN' 7.125% 22-Apr-2029	188.308	0,10	
1.210.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2024	1.205.373	0,66	
1.580.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 5.693% 20-Mar-2028	1.571.992	0,86	
1.930.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	1.788.467	0,98	
870.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	925.493	0,51	
210.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	191.912	0,11	
1.780.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	1.704.781	0,93	
1.724.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 6.421% 17-Jun-2026	1.749.332	0,96	
500.000	KWG Group Holdings Ltd (Defaulted) 7.875% 30-Aug-2024	33.125	0,02	
1.370.000	Lowe's Cos Inc 3.000% 15-Oct-2050	938.903	0,51	
1.111.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	1.179.049	0,65	
873.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' FRN 6.339% 21-Mar-2025	876.413	0,48	
200.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	166.288	0,09	
899.000	Morocco Government International Bond 'REGS' 6.500% 08-Sep-2033	951.196	0,52	
1.430.000	National Australia Bank Ltd/New York 3.500% 09-Jun-2025	1.406.099	0,77	
1.170.000	NVIDIA Corp 3.500% 01-Apr-2050	985.378	0,54	
1.064.000	Oman Government International Bond 'REGS' 4.875% 01-Feb-2025	1.056.666	0,58	
856.000	Republic of Tajikistan International Bond 'REGS' 7.125% 14-Sep-2027	748.007	0,41	
2.110.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 4.750% 20-Feb-2024	2.104.371	1,15	
890.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.000% 25-May-2034	900.170	0,49	
504.000	Shimao Group Holdings Ltd (Defaulted) 3.975% 16-Sep-2023	21.420	0,01	
1.560.000	Shimao Group Holdings Ltd (Defaulted) 4.750% 03-Jul-2022	66.277	0,04	
1.105.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN' 3.000% 20-Jul-2026	1.053.547	0,58	
580.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Perpetual) 10.000% 14-Nov-2028	621.583	0,34	
190.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	176.517	0,10	
457.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN 6.187% 06-Jul-2027	464.591	0,25	
114.779	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 1.000% 30-Sep-2032	9.182	0,01	
92.854	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 6.000% 30-Sep-2025	10.752	0,01	
92.854	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 6.250% 30-Sep-2026	9.750	0,01	
185.708	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 6.500% 30-Sep-2027	16.862	0,01	
278.562	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 6.750% 30-Sep-2028	21.728	0,01	
278.562	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 7.000% 30-Sep-2029	20.056	0,01	
130.852	Sunac China Holdings Ltd 'REGS' 7.250% 30-Sep-2030	7.524	0,00	
1.730.000	Svensk Exportkredit AB 'GMTN' FRN 6.387% 03-Aug-2026	1.758.323	0,96	
1.470.000	Trimble Inc 6.100% 15-Mar-2033	1.576.024	0,86	
570.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 9.250% 13-Nov-2028	613.636	0,34	
3.781.363	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	3.553.570	1,95	
9.270.000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	8.926.451	4,89	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
8.200.000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	7.936.383	4,35
150.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2030	149.403	0,08
1.220.000	Verizon Communications Inc FRN 6.218% 20-Mar-2026	1.224.695	0,67
236.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	233.640	0,13
380.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	352.074	0,19
387.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	182.382	0,10
1.350.000	Warnermedia Holdings Inc 3.788% 15-Mar-2025	1.323.289	0,72
Gesamtanlagen in Anleihen		158.169.444	86,63

Optionen auf Futures - 45.391
(31. Dezember 2022: -)

83	U.S. 10 Year Treasury Note Future Put 23-Feb-2024	45.391	0,02
111.000			

Optionen auf Futures insgesamt		45.391	0,02

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 890.224 (31. Dezember 2022: 1.167.528)				
173	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	13.725.570	402.767	0,22
187	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	38.482.555	339.360	0,19
101	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	10.977.437	148.097	0,08

Offene Terminkontrakte insgesamt		890.224	0,49

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 5.219.834 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 4.092.971)		5.219.834	2,86

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		180.446.219	98,83

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (1.980.425) (31. Dezember 2022: -)				
(28)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.622.557)	(108.553)	(0,06)
(46)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(6.096.161)	(217.100)	(0,12)
(79)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(12.023.640)	(348.574)	(0,19)
(52)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(7.595.189)	(235.010)	(0,13)
(20)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(20.730.536)	(229.278)	(0,13)
(92)	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(6.685.368)	(66.301)	(0,04)
(135)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(15.240.234)	(346.221)	(0,19)
(23)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.084.875)	(278.790)	(0,15)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(20)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.616.550)	(150.598)	(0,08)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(1.980.425)	(1,09)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (7.309.334) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (8.388.906))			(7.309.334)	(4,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(9.289.759)	(5,09)
Nettoumlaufvermögen			11.421.373	6,26
Summe Nettovermögen			182.577.833	100,00

Der Kontrahent für Optionen auf Futures 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	90,71
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,49
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,72
Sonstiges Umlaufvermögen	6,08
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Australischer Dollar	US-Dollar	2.474.832	1.634.090	16. Feb. 24	UBS AG	51.389
Australischer Dollar	US-Dollar	3.540.803	2.335.749	16. Feb. 24	State Street Bank	75.707
Australischer Dollar	US-Dollar	785.185	516.386	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	18.362
Australischer Dollar	US-Dollar	2.907.185	1.953.361	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	26.570
Australischer Dollar	US-Dollar	597.131	402.787	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	3.888
Australischer Dollar	US-Dollar	286.943	195.353	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	69
Australischer Dollar	US-Dollar	424.968	281.563	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	7.860
Kanadischer Dollar	US-Dollar	815.044	601.084	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	14.214
Kanadischer Dollar	US-Dollar	515.838	379.847	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	9.573
Kanadischer Dollar	US-Dollar	359.363	265.663	16. Feb. 24	UBS AG	5.630
Kanadischer Dollar	US-Dollar	3.210.438	2.368.915	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	54.732
Kanadischer Dollar	US-Dollar	984.941	739.055	16. Feb. 24	State Street Bank	4.504
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	8.760.648.222	2.180.931	16. Feb. 24	State Street Bank	59.368
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	4.329.530.440	1.069.413	16. Feb. 24	State Street Bank	37.747
Euro	US-Dollar	360.749	397.250	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	3.095
Euro	US-Dollar	188.404	203.786	16. Feb. 24	UBS AG	5.297
Euro	US-Dollar	2.034.447	2.192.244	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	65.504
Euro	US-Dollar	1.581.065	1.713.305	16. Feb. 24	State Street Bank	41.297
Euro	US-Dollar	7.759.623	8.407.629	16. Feb. 24	UBS AG	203.688
Euro	US-Dollar	17.19.766	1.889.798	16. Feb. 24	State Street Bank	18.729
Euro	US-Dollar	263.122	288.220	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	3.782
Euro	US-Dollar	408.035	448.630	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	4.192
Indische Rupie	US-Dollar	62.170.491	746.193	16. Feb. 24	State Street Bank	174
Indonesische Rupiah	US-Dollar	31.883.941.839	2.045.904	16. Feb. 24	State Street Bank	16.286
Japanischer Yen	US-Dollar	317.292.716	2.174.536	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	83.196
Japanischer Yen	US-Dollar	315.700.886	2.212.975	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	33.430
Japanischer Yen	US-Dollar	229.612.413	1.595.770	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	38.062
Japanischer Yen	US-Dollar	28.706.291	202.006	16. Feb. 24	State Street Bank	2.257
Japanischer Yen	US-Dollar	41.531.947	288.647	16. Feb. 24	State Street Bank	6.878
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	4.202.624	900.633	16. Feb. 24	State Street Bank	18.979
Mexikanischer Peso	US-Dollar	61.213.260	3.487.293	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	97.804
Mexikanischer Peso	US-Dollar	4.165.777	237.002	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	6.977
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	904.282	553.478	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	18.113
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.308.646	791.199	16. Feb. 24	State Street Bank	35.990
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	535.052	329.098	16. Feb. 24	UBS AG	9.106
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	507.417	319.053	16. Feb. 24	UBS AG	1.683
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	6.338.575	3.899.551	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	107.030
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	230.356	141.634	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	3.973
Norwegische Krone	US-Dollar	6.598.962	642.476	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	8.491
Norwegische Krone	US-Dollar	9.268.124	865.665	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	48.607
Norwegische Krone	US-Dollar	3.747.184	344.516	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	25.132
Peruanischer neuer Sol	US-Dollar	2.563.954	677.811	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	15.525
Pfund Sterling	US-Dollar	1.877.735	2.374.599	16. Feb. 24	State Street Bank	19.169
Pfund Sterling	US-Dollar	325.283	411.944	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	2.731
Pfund Sterling	US-Dollar	2.120.000	2.634.715	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	67.898
Pfund Sterling	US-Dollar	1.223.738	1.535.611	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	24.431
Pfund Sterling	US-Dollar	374.819	474.941	16. Feb. 24	State Street Bank	2.884
Pfund Sterling	US-Dollar	4.491.872	5.650.739	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	75.576
Pfund Sterling	US-Dollar	197.868	250.108	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	2.138
Pfund Sterling	US-Dollar	1.288.405	1.619.510	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	22.971

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	1.279.600	1.564.280	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	66.976
Pfund Sterling	US-Dollar	1.277.561	1.624.630	16. Feb. 24	State Street Bank	4.027
Schwedische Krone	US-Dollar	53.317.469	4.885.906	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	451.193
Schwedische Krone	US-Dollar	17.814.837	1.750.352	16. Feb. 24	UBS AG	32.920
Schwedische Krone	US-Dollar	12.280.565	1.172.632	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	56.657
US-Dollar	Australischer Dollar	314.427	458.042	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	2.479
US-Dollar	Euro	108.313	97.163	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	485
US-Dollar	Japanischer Yen	221.607	31.103.188	16. Feb. 24	State Street Bank	289
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	2.890.784	4.544.943	16. Feb. 24	State Street Bank	17.949
USD						2.143.663
Koreanischer Won	US-Dollar	2.446.840.213	1.901.788	16. Feb. 24	State Street Bank	(14.591)
US-Dollar	Australischer Dollar	871.345	1.325.477	16. Feb. 24	State Street Bank	(31.368)
US-Dollar	Australischer Dollar	434.089	682.631	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	(30.815)
US-Dollar	Australischer Dollar	6.418.041	9.954.967	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(361.766)
US-Dollar	Australischer Dollar	91.328	136.977	16. Feb. 24	UBS AG	(1.960)
US-Dollar	Australischer Dollar	256.691	387.162	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(6.985)
US-Dollar	Australischer Dollar	448.406	667.120	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(5.935)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	168.012	224.629	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.567)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	8.485.368	11.681.721	16. Feb. 24	State Street Bank	(333.483)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	330.426	441.705	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.029)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	561.541	2.270.660.334	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	(19.119)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	3.284.462	13.613.438.601	16. Feb. 24	State Street Bank	(196.807)
US-Dollar	Euro	260.219	236.838	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.614)
US-Dollar	Euro	2.895.623	2.645.462	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(40.204)
US-Dollar	Euro	187.152	171.057	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.680)
US-Dollar	Euro	158.883	144.512	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.491)
US-Dollar	Euro	146.945	134.153	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.933)
US-Dollar	Euro	383.510	349.500	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(4.350)
US-Dollar	Euro	161.780	147.519	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.931)
US-Dollar	Euro	34.963.026	32.638.481	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.257.845)
US-Dollar	Euro	109.270	101.232	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.073)
US-Dollar	Euro	196.595	179.462	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(2.565)
US-Dollar	Euro	306.718	283.668	16. Feb. 24	UBS AG	(8.086)
US-Dollar	Euro	325.487	299.328	16. Feb. 24	State Street Bank	(6.695)
US-Dollar	Euro	144.646	132.688	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(2.605)
US-Dollar	Euro	180.647	164.720	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.153)
US-Dollar	Euro	207.029	188.835	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.532)
US-Dollar	Euro	388.079	352.561	16. Feb. 24	State Street Bank	(3.179)
US-Dollar	Euro	147.798	134.067	16. Feb. 24	State Street Bank	(985)
US-Dollar	Euro	779.491	709.498	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(7.881)
US-Dollar	Indische Rupie	2.368.142	19.7794.356	16. Feb. 24	State Street Bank	(6.411)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	847.898	13.293.184.321	16. Feb. 24	State Street Bank	(11.879)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	4.208.276	66.017.328.803	16. Feb. 24	State Street Bank	(61.593)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.893.191	274.942.093	16. Feb. 24	State Street Bank	(63.190)
US-Dollar	Japanischer Yen	90.773	13.214.769	16. Feb. 24	State Street Bank	(3.258)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.662.803	240.879.418	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(51.201)
US-Dollar	Japanischer Yen	452.521	64.069.954	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(3.376)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.058.410	305.824.183	16. Feb. 24	State Street Bank	(117.716)
US-Dollar	Japanischer Yen	125.126	17.642.811	16. Feb. 24	State Street Bank	(414)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	3.584.169	16.642.373	16. Feb. 24	State Street Bank	(57.492)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.192.855	21.048.649	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	(39.909)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	5.221.902	93.176.389	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(235.190)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Mexikanischer Peso	475.674	8.451.015	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	(19.280)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	398.924	7.023.267	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(12.409)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	2.427.522	3.941.199	16. Feb. 24	State Street Bank	(63.689)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	17.595.599	29.685.289	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.168.320)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	514.756	865.652	16. Feb. 24	State Street Bank	(32.418)
US-Dollar	Norwegische Krone	4.307.741	48.249.572	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(451.929)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	2.833.972	10.803.667	16. Feb. 24	State Street Bank	(87.518)
US-Dollar	Pfund Sterling	117.760	92.845	16. Feb. 24	UBS AG	(601)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.642.175	1.316.413	16. Feb. 24	State Street Bank	(36.011)
US-Dollar	Pfund Sterling	763.845	621.888	16. Feb. 24	JPMorgan Chase Bank	(28.949)
US-Dollar	Pfund Sterling	39.878.528	32.546.514	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.612.325)
US-Dollar	Schwedische Krone	163.861	1.722.864	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(8.599)
US-Dollar	Schwedische Krone	7.259.934	79.214.777	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(669.494)
US-Dollar	Schwedische Krone	2.102.866	21.969.065	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(96.245)
USD						(7.299.643)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	8.076	8.903	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	47
Euro	US-Dollar	7.861	8.654	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
Euro	US-Dollar	1.521.236	1.637.361	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	48.442
USD						48.547
EUR						43.827
US-Dollar	Euro	14.138	12.913	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(171)
US-Dollar	Euro	8.002	7.310	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(99)
USD						(270)
EUR						(244)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.312	1.446	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	5.443	5.958	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	74
Euro	US-Dollar	1.236	1.361	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	239.463	257.743	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7.625
USD						7.716
EUR						6.966
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	34.383	38.032	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	54
Euro	US-Dollar	7.546	8.319	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44
Euro	US-Dollar	7.217	7.945	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	53
Euro	US-Dollar	1.385.678	1.491.455	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44.125
USD						44.276
EUR						39.971
US-Dollar	Euro	38.046	34.383	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(57)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	5.162	4.716	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Euro	8.983	8.204	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(109)
USD						(230)
EUR						(208)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	5.317	5.861	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	31
Euro	US-Dollar	5.090	5.603	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Euro	US-Dollar	977.209	1.051.805	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	31.118
USD						31.186
EUR						28.154
US-Dollar	Euro	6.258	5.729	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(90)
USD						(90)
EUR						(81)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged)						
Euro	US-Dollar	81.020	89.314	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	471
Euro	US-Dollar	1.300.000	1.423.036	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.597
Euro	US-Dollar	75.069	82.641	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	549
Euro	US-Dollar	14.506.304	15.613.650	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	461.934
USD						480.551
EUR						433.828
US-Dollar	Euro	202.322	187.142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.064)
USD						(5.064)
EUR						(5.064)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	5.648	5.079	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21
Euro	US-Dollar	53.805	59.378	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	247
Euro	US-Dollar	3.525	3.874	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	33
Euro	US-Dollar	22.302	24.530	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	185
Euro	US-Dollar	3.270	3.579	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44
Euro	US-Dollar	8.236	9.018	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	109
Euro	US-Dollar	919	1.004	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14
Euro	US-Dollar	8.759	9.617	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	89
Euro	US-Dollar	10.483	11.475	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	143
Euro	US-Dollar	23.387	25.746	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	171
Euro	US-Dollar	613	662	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	4.472.395	4.813.797	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	142.418
USD						143.491
EUR						129.540

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	5.079	5.650	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	281.466	257.130	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.481)
US-Dollar	Euro	3.126	2.855	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(38)
USD						(3.540)
EUR						(3.196)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	2.666.251.176	18.300.538	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	567.485
USD						567.485
JPY						80.321.827
Japanischer Yen	US-Dollar	16.734.733	118.506	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(81)
USD						(81)
JPY						(11.465)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Inc) (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	7.412.416.810	50.877.132	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.577.659
USD						1.577.659
JPY						223.301.855
Japanischer Yen	US-Dollar	46.524.049	329.457	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(224)
US-Dollar	Japanischer Yen	18.736	2.665.996	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(130)
USD						(354)
JPY						(50.105)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse SGD I (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	28.398	21.411	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	126
Singapur-Dollar	US-Dollar	29.366	22.169	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	102
Singapur-Dollar	US-Dollar	5.556.094	4.134.532	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	79.275
USD						79.503
SGD						104.880
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	25.863	32.767	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	197
Pfund Sterling	US-Dollar	436	552	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	113.456	143.609	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	999
Pfund Sterling	US-Dollar	4.849.047	6.086.328	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	94.155
USD						95.355
GBP						74.818

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	26.098	33.326	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(62)
USD						(62)
GBP						(49)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	55	69	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	56	72	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.389	13.039	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	202
USD						202
GBP						158
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	54	69	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	55	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.275	12.897	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	200
USD						200
GBP						157

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Argentinien - 890.431			
(31. Dezember 2022: 869.370)			
2.123	Globant SA	509.148	2,30
241	MercadoLibre Inc	381.283	1,73
Brasilien - 1.865.599			
(31. Dezember 2022: 2.389.384)			
105.335	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	315.619	1,43
76.421	Raia Drogasil SA	463.472	2,10
76.400	WEG SA	580.518	2,62
19.199	XP Inc	505.990	2,29
China - 4.201.494			
(31. Dezember 2022: 11.670.386)			
65.636	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	351.169	1,59
168.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	244.959	1,11
124.864	NARI Technology Co Ltd 'A'	392.874	1,78
18.400	NetEase Inc	331.297	1,50
29.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	131.141	0,59
14.300	Proya Cosmetics Co Ltd 'A'	200.410	0,91
69.100	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	615.325	2,78
30.900	Sungrow Power Supply Co Ltd	381.425	1,73
25.248	Tencent Holdings Ltd	948.303	4,29
14.298	Yum China Holdings Inc	604.591	2,74
Hongkong - 1.017.503			
(31. Dezember 2022: 1.679.087)			
90.600	AIA Group Ltd	789.543	3,58
20.215	Prudential Plc	227.960	1,03
Indien - 5.776.339			
(31. Dezember 2022: 8.887.186)			
53.862	HDFC Bank Ltd	1.105.930	5,01
49.618	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	385.266	1,74
19.780	Hindustan Unilever Ltd	631.964	2,86
31.909	ICICI Bank Ltd	382.576	1,73
10.307	Info Edge India Ltd	636.402	2,88
67.126	Marico Ltd	441.914	2,00
1.926	PB Fintech Ltd	18.401	0,08
8.563	Pidilite Industries Ltd	278.871	1,26
52.638	Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	407.213	1,84
16.584	Tata Consultancy Services Ltd	756.934	3,43
10.025	Titan Co Ltd	443.997	2,01
193.019	Zomato Ltd	286.871	1,30
Indonesien - 979.570			
(31. Dezember 2022: 537.618)			
1.551.200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	608.259	2,75
1.000.800	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	371.311	1,68
Japan - 250.405			
(31. Dezember 2022: 785.708)			
7.400	Advantest Corp	250.405	1,13
Mexiko - 788.535			
(31. Dezember 2022: 945.891)			
187.259	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	788.535	3,57
Niederlande - 846.372			
(31. Dezember 2022: 1.056.904)			
547	ASM International NV	286.339	1,30
737	ASML Holding NV	560.033	2,53
Peru - 361.417			
(31. Dezember 2022: 471.825)			
2.395	Credicorp Ltd	361.417	1,64
Polen - 249.376			
(31. Dezember 2022: -)			
2.122	Dino Polska SA '144A'	249.376	1,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Republik Korea - 915.706			
(31. Dezember 2022: 1.408.152)			
10.992	Samsung Electronics Co Ltd	669.557	3,03
672	Samsung SDI Co Ltd	246.149	1,11
Südafrika - 344.795			
(31. Dezember 2022: 425.930)			
19.615	Clicks Group Ltd	344.795	1,56
Taiwan - 2.076.897			
(31. Dezember 2022: 2.281.775)			
17.000	Chroma ATE Inc	117.846	0,53
29.000	Delta Electronics Inc	295.995	1,34
66.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.274.173	5,77
7.000	Voltron Power Technology Corp	388.883	1,76
Vereinigte Staaten von Amerika - 559.975			
(31. Dezember 2022: 324.802)			
464	Lam Research Corp	366.354	1,66
10.435	Livent Corp	193.621	0,87
Gesamtanlagen in Aktien		21.124.414	95,60
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 21.529 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 6.967)		21.529	0,10
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		21.145.943	95,70
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (218) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (257))		(218)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(218)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		950.576	4,30
Summe Nettovermögen		22.096.301	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,30	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,10	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,60	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	5.048	5.512	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	82
Euro	US-Dollar	6.272	6.905	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Euro	US-Dollar	335.366	360.967	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.679
Euro	US-Dollar	4.118	4.560	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
USD						10.810
EUR						9.759
Euro	US-Dollar	3.971	4.416	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	2.001	1.820	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	2.283	2.088	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Euro	6.625	6.065	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(95)
USD						(157)
EUR						(142)
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.166	4.614	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	5.015	5.475	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	82
Euro	US-Dollar	6.246	6.876	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Euro	US-Dollar	332.501	357.883	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.588
USD						10.719
EUR						9.677
Euro	US-Dollar	4.065	4.519	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	1.988	1.808	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	2.232	2.042	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(31)
USD						(61)
EUR						(55)

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 2.541.324			
(31. Dezember 2022: 4.752.378)			
660.825	Insurance Australia Group Ltd	2.541.324	0,57
Bermudas - 6.050.385			
(31. Dezember 2022: 4.933.229)			
40.094	Credicorp Ltd	6.050.385	1,36
Brasilien - 8.071.337			
(31. Dezember 2022: -)			
2.693.736	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	8.071.337	1,82
Kanada - 7.631.403			
(31. Dezember 2022: -)			
97.732	Restaurant Brands International Inc	7.631.403	1,72
China - 3.681.006			
(31. Dezember 2022: 7.130.623)			
814.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	3.681.006	0,83
Frankreich - 35.630.490			
(31. Dezember 2022: 18.854.219)			
120.868	Publicis Groupe SA	11.293.241	2,54
148.682	Sanofi SA	14.792.910	3,33
300.903	Veolia Environnement SA	9.544.339	2,15
Deutschland - 29.868.056			
(31. Dezember 2022: 54.364.208)			
176.125	Bayer AG	6.570.755	1,48
135.942	Deutsche Post AG	6.761.928	1,52
116.277	Mercedes-Benz Group AG	8.059.018	1,81
20.330	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	8.476.355	1,91
Hongkong - 2.904.663			
(31. Dezember 2022: 5.476.397)			
518.038	Link REIT (Units) (REIT)	2.904.663	0,65
Indien - 6.932.060			
(31. Dezember 2022: 6.306.411)			
373.394	Infosys Ltd ADR	6.932.060	1,56
Indonesien - 8.613.537			
(31. Dezember 2022: -)			
9.363.500	Bank Mandiri Persero Tbk PT	3.671.633	0,83
13.320.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	4.941.904	1,11
Irland - 22.377.264			
(31. Dezember 2022: 23.785.305)			
161.595	Johnson Controls International plc	9.327.263	2,10
157.723	Medtronic Plc	13.050.001	2,94
Italien - 6.948.363			
(31. Dezember 2022: 8.042.171)			
930.542	Enel SpA	6.948.363	1,56
Republik Korea - 12.362.031			
(31. Dezember 2022: 11.977.057)			
255.760	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	12.362.031	2,78
Spanien - 8.205.927			
(31. Dezember 2022: 10.271.623)			
187.570	Industria de Diseno Textil SA	8.205.927	1,85
Schweiz - 37.031.159			
(31. Dezember 2022: 43.213.549)			
56.427	Garmin Ltd	7.267.233	1,63
89.352	Nestle SA	10.378.911	2,33
45.465	Roche Holding AG	13.227.220	2,98
11.773	Zurich Insurance Group AG	6.157.795	1,39

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Taiwan - 13.545.120			
(31. Dezember 2022: -)			
926.000	Chroma ATE Inc	6.419.136	1,45
216.000	MediaTek Inc	7.125.984	1,60
Vereinigtes Königreich - 23.535.268			
(31. Dezember 2022: 73.987.500)			
255.746	Anglo American Plc	6.475.618	1,46
270.713	Shell Plc	8.843.825	1,99
258.180	Smiths Group Plc	5.806.098	1,31
1.297.682	Taylor Wimpey Plc	2.409.727	0,54
Vereinigte Staaten von Amerika - 195.438.567			
(31. Dezember 2022: 239.875.764)			
75.553	AbbVie Inc	11.695.604	2,63
52.964	Allstate Corp/The	7.406.221	1,67
77.834	Carter's Inc	5.850.782	1,32
163.454	Chemours Co/The	5.254.229	1,18
87.122	Chesapeake Energy Corp	6.754.569	1,52
212.210	Cisco Systems Inc	10.713.422	2,41
55.849	CME Group Inc	11.788.607	2,65
116.191	CMS Energy Corp	6.738.497	1,52
188.551	Dominion Energy Inc	8.876.981	2,00
259.116	Exelon Corp	9.290.604	2,09
133.016	Gilead Sciences Inc	10.794.914	2,43
21.142	Goldman Sachs Group Inc/The	8.174.237	1,84
235.589	Interpublic Group of Cos Inc/The	7.759.124	1,75
39.596	JPMorgan Chase & Co	6.743.397	1,52
453.764	Kenvue Inc	9.740.044	2,19
282.818	Kraft Heinz Co/The	10.392.147	2,34
23.443	Marathon Petroleum Corp	3.444.597	0,77
72.127	Paychex Inc	8.618.455	1,94
67.575	PepsiCo Inc	11.445.516	2,57
69.958	Procter & Gamble Co/The	10.196.029	2,29
128.847	Sysco Corp	9.412.273	2,12
52.194	Texas Instruments Inc	8.963.015	2,02
100.313	Tyson Foods Inc - Class A	5.385.303	1,21
Gesamtanlagen in Aktien		431.367.960	97,08
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 421.153 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 152.005)		421.153	0,09
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		431.789.113	97,17
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (3.573) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (5.308))		(3.573)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(3.573)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		12.561.638	2,83
Summe Nettovermögen		444.347.178	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,80	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,09	
Sonstiges Umlaufvermögen		3,11	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	34.212	37.714	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
Euro	US-Dollar	33.384	36.612	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	384
Euro	US-Dollar	85.435	94.052	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	625
Euro	US-Dollar	35.996	38.892	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	998
Euro	US-Dollar	4.888.562	5.261.733	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	155.670
USD						157.876
EUR						142.526
Euro	US-Dollar	49.115	54.609	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(181)
US-Dollar	Euro	30.122	27.559	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(418)
US-Dollar	Euro	44.671	40.616	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(339)
USD						(938)
EUR						(847)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	34.267	37.775	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	199
Euro	US-Dollar	33.438	36.671	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	385
Euro	US-Dollar	85.520	94.146	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	626
Euro	US-Dollar	36.261	39.178	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.006
Euro	US-Dollar	4.924.548	5.300.466	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	156.816
US-Dollar	Euro	169	152	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
USD						159.033
EUR						143.571
Euro	US-Dollar	152	169	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	49.195	54.697	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(181)
US-Dollar	Euro	44.743	40.682	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(340)
US-Dollar	Euro	30.170	27.603	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(419)
US-Dollar	Euro	30.497	28.246	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(804)
USD						(1.745)
EUR						(1.575)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
US-Dollar	Euro	185	167	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	18.983	20.927	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	110
Euro	US-Dollar	4.994	5.512	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23
Euro	US-Dollar	18.646	20.448	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	214
Euro	US-Dollar	192	211	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	47.683	52.492	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	349
Euro	US-Dollar	20.101	21.718	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	557
Euro	US-Dollar	2.719.751	2.927.365	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	86.607
USD						87.863
EUR						79.320

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	167	185	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	27.574	30.659	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(101)
US-Dollar	Euro	24.606	22.372	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(187)
US-Dollar	Euro	21.070	19.244	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(255)
US-Dollar	Euro	16.427	15.029	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(228)
USD						(772)
EUR						(697)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	402	364	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	364	402	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	3.217	3.547	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	341.516	376.893	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.568
Euro	US-Dollar	3.159	3.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	36
Euro	US-Dollar	8.047	8.859	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	3.393	3.666	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	94
Euro	US-Dollar	458.623	493.632	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14.604
USD						16.381
EUR						14.788
Euro	US-Dollar	8.103	9.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Euro	4.162	3.785	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Euro	1.493	1.364	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Euro	2.756	2.521	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(38)
USD						(118)
EUR						(107)

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Australien - 428.512			
(31. Dezember 2022: 287.285)			
120.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	114.872	0,10
310.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125 % 15-Apr-2032	313.640	0,27
Bermudas - 1.138.877			
(31. Dezember 2022: 246.181)			
351.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	343.248	0,30
245.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875 % 15-Feb-2027	243.479	0,21
199.000	NCL Corp Ltd '144A' 8.125% 15-Jan-2029	209.575	0,18
321.000	Viking Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jul-2031	342.575	0,30
Kanada - 5.081.536			
(31. Dezember 2022: 2.014.614)			
333.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	315.424	0,27
327.000	Bausch & Lomb Escrow Corp '144A' 8.375% 01-Oct-2028	346.842	0,30
410.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 11.000% 30-Sep-2028	294.183	0,26
277.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Feb-2029	283.695	0,25
140.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	140.297	0,12
290.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	268.372	0,23
305.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	282.433	0,25
280.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	277.363	0,24
150.000	GFL Environmental Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2031	154.992	0,14
186.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	185.650	0,16
420.000	Northriver Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	407.765	0,35
663.000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5.000% 01-May-2025	648.750	0,56
320.000	NOVA Chemicals Corp '144A' 8.500% 15-Nov-2028	336.386	0,29
298.000	Ontario Gaming GTA LP '144A' 8.000% 01-Aug-2030	307.634	0,27
598.000	Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026	567.931	0,49
423.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	263.819	0,23
Tschechische Republik - 224.473			
(31. Dezember 2022: 732.837)			
210.000	Allwyn International AS 'REGS' 3.875% 15-Feb-2027	224.473	0,20
Frankreich - 4.005.224			
(31. Dezember 2022: 2.361.997)			
950.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	776.903	0,68
230.000	Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027	227.266	0,20
473.000	Emeria SASU 'REGS' 7.750% 31-Mar-2028	509.162	0,44
407.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	406.520	0,35
400.000	Iliad SA 5.375% 15-Feb-2029	454.841	0,40
286.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 5.125% 15-May-2025	234.462	0,20
570.000	Loxam SAS 5.750% 15-Jul-2027	620.693	0,54
330.000	Loxam SAS 'REGS' 6.375% 31-May-2029	379.706	0,33
343.000	Rexel SA 5.250% 15-Sep-2030	395.671	0,34
Deutschland - 2.241.504			
(31. Dezember 2022: 1.899.068)			
330.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	313.358	0,27
205.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	201.294	0,17
230.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	250.053	0,22
430.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 8.750% 15-May-2028	521.561	0,45
310.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	249.211	0,22
407.000	Standard Profil Automotive GmbH 'REGS' 6.250% 30-Apr-2026	352.209	0,31
330.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	353.818	0,31

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Irland - 3.099.383			
(31. Dezember 2022: 2.461.113)			
400.000	C&W Senior Financing DAC '144A' 6.875% 15-Sep-2027	371.689	0,32
500.000	Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 10.045% 15-Mar-2032	529.147	0,46
410.000	Energia Group Roi Financeco DAC 'REGS' 6.875% 31-Jul-2028	472.559	0,41
500.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 8.025% 15-Mar-2032	549.174	0,48
300.000	Harvest CLO XXI DAC FRN 10.155% 15-Jul-2031	322.000	0,28
480.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	448.546	0,39
345.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	406.268	0,35
Italien - 1.599.014			
(31. Dezember 2022: 1.988.255)			
230.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' 10.000% 06-Feb-2028	262.924	0,23
400.000	Lottomatica SpA/Roma 'REGS' 7.125% 01-Jun-2028	469.031	0,41
566.000	Shiba Bidco SpA 'REGS' 4.500% 31-Oct-2028	589.516	0,51
235.000	Telecom Italia SpA/Milano 6.875% 15-Feb-2028	277.543	0,24
Liberia - 933.492			
(31. Dezember 2022: 703.628)			
108.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	104.328	0,09
518.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	514.140	0,45
229.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2030	239.464	0,21
70.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	75.560	0,06
Luxemburg - 4.919.096			
(31. Dezember 2022: 6.419.175)			
320.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026	354.333	0,31
200.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	176.261	0,15
260.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	238.503	0,21
871.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	566.487	0,49
510.000	Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027	322.285	0,28
280.000	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	156.899	0,14
340.000	B&M European Value Retail SA 8.125% 15-Nov-2030	461.343	0,40
247.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028	297.488	0,26
365.000	Ephios Subco 3 Sarl 'REGS' 7.875% 31-Jan-2031	417.881	0,36
250.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025	221.602	0,19
625.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	612.517	0,53
360.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	328.836	0,29
380.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	404.417	0,35
350.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	360.244	0,31
Niederlande - 4.229.904			
(31. Dezember 2022: 4.955.628)			
310.000	Boels Topholding BV 'REGS' 6.250% 15-Feb-2029	359.852	0,31
500.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	459.753	0,40
292.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV 'REGS' 8.500% 15-Jan-2031	403.988	0,35
630.000	House of HR Group BV 'REGS' 9.000% 03-Nov-2029	723.169	0,63
380.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	369.956	0,32
354.017	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	389.905	0,34
580.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	623.340	0,54
320.000	United Group BV 'REGS' 3.125% 15-Feb-2026	341.172	0,30
573.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	558.769	0,48

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Panama - 1.172.604			
(31. Dezember 2022: 533.949)		1.172.604	1,02
506.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	487.530	0,43
123.000	Carnival Corp '144A' 7.000 % 15-Aug-2029	128.402	0,11
375.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	381.501	0,33
160.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	175.171	0,15
Spanien - 827.099			
(31. Dezember 2022: 431.829)		827.099	0,72
180.000	Green Bidco SA 'REGS' 10.250% 15-Jul-2028	174.760	0,15
360.000	Grupo Antolin-Irausa SA 'REGS' 3.500% 30-Apr-2028	304.965	0,27
320.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	347.374	0,30
Schweden - 1.568.728			
(31. Dezember 2022: 652.438)		1.568.728	1,36
303.000	Assemblin Group AB 'REGS' FRN 8.964% 05-Jul-2029	341.953	0,30
500.000	Intrum AB 'REGS' 4.875% 15-Aug-2025	519.475	0,45
220.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	240.017	0,21
440.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029	467.283	0,40
Vereinigtes Königreich - 3.934.212			
(31. Dezember 2022: 4.203.353)		3.934.212	3,42
535.000	Allwyn Entertainment Financing UK Plc 'REGS' 7.250% 30-Apr-2030	625.859	0,54
360.000	BCP V Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	371.161	0,32
170.000	Boparan Finance Plc 'REGS' 7.625% 30-Nov-2025	193.103	0,17
210.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 8.500% 15-Mar-2029	245.824	0,21
290.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	284.456	0,25
460.000	International Game Technology Plc 'REGS' 2.375% 15-Apr-2028	475.296	0,41
490.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.625% 15-Nov-2027	576.481	0,50
330.000	Very Group Funding Plc/The 'REGS' 6.500% 01-Aug-2026	365.123	0,32
480.000	Victoria Plc 3.750% 15-Mar-2028	366.030	0,32
200.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	194.412	0,17
190.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 5.000% 15-Apr-2027	236.467	0,21
Vereinigte Staaten von Amerika - 74.551.027			
(31. Dezember 2022: 74.253.254)		74.551.027	64,75
660.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	600.112	0,52
340.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	339.375	0,29
207.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	199.441	0,17
460.000	Advance Auto Parts Inc 5.950% 09-Mar-2028	458.981	0,40
614.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	616.100	0,54
290.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	282.615	0,25
450.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	447.320	0,39
500.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Apr-2028	515.071	0,45
220.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	219.544	0,19
141.667	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	140.954	0,12
347.732	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	341.589	0,30
345.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	343.571	0,30
280.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	277.331	0,24
405.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	389.087	0,34
439.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	438.969	0,38

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
380.000	Arsenal AIC Parent LLC '144A' 8.000% 01-Oct-2030	396.952	0,34
310.000	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	294.325	0,26
270.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	242.087	0,21
775.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	702.418	0,61
722.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 8.000% 15-Feb-2031	722.799	0,63
230.000	Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	234.988	0,20
265.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.125% 15-May-2029	241.700	0,21
290.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2026	282.545	0,25
555.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	552.031	0,48
386.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	351.872	0,31
330.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2030	340.256	0,30
185.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	176.378	0,15
588.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	541.852	0,47
547.000	Camelot Return Merger Sub Inc '144A' 8.750% 01-Aug-2028	555.984	0,48
242.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	265.047	0,23
624.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	536.129	0,47
290.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	235.620	0,20
132.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	120.733	0,10
230.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	223.528	0,19
550.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 7.375 % 01-Mar-2031	565.113	0,49
465.000	Central Parent Inc / CDK Global Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2029	477.290	0,41
430.000	Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	451.273	0,39
548.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	537.870	0,47
473.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	396.820	0,34
450.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	418.169	0,36
84.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	83.707	0,07
430.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	411.020	0,36
314.000	Citigroup Inc FRN (Perpetual) 3.875% 18-Feb-2026	279.608	0,24
413.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.750 % 15-May-2028	425.578	0,37
350.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	384.846	0,33
230.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	220.831	0,19
330.000	Clean Harbors Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2031	336.243	0,29
249.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	237.949	0,21
360.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 9.000% 15-Sep-2028	374.349	0,33
350.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Jan-2032	304.818	0,26
291.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	293.931	0,26
418.000	Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	397.261	0,35
350.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 6.625% 15-Apr-2029	344.600	0,30
481.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Apr-2030	449.105	0,39
345.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	347.004	0,30
680.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	623.528	0,54
390.000	Condor Merger Sub Inc '144A' 7.375% 15-Feb-2030	358.467	0,31
280.000	Coty Inc 'REGS' 5.750% 15-Sep-2028	326.473	0,28
95.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	81.326	0,07
124.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	109.082	0,09
360.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	342.999	0,30

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
230.000	CSC Holdings LLC 5.250% 01-Jun-2024	224.518	0,20
570.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	504.478	0,44
280.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	256.112	0,22
300.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	186.294	0,16
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 11.250% 15-May-2028	205.317	0,18
469.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	464.727	0,40
370.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	347.065	0,30
401.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	280.576	0,24
924.000	DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	966.449	0,84
237.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	218.188	0,19
505.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	508.939	0,44
586.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	601.368	0,52
190.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	173.589	0,15
360.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	339.573	0,30
410.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.250% 01-Jun-2028	448.312	0,39
280.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 5.375% 15-Feb-2026	340.873	0,30
602.000	Energy Transfer LP FRN (Perpetual) 6.625% 15-Feb-2028	504.863	0,44
483.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	495.169	0,43
580.000	Entegris Escrow Corp '144A' 5.950% 15-Jun-2030	576.896	0,50
779.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	775.432	0,67
526.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	479.018	0,42
360.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	341.858	0,30
380.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 4.625% 15-Jan-2029	345.108	0,30
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	180.090	0,16
894.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	847.847	0,74
270.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	241.976	0,21
186.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	179.686	0,16
240.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	214.680	0,19
563.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750 % 15-May-2030	581.881	0,51
670.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	681.917	0,59
740.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	726.902	0,63
120.000	Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026	116.943	0,10
187.000	Gray Television Inc '144A' 7.000% 15-May-2027	176.863	0,15
330.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 7.750% 01-Sep-2030	346.089	0,30
271.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC '144A' 7.500% 15-Jan-2031	287.294	0,25
384.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	353.483	0,31
480.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	440.755	0,38
610.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	597.050	0,52
400.000	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	343.639	0,30
290.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	285.559	0,25
470.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	399.472	0,35
390.000	JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 5.000% 01-Aug-2024	385.086	0,33
504.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	446.844	0,39
312.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	303.663	0,26
230.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	223.903	0,19
270.000	LABL Inc '144A' 9.500% 01-Nov-2028	273.020	0,24
220.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	211.155	0,18
455.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	449.968	0,39
786.000	LifePoint Health Inc '144A' 9.875% 15-Aug-2030	794.558	0,69
429.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	277.220	0,24
91.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	83.108	0,07
208.000	Mativ Holdings Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	199.713	0,17

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
380.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.875% 15-Aug-2026	389.159	0,34
140.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 9.250% 15-Apr-2027	138.316	0,12
272.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	246.388	0,21
132.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	125.191	0,11
530.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	502.882	0,44
340.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	339.423	0,29
485.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	470.248	0,41
368.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	343.865	0,30
190.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	188.453	0,16
490.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	452.216	0,39
344.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	328.051	0,28
255.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 7.250% 15-Jan-2029	267.193	0,23
260.000	Noble Finance II LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2030	271.390	0,24
430.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	435.729	0,38
380.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	357.765	0,31
270.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875 % 15-Feb-2032	231.498	0,20
260.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	252.087	0,22
270.000	NRG Energy Inc '144A' FRN (Perpetual) 10.250% 15-Mar-2028	281.901	0,24
360.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 9.625% 15-Nov-2028	428.596	0,37
193.000	OneMain Finance Corp 7.875% 15-Mar-2030	199.491	0,17
630.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	567.281	0,49
260.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	238.967	0,21
327.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	316.297	0,27
370.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	344.970	0,30
385.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	359.339	0,31
439.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	432.974	0,38
382.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 7.875% 15-Dec-2029	394.346	0,34
450.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	423.309	0,37
500.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	489.857	0,43
455.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	444.139	0,39
285.000	Pike Corp '144A' 8.625% 31-Jan-2031	300.872	0,26
437.000	Pilgrim's Pride Corp 3.500% 01-Mar-2032	370.078	0,32
650.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	629.702	0,55
105.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	97.241	0,08
580.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	576.154	0,50
336.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	290.602	0,25
220.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2028	227.075	0,20
307.000	Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Mar-2031	329.162	0,29
872.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	859.012	0,75
374.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	336.787	0,29
387.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	367.583	0,32
305.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	282.052	0,25
580.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	532.973	0,46
390.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	352.328	0,31
241.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	226.533	0,20
310.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 9.500% 15-Jul-2028	366.943	0,32
315.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	277.378	0,24
590.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	571.707	0,50

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
370.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	343.709	0,30
280.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	273.924	0,24
379.000	Sitio Royalties Operating Partnership LP / Sitio Finance Corp '144A' 7.875% 01-Nov-2028	392.970	0,34
785.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	796.320	0,69
247.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 9.750% 15-Nov-2030	266.160	0,23
481.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	449.266	0,39
410.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	405.784	0,35
247.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	238.412	0,21
500.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	467.106	0,41
130.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	94.361	0,08
302.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 7.250% 15-Jan-2031	321.667	0,28
226.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	218.921	0,19
400.000	TEGNA Inc '144A' 4.750 % 15-Mar-2026	389.485	0,34
290.000	Tenet Healthcare Corp 4.250 % 01-Jun-2029	270.263	0,23
530.000	Tenet Healthcare Corp 4.625 % 15-Jun-2028	506.765	0,44
370.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.750% 15-May-2031	380.157	0,33
424.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	397.843	0,35
190.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	186.786	0,16
199.000	TransDigm Inc '144A' 6.750% 15-Aug-2028	204.532	0,18
370.000	TransDigm Inc '144A' 6.875% 15-Dec-2030	380.639	0,33
90.000	TransDigm Inc '144A' 7.125% 01-Dec-2031	94.649	0,08
500.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	478.942	0,42
418.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	371.422	0,32
400.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	371.080	0,32
304.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	298.230	0,26
425.000	US Foods Inc '144A' 6.875% 15-Sep-2028	438.281	0,38
549.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	466.467	0,41
260.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	230.333	0,20
214.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2030	213.148	0,19
544.000	Venture Global LNG Inc '144A' 8.125% 01-Jun-2028	551.189	0,48
323.000	Verde Purchaser LLC '144A' 10.500% 30-Nov-2030	327.441	0,28
137.000	Vistra Corp '144A' FRN (Perpetual) 7.000% 15-Dec-2026	135.779	0,12
547.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	507.978	0,44
220.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 7.750% 15-Oct-2031	228.849	0,20
340.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	327.676	0,28
458.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	448.854	0,39
632.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	608.962	0,53
40.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	39.950	0,03
446.000	Windsor Holdings III LLC '144A' 8.500% 15-Jun-2030	468.414	0,41
360.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	317.887	0,28
362.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	355.810	0,31
340.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	328.702	0,29
324.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	258.761	0,22
Gesamtanlagen in Anleihen		109.954.685	95,50
Aktien			
	Vereinigte Staaten von Amerika - 13.713		
	(31. Dezember 2022: 19.131)	13.713	0,01
4.200	Altice USA Inc	13.713	0,01
Gesamtanlagen in Aktien		13.713	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)			
	Vereinigte Staaten von Amerika - 1.695.020		
	(31. Dezember 2022: 1.436.545)	1.695.020	1,47
370.000	Asurion LLC Term Loan 10.713% 03-Feb-2028	353.504	0,30
210.581	First Brands Group LLC Term Loan 10.881% 30-Mar-2027	209.264	0,18
80.825	Indy U.S. Holdco LLC Term Loan 0.000% 05-Mar-2028	79.276	0,07
354.113	Indy U.S. Holdco LLC Term Loan 11.598% 05-Mar-2028	347.325	0,30
219.450	MH Sub I LLC 9.598% 03-May-2028	216.109	0,19
80.891	MPH Acquisition Holdings LLC Term Loan 9.916% 01-Sep-2028	78.079	0,07
188.500	Neptune Bidco U.S. Inc Term Loan 10.507% 11-Apr-2029	172.814	0,15
308.805	Quest Software US Holdings Inc Term Loan 9.783% 01-Feb-2029	238.649	0,21
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		1.695.020	1,47
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 977.638 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 325.072)		977.638	0,85
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		112.641.056	97,83
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (354.649) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (565.872))		(354.649)	(0,31)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(354.649)	(0,31)
Nettoumlaufvermögen		2.850.998	2,48
Summe Nettovermögen		115.137.405	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			94,98
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			1,46
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,84
Sonstiges Umlaufvermögen			2,72
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
Euro	US-Dollar	400.000	432.349	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	10.922
Euro	US-Dollar	100.000	107.730	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	3.088
Euro	US-Dollar	250.000	272.156	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	4.889
Pfund Sterling	US-Dollar	590.000	751.949	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	52
Pfund Sterling	US-Dollar	500.000	631.713	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	5.576
USD						24.527
US-Dollar	Euro	271.293	250.000	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(5.752)
US-Dollar	Euro	19.937.927	18.230.000	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(284.179)
US-Dollar	Euro	274.307	250.000	12. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(2.737)
US-Dollar	Euro	393.516	360.000	12. Jan. 24	Goldman Sachs International	(5.429)
US-Dollar	Pfund Sterling	120.790	95.000	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(295)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.398.419	4.295.000	12. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(75.888)
USD						(354.280)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	28.329	30.932	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	462
Euro	US-Dollar	1.582.011	1.702.775	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	50.377
USD						50.839
EUR						45.896
Euro	US-Dollar	10.560	11.741	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(39)
USD						(39)
EUR						(35)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	237.373	259.182	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.869
Euro	US-Dollar	13.235.716	14.246.071	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	421.474
USD						425.343
EUR						383.988
Euro	US-Dollar	89.459	99.466	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(329)
USD						(329)
EUR						(297)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	75.330	83.041	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	438
Euro	US-Dollar	256.984	280.595	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.189
Euro	US-Dollar	14.234.745	15.321.361	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	453.286
USD						457.913
EUR						413.391
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	1.094	1.393	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	5.261	6.686	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
Pfund Sterling	US-Dollar	17.639	22.424	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	59

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	975.271	1.224.120	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18.937
USD						19.016
GBP						14.920
US-Dollar	Pfund Sterling	1.393	1.094	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
GBP						(1)

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Belgien - 1.317.797			
(31. Dezember 2022: 1.506.890)			
140.255	Proximus SADP	1.317.797	1,38
Kanada - 1.295.982			
(31. Dezember 2022: 2.538.138)			
35.982	Enbridge Inc	1.295.982	1,36
China - 3.821.708			
(31. Dezember 2022: 3.271.089)			
4.254.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	3.821.708	4,00
Frankreich - 18.057.622			
(31. Dezember 2022: 21.755.705)			
99.867	Bouygues SA	3.760.566	3,94
15.092	Engie SA	265.223	0,28
506.167	Orange SA	5.757.143	6,02
102.183	Veolia Environnement SA	3.223.965	3,37
40.221	Vinci SA	5.050.725	5,28
Deutschland - 3.429.028			
(31. Dezember 2022: 6.520.007)			
69.183	Deutsche Post AG	3.429.028	3,59
Italien - 2.705.834			
(31. Dezember 2022: 9.267.733)			
100.129	Enel SpA	743.972	0,78
343.075	Italgas SpA	1.961.862	2,05
Norwegen - 2.521.351			
(31. Dezember 2022: 1.179.714)			
223.425	SFL Corp Ltd	2.521.351	2,64
Spanien - 4.699.402			
(31. Dezember 2022: 10.593.785)			
96.829	Enagas SA	1.631.476	1,71
22.327	Endesa SA	454.938	0,48
158.802	Redeia Corp SA	2.612.988	2,73
Vereinigtes Königreich - 4.849.308			
(31. Dezember 2022: 12.374.507)			
500.036	Drax Group Plc	3.122.482	3,27
72.973	SSE Plc	1.726.826	1,80
Vereinigte Staaten von Amerika - 52.022.671			
(31. Dezember 2022: 52.290.106)			
409.131	Antero Midstream Corp	5.124.366	5,36
152.793	AT&T Inc	2.567.686	2,69
266.730	Clearway Energy Inc	7.317.738	7,66
172.516	Dominion Energy Inc	8.108.252	8,48
112.761	Exelon Corp	4.048.684	4,24
145.104	Hess Midstream LP - Class A	4.587.463	4,80
166.082	NextEra Energy Partners LP (Units)	5.049.723	5,28
59.256	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	1.816.493	1,90
56.992	ONEOK Inc	4.001.123	4,19
151.222	PPL Corp	4.098.872	4,29
16.630	Verizon Communications Inc	626.868	0,65
61.001	Vistra Corp	2.348.843	2,46

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
66.788	Williams Cos Inc/The	2.326.560	2,43
Gesamtanlagen in Aktien		94.720.703	99,11
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 376.927 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 169.662)		376.927	0,40
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		95.097.630	99,51
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (8.536) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (55.727))		(8.536)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(8.536)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		481.906	0,50
Summe Nettovermögen		95.571.000	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,96
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,39
Sonstiges Umlaufvermögen	0,65
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	7.000	7.692	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	39
Euro	US-Dollar	4.356	4.781	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Euro	US-Dollar	4.137	4.524	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	45
Euro	US-Dollar	11.965	13.168	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Euro	US-Dollar	650.738	700.087	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18.605
USD						18.764
EUR						16.997
Euro	US-Dollar	5.121	5.689	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
Euro	US-Dollar	5.182	5.723	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	7.384	6.713	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Euro	4.312	3.923	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	9.216	8.424	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(88)
US-Dollar	Euro	3.938	3.645	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(87)
USD						(259)
EUR						(235)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	10.475	11.499	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	71
Euro	US-Dollar	9.949	10.879	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	109
Euro	US-Dollar	28.774	31.668	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	111
Euro	US-Dollar	1.564.943	1.683.622	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44.742
USD						45.033
EUR						40.793
Euro	US-Dollar	12.118	13.461	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(78)
Euro	US-Dollar	12.329	13.619	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	9.492	8.620	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(28)
US-Dollar	Euro	17.572	15.974	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(69)
US-Dollar	Euro	10.369	9.435	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(51)
US-Dollar	Euro	22.162	20.259	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(212)
US-Dollar	Euro	9.471	8.765	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(209)
USD						(649)
EUR						(588)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.725	1.906	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.467	1.610	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	1.393	1.523	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	4.016	4.420	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	218.013	234.546	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.233
USD						6.274
EUR						5.683

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	1.740	1.933	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	2.441	2.219	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Euro	1.422	1.294	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	3.080	2.816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Euro	1.289	1.193	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
USD						(86)
EUR						(78)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	80	88	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	68	75	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	65	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	186	205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	10.125	10.893	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	289
US-Dollar	Euro	66	60	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						291
EUR						264
Euro	US-Dollar	81	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	113	103	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	143	131	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	60	55	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(4)
EUR						(4)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	9.101	6.887	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.984	1.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.895	5.943	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	42
Singapur-Dollar	US-Dollar	500	376	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Singapur-Dollar	US-Dollar	8.094	6.084	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
Singapur-Dollar	US-Dollar	992	745	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Singapur-Dollar	US-Dollar	22.577	17.026	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	90
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.221.148	909.516	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16.243
USD						16.464
SGD						21.728
Singapur-Dollar	US-Dollar	9.426	7.161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Singapur-Dollar	11.353	15.109	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(102)
US-Dollar	Singapur-Dollar	39.102	51.869	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(220)
US-Dollar	Singapur-Dollar	5.141	6.891	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(83)
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.899	11.800	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(46)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Singapur-Dollar	5.282	7.016	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(37)

USD (503)SGD (664)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged)

Singapur-Dollar	US-Dollar	143.377	108.506	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	189

Dollar					Million	
Singapur-	US-Dollar	124.586	93.792	12. Jan. 24	The Bank of New York	657

Dollar					Mellon	
Singapur-	US-Dollar	122.458	92.051	12. Jan. 24	The Bank of New York	786

Dollar					Mellon	
Singapur-	US-Dollar	341.877	257.823	12. Jan. 24	The Bank of New York	1.356

Singapur-Dollar	US-Dollar	18.491.511	13.772.550	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	245.966

USD 248,954

SGD	328.557

Singapur-	US-Dollar	148.497	112.814	12. Jan. 24	The Bank of New York	(238)

Dollar					Mellon	
US-Dollar	Singapur-Dollar	140.443	186.221	12. Jan. 24	The Bank of New York	(732)

US-Dollar	Singapur-Dollar	83.389	110.768	12. Jan. 24	The Bank of New York	(584)

US-Dollar	Singapur-Dollar	179.170	238.454	12. Jan. 24	The Bank of New York	(1.603)

US Dollar	Singapore Dollar	1997-98	1998-99	1999-2000	1999-2000	1999-2000
US Dollar	Singapore Dollar	77.940	104.954	12. Jan. 24	The Bank of New York	(1.262)

USD (4.419)SGD (5.832)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	16.160	20.577	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23

Pfund Sterling US-Dollar	13.907	17.634	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	93

Pfund Sterling US-Dollar	13.269	16.874	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	40

Pfund Sterling US-Dollar	2.148.999	2.698.395	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	40.991

USD 41.147

GBP 32.281

Pfund Sterling	US-Dollar	16.829	21.497	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(45)

Pfund Sterling US-Dollar	37.766	48.158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17)

US-Dollar	Pfund Sterling	26.106	20.606	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(161)

US-Dollar	Pfund Sterling	15.601	12.242	12. Jan. 24	The Bank of New York	(5)

US-Dollar	Pfund Sterling	33.265	26.260	12. Jan. 24	Mellon The Bank of New York	(210)

					Mellon	
US-Dollar	Pfund Sterling	137.683	109.509	12. Jan. 24	The Bank of New York	(1911)

US-Dollar	Pfund Sterling	14.708	11.748	12. Jan. 24	Mellon	
					The Bank of New York	(267)

USD (2.616)

GBP (2.052)

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 2.832.643			
(31. Dezember 2022: 1.775.018)			
14.500	CSL Ltd	2.832.643	4,07
Dänemark - 3.260.752			
(31. Dezember 2022: 2.365.981)			
31.600	Novo Nordisk A/S	3.260.752	4,68
Frankreich - 7.434.400			
(31. Dezember 2022: 4.719.140)			
10.440	Air Liquide SA	2.029.595	2,91
5.900	L'Oreal SA	2.934.570	4,22
3.050	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.470.235	3,55
Hongkong - 2.380.031			
(31. Dezember 2022: 2.558.420)			
273.000	AIA Group Ltd	2.380.031	3,42
Japan - 2.508.606			
(31. Dezember 2022: 1.882.292)			
5.700	Keyence Corp	2.508.606	3,60
Niederlande - 3.310.791			
(31. Dezember 2022: 1.779.844)			
4.400	ASML Holding NV	3.310.791	4,76
Spanien - 1.663.009			
(31. Dezember 2022: 617.260)			
38.200	Industria de Diseno Textil SA	1.663.009	2,39
Schweiz - 2.238.223			
(31. Dezember 2022: 1.906.866)			
7.700	Roche Holding AG	2.238.223	3,22
Taiwan - 2.359.779			
(31. Dezember 2022: 1.318.650)			
22.700	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	2.359.779	3,39
Vereinigte Staaten von Amerika - 39.780.075			
(31. Dezember 2022: 26.924.024)			
5.700	Adobe Inc	3.401.389	4,89
9.200	Alphabet Inc	1.296.786	1,86
12.800	Alphabet Inc	1.804.224	2,59
30.100	Amphenol Corp - Class A	2.984.867	4,29
12.250	Automatic Data Processing Inc	2.854.250	4,10
29.950	Edwards Lifesciences Corp	2.284.436	3,28
45.150	Fastenal Co	2.923.914	4,20
9.200	Intuitive Surgical Inc	3.103.896	4,46
4.350	Mastercard Inc	1.855.645	2,67
2.600	Mastercard Inc	1.109.121	1,59
8.750	Microsoft Corp	3.289.650	4,73
8.450	NIKE Inc	916.994	1,32
8.400	NIKE Inc	911.568	1,31
7.100	Old Dominion Freight Line Inc	2.876.991	4,13
17.350	Texas Instruments Inc	2.957.568	4,25
11.850	TJX Cos Inc/The	1.111.589	1,60
15.700	TJX Cos Inc/The	1.472.738	2,12

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
7.450	West Pharmaceutical Services Inc	2.624.449	3,77
Gesamtanlagen in Aktien		67.768.309	97,37
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 49.129 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 6.607)		49.129	0,07
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		67.817.438	97,44
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (4.564) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (989))		(4.564)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(4.564)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		1.785.072	2,57
Summe Nettovermögen		69.597.946	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,23
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,07
Sonstiges Umlaufvermögen	2,70
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	3.857	4.234	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	24
Euro	US-Dollar	3.436	3.782	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	1.651	1.784	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	39
Euro	US-Dollar	2.818	3.040	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	71
Euro	US-Dollar	301.143	323.980	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8.481
US-Dollar	Euro	348.495	313.329	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.580
USD						11.207
EUR						10.152
Euro	US-Dollar	2.707	2.990	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	2.512	2.283	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
Euro	US-Dollar	313.329	348.509	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.461)
USD						(2.471)
EUR						(2.238)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	US-Dollar	40.372	3.971	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Norwegische Krone	US-Dollar	55.982	5.435	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	75
Norwegische Krone	US-Dollar	50.989	4.858	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	160
Norwegische Krone	US-Dollar	25.083	2.294	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	175
Norwegische Krone	US-Dollar	42.198	3.838	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	316
Norwegische Krone	US-Dollar	4.491.102	409.517	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	32.537
US-Dollar	Norwegische Krone	461.378	4.671.980	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.521
USD						34.787
NOK						353.432
US-Dollar	Norwegische Krone	3.279	33.746	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42)
Norwegische Krone	US-Dollar	4.671.980	461.424	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.454)
USD						(1.496)
NOK						(15.199)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	US-Dollar	1.548	152	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Norwegische Krone	US-Dollar	2.174	211	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Norwegische Krone	US-Dollar	1.953	186	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Norwegische Krone	US-Dollar	964	88	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Norwegische Krone	US-Dollar	1.629	148	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Norwegische Krone	US-Dollar	171.512	15.639	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.243
US-Dollar	Norwegische Krone	17.627	178.498	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
USD						1.329
NOK						13.503
US-Dollar	Norwegische Krone	125	1.283	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged) Forts.						
Norwegische Krone	US-Dollar	178.498	17.629	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(56)
USD						(58)
NOK						(589)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)						
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.013	198	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.798	176	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schwe- dische Krone	US-Dollar	867	83	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.489	142	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Schwe- dische Krone	US-Dollar	158.957	15.155	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	605
US-Dollar	Schwedische Krone	119	1.205	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Schwedische Krone	16.661	165.343	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	267
USD						883
SEK						8.906
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.424	143	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	165.343	16.662	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(262)
USD						(264)
SEK						(2.663)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)						
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.136	211	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.882	184	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schwe- dische Krone	US-Dollar	910	87	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.570	150	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Schwe- dische Krone	US-Dollar	165.828	15.810	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	632
US-Dollar	Schwedische Krone	124	1.251	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Schwedische Krone	17.389	172.567	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	279
USD						923
SEK						9.309
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.492	150	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	172.567	17.390	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(273)
USD						(275)
SEK						(2.774)

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Dänemark - 438.215			
	(31. Dezember 2022: 296.540)	438.215	1,43
7.930	Novozymes A/S	438.215	1,43
Frankreich - 496.326			
	(31. Dezember 2022: -)	496.326	1,62
10.107	Dassault Systemes SE	496.326	1,62
Deutschland - 990.186			
	(31. Dezember 2022: 1.157.907)	990.186	3,23
6.402	SAP SE	990.186	3,23
Hongkong - 834.859			
	(31. Dezember 2022: 907.554)	834.859	2,72
95.800	AIA Group Ltd	834.859	2,72
Indien - 674.169			
	(31. Dezember 2022: 569.700)	674.169	2,20
32.834	HDFC Bank Ltd	674.169	2,20
Japan - 1.618.111			
	(31. Dezember 2022: 1.776.435)	1.618.111	5,28
8.500	Ebara Corp	500.667	1,63
12.000	FANUC Corp	351.166	1,15
8.100	Sony Group Corp	766.278	2,50
Niederlande - 1.616.807			
	(31. Dezember 2022: 2.275.569)	1.616.807	5,28
32.373	Universal Music Group NV	927.149	3,03
4.832	Wolters Kluwer NV	689.658	2,25
Republik Korea - 460.798			
	(31. Dezember 2022: 616.631)	460.798	1,50
1.258	Samsung SDI Co Ltd	460.798	1,50
Schweiz - 451.333			
	(31. Dezember 2022: 1.303.025)	451.333	1,47
1.069	Lonza Group AG	451.333	1,47
Taiwan - 663.934			
	(31. Dezember 2022: 297.481)	663.934	2,17
6.341	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	663.934	2,17
Vereinigtes Königreich - 3.752.206			
	(31. Dezember 2022: 2.906.661)	3.752.206	12,24
4.267	AstraZeneca Plc	575.154	1,88
184.320	Barclays Plc	359.610	1,17
17.829	Diageo Plc	650.391	2,12
48.183	Informa Plc	477.887	1,56
25.247	Relx Plc	1.000.627	3,26
29.014	SSE Plc	688.537	2,25
Vereinigte Staaten von Amerika - 18.134.666			
	(31. Dezember 2022: 13.962.605)	18.134.666	59,16
2.592	Accenture Plc - Class A	911.632	2,97
8.649	Alphabet Inc - Class A	1.212.936	3,96
6.936	Amazon.com Inc	1.063.705	3,47
7.138	Apple Inc	1.381.738	4,51
4.773	Applied Materials Inc	778.643	2,54
3.551	CME Group Inc	749.545	2,44
1.938	Cooper Cos Inc/The	735.868	2,40
2.691	Danaher Corp	627.783	2,05
2.281	Ecolab Inc	453.816	1,48
18.644	Exelon Corp	668.481	2,18
2.152	Goldman Sachs Group Inc/The	832.039	2,71
1.449	Hubbell Inc - Class B	475.555	1,55
2.420	Mastercard Inc	1.032.578	3,37
9.172	Medtronic Plc	758.891	2,48
5.643	Microsoft Corp	2.117.733	6,91
1.181	NVIDIA Corp	584.814	1,91
3.989	Progressive Corp/The	631.758	2,06
8.136	Sanofi SA	809.480	2,64

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
5.829	TE Connectivity Ltd	822.676	2,68
3.366	Texas Instruments Inc	578.026	1,89
3.718	Trane Technologies Plc	906.969	2,96
Gesamtanlagen in Aktien		30.131.610	98,30
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 7.519 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 2.548)		7.519	0,02
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		30.139.129	98,32
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (6) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (307))		(6)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(6)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		513.817	1,68
Summe Nettovermögen		30.652.940	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			97,99
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,02
Sonstiges Umlaufvermögen			1,99
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.212	1.336	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	3.349	3.687	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25
Euro	US-Dollar	1.362	1.472	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	38
Euro	US-Dollar	222.847	239.858	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7.096
USD						7.166
EUR						6.469
Euro	US-Dollar	1.497	1.665	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
USD						(6)
EUR						(5)
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	75	84	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	62	69	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	166	183	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	68	73	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.997	11.836	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	350
USD						353
EUR						319

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 4.196.734			
(31. Dezember 2022: 8.932.738)			
4.786.726	Cordiant Digital Infrastructure Ltd./Fund	4.196.734	0,33
Irland - 36.008.944			
(31. Dezember 2022: 83.597.958)			
92.082	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	8.567.295	0,68
8.494	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF	1.224.905	0,10
1.228.800	iShares MSCI India UCITS ETF	9.542.419	0,76
94.267	Leadenhall Ucits IIs Fund Plc	12.229.141	0,97
141.900	VanEck Gold Miners UCITS ETF	4.445.184	0,35
Vereinigtes Königreich - 4.264.964			
(31. Dezember 2022: 4.823.698)			
5.445.880	Riverstone Credit Opportunities Income Plc/The Fund	4.264.964	0,34
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		44.470.642	3,53
Anleihen			
Australien - 27.515.616			
(31. Dezember 2022: 71.993.005)			
45.008.000	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	27.515.616	2,18
Brasilien - 35.643.222			
(31. Dezember 2022: 16.363.056)			
266.574.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	35.643.222	2,83
Frankreich - 74.996.512			
(31. Dezember 2022: 26.882.217)			
5.797.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	4.623.687	0,37
1.066.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 25-Mar-2024	958.574	0,08
2.128.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 23-Jan-2024	1.922.999	0,15
67.730.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	67.491.252	5,35
Deutschland - 5.321.807			
(31. Dezember 2022: 101.334.377)			
5.462.732	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	5.321.807	0,42
Ungarn - 6.297.213			
(31. Dezember 2022: 11.568.133)			
5.255.000	Hungary Government International Bond 1.250% 22-Oct-2025	5.049.109	0,40
1.343.000	OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN 8.750% 15-May-2033	1.248.104	0,10
Indonesien - 8.165.695			
(31. Dezember 2022: -)			
97.716.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	5.680.396	0,45
40.875.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-Feb-2033	2.485.299	0,20
Irland - 4.015.913			
(31. Dezember 2022: 7.484.213)			
4.075.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024	4.015.913	0,32
Italien - 116.870.282			
(31. Dezember 2022: 88.500.523)			
771.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	740.434	0,06
6.163.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	5.918.669	0,47
61.773.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2024	61.717.559	4,89
45.619.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	45.491.604	3,61
2.897.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 7.500% 03-Jun-2026	3.002.016	0,24

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Luxemburg - 1.892.737			
(31. Dezember 2022: 5.361.016)			
1.970.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	1.892.737	0,15
Mexiko - 56.779.047			
(31. Dezember 2022: 21.345.265)			
371.720.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	18.477.994	1,47
799.310.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	38.301.053	3,04
Niederlande - 2.092.716			
(31. Dezember 2022: 2.109.324)			
2.327.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2024	2.092.716	0,17
Rumänien - 5.144.335			
(31. Dezember 2022: -)			
5.634.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.000% 25-May-2034	5.144.335	0,41
Schweiz - 804.387			
(31. Dezember 2022: 6.963.687)			
6.060.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' (Perpetual) 5.250% 11-Feb-2172	629.141	0,05
1.688.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' (Perpetual) 7.250% 12-Mar-2172	175.246	0,01
Vereinigtes Königreich - 23.315.927			
(31. Dezember 2022: 65.293.794)			
2.719.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 9.250% 15-Sep-2028	3.136.256	0,25
2.537.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8.375% 20-Dec-2083	3.097.819	0,25
4.359.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	4.693.226	0,37
3.803.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	4.844.213	0,38
3.352.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	3.756.093	0,30
3.705.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	3.788.320	0,30
Vereinigte Staaten von Amerika - 63.808.187			
(31. Dezember 2022: 115.588.108)			
1.627.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	1.263.422	0,10
2.075.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	1.861.658	0,15
5.512.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	6.144.848	0,49
4.493.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	4.080.388	0,32
1.335.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	1.172.051	0,09
56.034.463	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	49.285.820	3,91
Gesamtanlagen in Anleihen		432.663.596	34,33
Aktien			
Bermudas - 5.818.871			
(31. Dezember 2022: -)			
33.100	RenaissanceRe Holdings Ltd	5.818.871	0,46
Brasilien - 6.186.815			
(31. Dezember 2022: 7.084.474)			
2.287.172	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	6.186.815	0,49
Finnland - 4.966.452			
(31. Dezember 2022: 10.404.228)			
153.191	Neste Oyj	4.966.452	0,39
Frankreich - 9.656.984			
(31. Dezember 2022: 24.841.316)			
6.144	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4.520.448	0,36
57.187	Sanofi SA	5.136.536	0,41
Guernsey - 2.463.223			
(31. Dezember 2022: 2.465.072)			
5.067.095	Amedeo Air Four Plus Ltd	2.463.223	0,20

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Hongkong - 8.208.737			
(31. Dezember 2022: 29.266.825)		8.208.737	0,65
1.043.400	AIA Group Ltd	8.208.737	0,65
Indien - 12.497.621			
(31. Dezember 2022: 11.849.416)		12.497.621	0,99
674.224	HDFC Bank Ltd	12.497.621	0,99
Indonesien - 8.115.198			
(31. Dezember 2022: 8.160.314)		8.115.198	0,64
22.924.500	Bank Mandiri Persero Tbk PT	8.115.198	0,64
Irland - 35.396.369			
(31. Dezember 2022: 87.800.747)		35.396.369	2,81
6.957.745	Greencoat Renewables Plc	7.013.407	0,56
37.962	Linde Plc	14.047.174	1,11
53.509	Ryanair Holdings Plc ADR	6.514.601	0,52
35.515	Trane Technologies Plc	7.821.187	0,62
Japan - 5.961.213			
(31. Dezember 2022: 10.518.963)		5.961.213	0,47
69.800	Sony Group Corp	5.961.213	0,47
Niederlande - 19.496.801			
(31. Dezember 2022: 26.258.026)		19.496.801	1,55
15.373	ASML Holding NV	10.545.878	0,84
346.197	Universal Music Group NV	8.950.923	0,71
Republik Korea - 8.891.104			
(31. Dezember 2022: 10.753.735)		8.891.104	0,71
161.684	Samsung Electronics Co Ltd	8.891.104	0,71
Spanien - 5.817.113			
(31. Dezember 2022: -)		5.817.113	0,46
89.439	Amadeus IT Group SA	5.817.113	0,46
Schweiz - 38.669.744			
(31. Dezember 2022: 36.358.421)		38.669.744	3,07
147.414	Alcon Inc	10.378.334	0,82
20.403	Lonza Group AG	7.776.624	0,62
120.584	Nestle SA	12.644.890	1,00
29.964	Roche Holding AG	7.869.896	0,63
Taiwan - 16.412.322			
(31. Dezember 2022: -)		16.412.322	1,30
173.630	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	16.412.322	1,30
Vereinigtes Königreich - 129.759.108			
(31. Dezember 2022: 245.658.959)		129.759.108	10,29
218.856	3i Group Plc	6.088.813	0,48
230.145	Anglo American Plc	5.260.799	0,42
106.432	AstraZeneca Plc	12.951.247	1,03
1.133.840	BAE Systems Plc	14.487.327	1,15
175.676	Diageo Plc	5.785.460	0,46
872.096	Informa Plc	7.808.605	0,62
602.307	Land Securities Group Plc (REIT)	4.916.171	0,39
503.387	Prudential Plc	5.124.660	0,41
202.295	Reckitt Benckiser Group Plc	12.655.007	1,00
417.271	Relx Plc	14.929.956	1,18
771.872	Rentokil Initial Plc	3.922.306	0,31
875.314	Shell Plc	25.815.037	2,05
228.689	Unilever Plc	10.013.720	0,79
Vereinigte Staaten von Amerika - 184.592.541			
(31. Dezember 2022: 263.527.194)		184.592.541	14,65
47.696	Alphabet Inc - Class A	6.038.537	0,48
114.643	Amazon.com Inc	15.872.213	1,26
33.718	AMETEK Inc	5.026.651	0,40
57.475	CME Group Inc	10.952.264	0,87
108.099	ConocoPhillips	11.369.571	0,90
32.893	Danaher Corp	6.927.515	0,55
13.088	Deere & Co	4.720.400	0,38

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
147.790	Dominion Energy Inc	6.281.442	0,50
22.650	Eli Lilly & Co	11.881.793	0,94
44.719	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	5.959.775	0,47
33.636	Goldman Sachs Group Inc/The	11.740.412	0,93
30.314	Hubbell Inc - Class B	8.981.586	0,71
15.665	Lam Research Corp	11.165.820	0,89
13.180	Mastercard Inc	5.076.923	0,40
82.397	Microsoft Corp	27.915.824	2,22
270.200	Newmont Corp	10.174.273	0,81
45.673	NVIDIA Corp	20.417.608	1,62
22.965	Zoetis Inc	4.089.934	0,32
Gesamtanlagen in Aktien		502.910.216	39,90
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 24.055.521			
(31. Dezember 2022: 93.160.020)		24.055.521	1,91
3.297.625	Bluefield Solar Income Fund Ltd	4.465.763	0,35
4.835.432	International Public Partnerships Ltd	7.633.211	0,61
1.339.650	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	1.567.582	0,13
7.941.342	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	10.388.965	0,82
Luxemburg - 5.105.228			
(31. Dezember 2022: 10.304.208)		5.105.228	0,40
3.124.704	BBGI Global Infrastructure SA	5.105.228	0,40
Vereinigtes Königreich - 31.858.106			
(31. Dezember 2022: 69.380.866)		31.858.106	2,53
16.750.303	BioPharma Credit Plc/The Fund	12.823.199	1,02
8.910.515	Greencoat UK Wind Plc/Funds	15.491.204	1,23
4.691.424	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	3.543.703	0,28
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		61.018.855	4,84
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 16.422.634			
(31. Dezember 2022: 76.982.128)		16.422.634	1,30
38.494	Amundi Physical Gold ETC	2.855.305	0,23
15.844	Invesco Physical Gold ETC	2.853.908	0,23
192.692	iShares Physical Gold ETC	6.998.719	0,55
180.744	iShares Physical Silver ETC	3.714.702	0,29
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		16.422.634	1,30
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Curacao - 6.168.698			
(31. Dezember 2022: -)		6.168.698	0,49
64.390	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	6.168.698	0,49
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		6.168.698	0,49
Optionsscheine			
Luxemburg - 25.378.947			
(31. Dezember 2022: 45.220.630)			
270.190	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	25.378.947	2,02
Vereinigtes Königreich - 84.347.251			
(31. Dezember 2022: 114.475.946)			
380.416	Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	36.722.833	2,91
374.574	Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	35.580.641	2,82
125.810	Goldman Sachs Series 2023-06 Senior Secured Index Linked Notes relating to the Goldman Sachs Systemic Skew US Series 2F Total Return Strategy due 07-May-2025	12.043.777	0,96
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		109.726.198	8,71

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Währungsoptionen - 2.438.973 (31. Dezember 2022: -)				
868	IMM JPY Call 08-Mar-2024 69.500	2.438.973	0,19	
Währungsoptionen insgesamt		2.438.973	0,19	
Börsengehandelte Rohstoffoptionen – 4.935.120 (31. Dezember 2022: -)				
25.786	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 40.500	4.935.120	0,39	
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		4.935.120	0,39	
Indexoptionen - 18.455.072 (31. Dezember 2022: 18.713.558)				
580	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4.850.000	3.272.547	0,26	
741	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4.700.000	7.866.895	0,63	
914	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4.350.000	7.315.630	0,58	
Indexoptionen insgesamt		18.455.072	1,47	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 3.822.453 (31. Dezember 2022: 23.815.255)				
134	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	12.576.790	1.012.866	0,08
290	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	63.255.055	2.023.998	0,16
586	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	108.867.373	785.589	0,07
Offene Terminkontrakte insgesamt			3.822.453	0,31
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 14.876.438 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 23.546.268)			14.876.438	1,18
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			1.217.908.895	96,64
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Währungsoptionen - (1.077.458) (31. Dezember 2022: -)				
(868)	IMM JPY Call 08-Mar-2024 72.000	(1.077.458)	(0,09)	
Währungsoptionen insgesamt			(1.077.458)	(0,09)
Aktioptionen - (91.926) (31. Dezember 2022:)				
(841)	Standard Chartered Plc Put 16-Feb-2024 620.000		(91.926)	(0,01)
Aktioptionen insgesamt			(91.926)	(0,01)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen – (3.491.894) (31. Dezember 2022: -)				
(25.786)	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 43.000		(2.677.070)	(0,21)
(12.894)	iShares Physical Gold Options Put 21-Jun-2024 39.000		(814.824)	(0,07)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt			(3.491.894)	(0,28)

Bestände		Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Optionen auf Futures - (79.599)				
(31. Dezember 2022: -)				
(297)	U.S. Treasury Bond Future Put 26-Jan-2024 120.000		(79.599)	(0,01)
Optionen auf Futures insgesamt			(79.599)	(0,01)
Indexoptionen - (9.881.956)				
(31. Dezember 2022: (9.782.956))				
(580)	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4.950.000		(1.340.435)	(0,11)
(741)	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4.775.000		(4.197.684)	(0,33)
(398)	CBOE S&P 500 Index Put 15-Mar-2024 3.650.000		(125.756)	(0,01)
(914)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4.000.000		(4.218.081)	(0,33)
Indexoptionen insgesamt			(9.881.956)	(0,78)

Bestände		Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (343.300)					
(31. Dezember 2022: (8.472.229))					
1.031	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024		46.992.980	(343.300)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(343.300)	(0,03)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (4.894.675) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (7.204.631))				(4.894.675)	(0,39)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(19.860.808)	(1,59)	
Nettoumlaufvermögen			62.356.013	5,06	
Summe Nettovermögen			1.260.404.100	100,00	

Die Kontrahenten für Währungsoptionen ist UBS AG.
Der Kontrahent für Aktioptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG.
Der Kontrahent für börsengehandelte Rohstoffoptionen ist UBS AG.

Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		89,64
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		0,47
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		2,09
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,33
Sonstiges Umlaufvermögen		6,47
Gesamtvermögen		100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
Euro	Pfund Sterling	277.901.928	241.300.855	16. Jan. 24	State Street Bank	410.134
Pfund Sterling	Euro	1.146.284	1.315.849	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	2.357
Pfund Sterling	Euro	2.326.678	2.653.330	16. Jan. 24	State Street Bank	22.309
Pfund Sterling	Euro	3.525.943	4.050.953	16. Jan. 24	State Street Bank	3.820
Pfund Sterling	Euro	3.342.469	3.834.322	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	9.459
Pfund Sterling	Euro	12.642.563	14.436.464	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	102.264
Pfund Sterling	Euro	1.137.426	1.300.619	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	7.401
Pfund Sterling	Euro	661.273	758.258	16. Jan. 24	State Street Bank	2.195
Pfund Sterling	Euro	4.053.625	4.660.304	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	1.295
Pfund Sterling	Euro	1.875.180	2.142.686	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	13.739
Pfund Sterling	Euro	2.365.844	2.700.224	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	20.455
Pfund Sterling	Euro	48.634.464	55.743.301	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	185.488
Euro	Ungarischer Forint	3.792.368	1.457.065.591	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	10.266
Euro	Ungarischer Forint	3.821.111	1.460.963.530	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	28.891
Euro	US-Dollar	6.013.992	6.584.684	16. Feb. 24	UBS AG	80.558
Euro	US-Dollar	3.276.111	3.558.328	16. Feb. 24	UBS AG	69.715
Euro	US-Dollar	14.727.532	16.235.796	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	97.517
Euro	US-Dollar	4.227.799	4.561.521	16. Feb. 24	State Street Bank	117.430
Euro	US-Dollar	3.281.536	3.548.794	16. Feb. 24	UBS AG	83.731
Euro	US-Dollar	8.022.990	8.835.131	16. Feb. 24	State Street Bank	61.687
Euro	US-Dollar	3.783.899	4.160.095	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	35.253
Euro	US-Dollar		167.810	16. Feb. 24	State Street Bank	2.027
Euro	US-Dollar	24.697.168	26.500.251	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	817.891
Euro	US-Dollar	2.815.240	3.036.025	16. Feb. 24	UBS AG	79.489
Euro	US-Dollar	992.805	1.086.976	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	13.335
Euro	US-Dollar	4.683.438	5.113.701	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	75.501
Euro	US-Dollar	25.673.853	27.955.278	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	483.457
Euro	US-Dollar	362.536.822	389.522.613	16. Feb. 24	UBS AG	11.539.456
Euro	US-Dollar	5.126.292	5.634.867	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	48.735
Euro	US-Dollar	528.225	576.423	16. Feb. 24	UBS AG	8.812
Ungarischer Forint	Euro	2.918.029.121	7.571.626	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	2.696
Schweizer Franken	Euro	4.465.227	4.658.781	16. Feb. 24	UBS AG	174.477
Schweizer Franken	Euro	423.735	450.255	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	8.404
Schweizer Franken	Euro	2.857.536	2.768.241	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	108.333
Schweizer Franken	Euro	1.765.199	1.836.641	16. Feb. 24	State Street Bank	74.048
Schweizer Franken	Euro	2.648.811	2.813.894	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	53.236
Japanischer Yen	Euro	988.931.265	6.349.576	14. Mrz. 24	State Street Bank	11.146
EUR						14.867.007
Pfund Sterling	Euro	4.419.932	5.147.201	16. Jan. 24	State Street Bank	(64.356)
Pfund Sterling	Euro	4.260.528	4.970.064	16. Jan. 24	State Street Bank	(70.531)
Pfund Sterling	Euro	331.016	386.578	16. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.915)
Pfund Sterling	Euro	1.584.203	1.837.453	16. Jan. 24	State Street Bank	(15.647)
Pfund Sterling	Euro	681.857	789.721	16. Jan. 24	State Street Bank	(5.597)
Pfund Sterling	Euro	464.814	534.983	16. Jan. 24	State Street Bank	(455)
Pfund Sterling	Euro	2.255.868	2.597.990	16. Jan. 24	State Street Bank	(3.781)
Pfund Sterling	Euro	430.694	497.736	16. Jan. 24	State Street Bank	(2.445)
Pfund Sterling	Euro	1.471.269	1.696.157	16. Jan. 24	State Street Bank	(4.224)
Pfund Sterling	Euro	1.756.081	2.019.675	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	(212)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	8.839.724	138.279.804.122	16. Jan. 24	State Street Bank	(111.986)
Euro	Schweizer Franken	37.675.316	36.039.793	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.334.932)
Hongkong- Dollar	Euro	7185.872	844.466	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(14.650)
Hongkong- Dollar	Euro	31.259.253	3.644.861	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(35.079)
Hongkong- Dollar	Euro	53.785.133	6.418.376	16. Feb. 24	The Bank of New York Mellon	(207.332)
US-Dollar	Euro	3.248.716	2.962.343	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(34.938)
US-Dollar	Euro	62.267.425	57.953.591	16. Feb. 24	UBS AG	(1.844.648)
US-Dollar	Euro	13.773.644	12.575.310	16. Feb. 24	State Street Bank	(163.931)
US-Dollar	Euro	13.773.644	12.544.988	16. Feb. 24	State Street Bank	(133.609)
US-Dollar	Euro	13.722.191	12.478.974	16. Feb. 24	State Street Bank	(113.958)
US-Dollar	Euro	3.306.188	2.991.237	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(12.043)
US-Dollar	Euro	6.168.753	5.614.480	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(55.840)
US-Dollar	Euro	27.812.111	25.320.549	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(259.160)
US-Dollar	Euro	6.847.208	6.250.538	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(80.544)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
US-Dollar	Euro	2.211.854	2.062.834	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(69.741)
Euro	Australischer Dollar	28.658.835	46.973.238	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(158.046)
Japanischer Yen	Euro	988.931.264	6.366.483	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(5.761)
Japanischer Yen	Euro	1.977.987.161	12.737.130	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(14.885)
EUR						(4.824.246)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	2.458	2.610	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	45
Schweizer Franken	Euro	3.703	3.928	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	71
Schweizer Franken	Euro	5.407	5.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	138
Schweizer Franken	Euro	448.021	474.798	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9.074
EUR						9.328
CHF						8.643
Euro	Schweizer Franken	3.477	3.275	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(59)
EUR						(59)
CHF						(55)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)						
Euro	Singapur-Dollar	6.324	9.227	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
EUR						9
SGD						13
Singapur- Dollar	Euro	7.058	4.840	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
Singapur- Dollar	Euro	10.887	7.473	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(22)
Singapur- Dollar	Euro	15.618	10.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(23)
Singapur- Dollar	Euro	1.259.143	871.205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9.477)
EUR						(9.532)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	6.951	6.035	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
EUR						10
GBP						9
Pfund Sterling	Euro	4.706	5.426	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(13)
Pfund Sterling	Euro	7.219	8.334	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(32)
Pfund Sterling	Euro	10.484	12.161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(103)
Pfund Sterling	Euro	839.808	979.980	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14.070)
EUR						(14.218)
GBP						(12.357)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	11.211	12.331	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	84
EUR						84
USD						93
US-Dollar	Euro	9.703	8.803	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(47)
US-Dollar	Euro	15.001	13.680	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(143)
US-Dollar	Euro	21.940	19.932	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(134)
US-Dollar	Euro	1.718.427	1.596.972	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(46.296)
EUR						(46.620)
USD						(51.641)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 138.107			
(31. Dezember 2022: 213.088)			
181.243	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	138.107	0,34
Irland - 1.199.739			
(31. Dezember 2022: 2.261.901)			
3.799	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	307.201	0,75
267	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF	33.464	0,08
45.574	iShares MSCI India UCITS ETF	307.593	0,76
3.611	Leadenhall Ucits IIs Fund Plc	407.181	1,00
5.300	VanEck Gold Miners UCITS ETF	144.300	0,35
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.337.846	3,28
Anleihen			
Brasilien - 1.129.904			
(31. Dezember 2022: 477.281)			
9.723.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	1.129.904	2,77
Frankreich - 100.516			
(31. Dezember 2022: 699.675)			
145.000	Altice France SA/France 'REGS' 4,125% 15-Jan-2029	100.516	0,25
Indonesien - 263.839			
(31. Dezember 2022: -)			
3.649.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15-Apr-2032	184.361	0,45
1.504.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000% 15-Feb-2033	79.478	0,20
Italien - 214.510			
(31. Dezember 2022: 498.198)			
257.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7,200% 28-Nov-2033	214.510	0,52
Luxemburg - 166.173			
(31. Dezember 2022: 150.175)			
199.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750% 31-Oct-2026	166.173	0,41
Mexiko - 1.826.944			
(31. Dezember 2022: 622.830)			
14.120.000	Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031	610.036	1,50
29.220.000	Mexican Bonos 8,000% 07-Nov-2047	1.216.908	2,98
Rumänien - 169.828			
(31. Dezember 2022: -)			
214.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6,000% 25-May-2034	169.828	0,42
Schweiz - 22.377			
(31. Dezember 2022: 299.036)			
248.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' (Perpetual) 5,250% 11-Feb-2172	22.377	0,05
Vereinigtes Königreich - 9.025.868			
(31. Dezember 2022: 7.728.724)			
220.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8,375% 20-Dec-2083	233.475	0,57
135.000	HSBC Holdings Plc FRN 6,364% 16-Nov-2032	126.328	0,31
118.000	HSBC Holdings Plc FRN 8,201% 16-Nov-2034	130.635	0,32
155.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2,250% 16-Oct-2024	150.955	0,37
2.947.674	United Kingdom Gilt 0,125% 31-Jan-2024	2.936.296	7,20
2.052.513	United Kingdom Gilt 0,250% 31-Jan-2025	1.964.358	4,81
1.500.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 05-Feb-2024	1.491.945	3,66
1.851.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 26-Feb-2024	1.835.470	4,50
176.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4,000% 31-Jan-2029	156.406	0,38

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.915.676			
(31. Dezember 2022: 4.988.737)			
62.000	Ball Corp 2,875% 15-Aug-2030	41.844	0,10
150.000	Sprint Capital Corp 8,750% 15-Mar-2032	145.337	0,36
131.000	Sprint LLC 7,125% 15-Jun-2024	103.399	0,25
33.000	United Airlines Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2026	25.180	0,06
2.092.899	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,250% 15-Apr-2028	1.599.916	3,92
Gesamtanlagen in Anleihen		14.835.635	36,36
Aktien			
Bermudas - 186.861			
(31. Dezember 2022: -)			
1.223	RenaissanceRe Holdings Ltd	186.861	0,46
Brasilien - 201.557			
(31. Dezember 2022: 207.006)			
85.733	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	201.557	0,49
Finnland - 159.876			
(31. Dezember 2022: 294.668)			
5.674	Neste Oyj	159.876	0,39
Frankreich - 311.796			
(31. Dezember 2022: 686.740)			
225	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	143.878	0,35
2.151	Sanofi SA	167.918	0,41
Guernsey - 53.848			
(31. Dezember 2022: 50.366)			
127.451	Amedeo Air Four Plus Ltd	53.848	0,13
Hongkong - 268.036			
(31. Dezember 2022: 780.365)			
39.200	AIA Group Ltd	268.036	0,66
Indien - 400.310			
(31. Dezember 2022: 329.070)			
24.848	HDFC Bank Ltd	400.310	0,98
Indonesien - 243.734			
(31. Dezember 2022: 232.455)			
792.200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	243.734	0,60
Irland - 1.128.463			
(31. Dezember 2022: 2.368.650)			
257.933	Greencoat Renewables Plc	225.969	0,56
1.407	Linde Plc	452.498	1,11
1.979	Ryanair Holdings Plc ADR	209.406	0,51
1.257	Trane Technologies Plc	240.590	0,59
Japan - 192.990			
(31. Dezember 2022: 272.318)			
2.600	Sony Group Corp	192.990	0,47
Niederlande - 628.263			
(31. Dezember 2022: 760.480)			
570	ASML Holding NV	339.845	0,83
12.835	Universal Music Group NV	288.418	0,71
Republik Korea - 285.950			
(31. Dezember 2022: 295.407)			
5.983	Samsung Electronics Co Ltd	285.950	0,70
Spanien - 186.316			
(31. Dezember 2022: -)			
3.296	Amadeus IT Group SA	186.316	0,46
Schweiz - 1.240.448			
(31. Dezember 2022: 1.004.886)			
5.327	Alcon Inc	325.952	0,80

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Schweiz Forts.		
752	Lonza Group AG	249.113	0,61
4.493	Nestle SA	409.491	1,00
1.121	Roche Holding AG	255.892	0,63
	Taiwan - 525.866		
	(31. Dezember 2022: -)	525.866	1,29
6.401	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	525.866	1,29
	Vereinigtes Königreich - 4.151.822		
	(31. Dezember 2022: 6.607.523)	4.151.822	10,18
8.094	3i Group Plc	195.713	0,48
8.364	Anglo American Plc	166.168	0,41
3.918	AstraZeneca Plc	414.368	1,02
42.029	BAE Systems Plc	466.732	1,14
6.571	Diageo Plc	188.078	0,46
30.640	Informa Plc	238.441	0,58
21.131	Land Securities Group Plc (REIT)	149.903	0,37
18.755	Prudential Plc	165.944	0,41
7.525	Reckitt Benckiser Group Plc	409.134	1,00
15.208	Relx Plc	472.928	1,16
28.892	Rentokil Initial Plc	127.602	0,31
32.573	Shell Plc	834.927	2,05
8.458	Unilever Plc	321.884	0,79
	Vereinigte Staaten von Amerika - 5.950.106		
	(31. Dezember 2022: 7.382.954)	5.950.106	14,58
1.798	Alphabet Inc - Class A	197.843	0,48
4.242	Amazon.com Inc	510.438	1,25
1.277	AMETEK Inc	165.459	0,40
2.126	CME Group Inc	352.104	0,86
3.951	ConocoPhillips	361.170	0,88
1.225	Danaher Corp	224.229	0,55
491	Deere & Co	153.911	0,38
5.398	Dominion Energy Inc	199.402	0,49
842	Eli Lilly & Co	383.891	0,94
1.627	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	188.455	0,46
1.247	Goldman Sachs Group Inc/The	378.292	0,93
1.115	Hubbell Inc - Class B	287.122	0,70
586	Lam Research Corp	363.028	0,89
495	Mastercard Inc	165.719	0,41
2.603	Microsoft Corp	766.470	1,88
425	Microsoft Corp	125.144	0,31
10.200	Newmont Corp	333.811	0,82
1.698	NVIDIA Corp	659.728	1,62
865	Zoetis Inc	133.890	0,33
Gesamtanlagen in Aktien		16.116.242	39,50
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
	Guernsey - 769.023		
	(31. Dezember 2022: 1.997.060)	769.023	1,88
118.880	Bluefield Solar Income Fund Ltd	139.922	0,34
178.301	International Public Partnerships Ltd	244.629	0,60
51.152	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	52.021	0,13
292.393	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	332.451	0,81
	Luxemburg - 162.773		
	(31. Dezember 2022: 221.240)	162.773	0,40
114.629	BBGI Global Infrastructure SA	162.773	0,40
	Vereinigtes Königreich - 1.021.039		
	(31. Dezember 2022: 1.758.680)	1.021.039	2,50
622.519	BioPharma Credit Plc/The Fund	414.199	1,01
324.439	Greencoat UK Wind Plc/Funds	490.227	1,20
177.628	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	116.613	0,29
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		1.952.835	4,78

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %	
Börsengehandelte Rohstoffe				
	Irland - 522.290 (31. Dezember 2022: 2.258.069)	522.290	1,28	
1.420	Amundi Physical Gold ETC	91.544	0,22	
640	Invesco Physical Gold ETC	100.193	0,25	
6.726	iShares Physical Gold ETC	212.321	0,52	
6.619	iShares Physical Silver ETC	118.232	0,29	
Jersey - 3.850 (31. Dezember 2022: 385.393)				
173	Wisdomtree Carbon - ETC	3.850	0,01	
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		526.140	1,29	
Partizipationsscheine („P-Notes“)				
	Curacao - 214.821 (31. Dezember 2022: -)	214.821	0,53	
2.580	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	214.821	0,53	
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		214.821	0,53	
Optionsscheine				
	Luxemburg - 713.343 (31. Dezember 2022: 1.144.373)			
8.738	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	713.343	1,75	
Vereinigtes Königreich - 2.827.014 (31. Dezember 2022: 2.970.127)				
14.371	Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	1.205.720	2,95	
14.559	Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	1.201.960	2,95	
5.040	Goldman Sachs Series 2023-06 Senior Secured Index Linked Notes relating to the Goldman Sachs Systemic Skew US Series 2F Total Return Strategy due 07-May-2025	419.334	1,03	
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		3.540.357	8,68	
	Währungsoptionen - 73.264 (31. Dezember 2022: -)			
30	IMM JPY Call 08-Mar-2024 69.500	73.264	0,18	
Währungsoptionen insgesamt		73.264	0,18	
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen - 162.514 (31. Dezember 2022: -)			
977	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 40.500	162.514	0,40	
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		162.514	0,40	
	Indexoptionen - 590.904 (31. Dezember 2022: 538.395)			
21	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4,850.000	102.981	0,25	
28	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4,700.000	258.360	0,64	
33	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4,350.000	229.563	0,56	
Indexoptionen insgesamt		590.904	1,45	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 133.478 (31. Dezember 2022: 670.945)				
6	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	489.439	39.277	0,10
11	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.085.316	66.725	0,16

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
23	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	3.713.728	27.476	0,07
Offene Terminkontrakte insgesamt			133.478	0,33
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 420.606 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 1.037.076)			420.606	1,03
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			39.904.642	97,81

Der Kontrahent für Aktienoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG.
Der Kontrahent für börsengehandelte Rohstoffoptionen ist UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	92,38
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,52
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,14
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,19
Sonstiges Umlaufvermögen	3,77
Gesamtvermögen	100,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Währungsoptionen – (32.366)			
(31. Dezember 2022: –)			
(30)	IMM JPY Call 08-Mar-2024 72.000	(32.366)	(0,08)
Währungsoptionen insgesamt			(32.366)
Aktienoptionen – (2.945)			
(31. Dezember 2022: –)			
(31)	Standard Chartered Plc Put 16-Feb-2024 620.000	(2.945)	(0,01)
Aktienoptionen insgesamt			(2.945)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen – (114.959)			
(31. Dezember 2022: –)			
(977)	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 43.000	(88.156)	(0,22)
(488)	iShares Physical Gold Options Put 21-Jun-2024 39.000	(26.803)	(0,06)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt			(114.959)
Optionen auf Futures – (2.562)			
(31. Dezember 2022: –)			
(11)	U.S. Treasury Bond Future Put 26-Jan-2024 120.000	(2.562)	(0,01)
Optionen auf Futures insgesamt			(2.562)
Indexoptionen – (317.344)			
(31. Dezember 2022: (274.177))			
(21)	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4.950.000	(42.181)	(0,10)
(28)	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4.775.000	(137.858)	(0,34)
(18)	CBOE S&P 500 Index Put 15-Mar-2024 3.650.000	(4.943)	(0,01)
(33)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4.000.000	(132.362)	(0,32)
Indexoptionen insgesamt			(317.344)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte – (11.293)				
(31. Dezember 2022: (219.868))				
39	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.544.973	(11.293)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(11.293)	(0,03)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (87.423) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (608.741))			(87.423)	(0,21)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(568.892)	(1,39)
Nettoumlaufvermögen			1.464.715	3,70
Summe Nettovermögen			40.800.465	100,00

Die Kontrahenten für Währungsoptionen ist UBS AG.

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Ab- rechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
Euro	Pfund Sterling	52.443	45.564	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	40
Euro	Pfund Sterling	84.648	73.535	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	73
Euro	Pfund Sterling	92.334	79.255	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.037
Euro	Pfund Sterling	234.064	200.658	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	2.879
Euro	Pfund Sterling	209.362	179.273	16. Jan. 24	State Street Bank	2.784
Euro	Pfund Sterling	45.279	38.996	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	378
Euro	Pfund Sterling	120.406	104.316	16. Jan. 24	State Street Bank	386
Pfund Sterling	Ungarischer Forint	229.488	100.037.012	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	3.442
Pfund Sterling	Ungarischer Forint	123.575	54.255.590	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	978
Pfund Sterling	US-Dollar	2.461	3.088	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	39
Pfund Sterling	US-Dollar	36.650	46.395	16. Feb. 24	State Street Bank	257
Pfund Sterling	US-Dollar	203.958	257.766	16. Feb. 24	State Street Bank	1.760
Pfund Sterling	US-Dollar	28.713	36.295	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	242
Pfund Sterling	US-Dollar	216.638	271.978	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	3.292
Pfund Sterling	US-Dollar	130.117	163.764	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	1.657
Pfund Sterling	US-Dollar	103.723	129.957	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	1.782
Pfund Sterling	US-Dollar	126.891	160.805	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	751
Pfund Sterling	US-Dollar	283.443	361.330	16. Feb. 24	UBS AG	6
Pfund Sterling	US-Dollar	9.380.484	11.542.892	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	325.937
Pfund Sterling	US-Dollar	810.405	993.588	16. Feb. 24	UBS AG	31.024
Pfund Sterling	US-Dollar	11.540	14.393	16. Feb. 24	State Street Bank	250
Pfund Sterling	US-Dollar	49.884	62.091	16. Feb. 24	State Street Bank	1.179
Pfund Sterling	US-Dollar	834.425	1.037.205	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	20.814
Pfund Sterling	US-Dollar	158.708	197.400	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	3.862
Pfund Sterling	US-Dollar	506.040	642.923	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	1.714
Pfund Sterling	US-Dollar	183.362	231.767	16. Feb. 24	UBS AG	1.557
Schweizer Franken	Pfund Sterling	4.897	4.480	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	134
Schweizer Franken	Pfund Sterling	96.815	88.379	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	2.847
Schweizer Franken	Pfund Sterling	93.405	84.675	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	3.338
Schweizer Franken	Pfund Sterling	60.844	55.627	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	1.705
Schweizer Franken	Pfund Sterling	154.022	141.040	16. Feb. 24	UBS AG	4.091
Japanischer Yen	Euro	37.832.649	242.910	14. Mrz. 24	State Street Bank	371
GBP						420.606
Euro	Pfund Sterling	522.122	455.807	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.781)
Euro	Pfund Sterling	289.644	253.331	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.463)
Euro	Pfund Sterling	42.592	37.299	16. Jan. 24	State Street Bank	(262)
Euro	Pfund Sterling	35.021	30.608	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	(154)
Euro	Pfund Sterling	29.958	26.217	16. Jan. 24	State Street Bank	(166)
Pfund Sterling	Euro	33.533	38.842	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(243)
Pfund Sterling	Euro	42.029	48.680	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(302)
Pfund Sterling	Euro	5.036.961	5.802.016	16. Jan. 24	JPMorgan Chase Bank	(8.347)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	333.464	5.216.377.335	16. Jan. 24	State Street Bank	(3.674)
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	576.340	58.220	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(282)
Ungarischer Forint	Pfund Sterling	101.290.499	229.488	16. Feb. 24	UBS AG	(610)
Ungarischer Forint	Pfund Sterling	54.255.590	124.464	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(1.867)
Pfund Sterling	Schweizer Franken	1.344.199	1.473.749	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(44.477)
Pfund Sterling	US-Dollar	129.503	165.386	16. Feb. 24	UBS AG	(230)
US-Dollar	Pfund Sterling	121.512	96.265	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(948)
US-Dollar	Pfund Sterling	779.773	614.207	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.533)
US-Dollar	Pfund Sterling	145.061	114.573	16. Feb. 24	State Street Bank	(784)
US-Dollar	Pfund Sterling	221.723	173.985	16. Feb. 24	State Street Bank	(60)
US-Dollar	Pfund Sterling	41.547	33.922	16. Feb. 24	UBS AG	(1.331)
US-Dollar	Pfund Sterling	513.999	408.794	16. Feb. 24	State Street Bank	(5.600)
US-Dollar	Pfund Sterling	513.999	408.340	16. Feb. 24	State Street Bank	(5.146)
US-Dollar	Pfund Sterling	430.354	339.594	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(2.013)
US-Dollar	Pfund Sterling	513.988	407.719	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(4.534)
Japanischer Yen	Euro	37.832.648	243.543	14. Mrz. 24	UBS AG	(180)
Japanischer Yen	Euro	75.669.746	487.202	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(436)
GBP						(87.423)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 810.363			
(31. Dezember 2022: 966.661)			
834.420	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	810.363	0,36
Irland - 6.585.471			
(31. Dezember 2022: 13.823.866)			
16.006	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	1.649.545	0,72
1.387	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF	221.559	0,10
203.385	iShares MSCI India UCITS ETF	1.749.518	0,77
15.006	Leadenhall Ucits IIs Fund Plc	2.156.339	0,94
23.300	VanEck Gold Miners UCITS ETF	808.510	0,35
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		7.395.834	3,24
Anleihen			
Brasilien - 6.533.086			
(31. Dezember 2022: 2.696.897)			
44.110.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	6.533.086	2,86
Frankreich - 782.501			
(31. Dezember 2022: 3.317.357)			
505.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	446.168	0,19
336.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 23-Jan-2024	336.333	0,15
Ungarn - 380.889			
(31. Dezember 2022: 976.098)			
370.000	OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN 8.750% 15-May-2033	380.889	0,17
Indonesien - 1.648.332			
(31. Dezember 2022: -)			
17.807.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	1.146.636	0,50
7.449.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-Feb-2033	501.696	0,22
Irland - 554.552			
(31. Dezember 2022: 996.005)			
508.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024	554.552	0,24
Italien - 2.003.461			
(31. Dezember 2022: 2.365.342)			
1.319.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	1.403.133	0,62
523.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 7.500% 03-Jun-2026	600.328	0,26
Luxemburg - 378.875			
(31. Dezember 2022: 526.035)			
356.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	378.875	0,17
Mexiko - 10.353.675			
(31. Dezember 2022: 3.518.156)			
61.880.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	3.407.308	1,49
130.870.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	6.946.367	3,04
Niederlande - 699.316			
(31. Dezember 2022: 348.022)			
702.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2024	699.316	0,31
Rumänien - 979.061			
(31. Dezember 2022: -)			
968.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.000% 25-May-2034	979.061	0,43
Schweiz - 137.310			
(31. Dezember 2022: 1.145.795)			
945.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' (Perpetual) 5.250% 11-Feb-2172	108.675	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Schweiz Forts.			
249.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' (Perpetual) 7.250% 12-Mar-2172	28.635	0,01
Vereinigtes Königreich - 6.246.198			
(31. Dezember 2022: 7.100.120)			
703.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 9.250% 15-Sep-2028	898.214	0,39
459.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8.375% 20-Dec-2083	620.827	0,27
1.230.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 04-Jul-2029	1.239.045	0,54
675.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	805.027	0,35
589.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	831.064	0,37
909.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	1.128.283	0,50
639.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	723.738	0,32
Vereinigte Staaten von Amerika - 53.515.771			
(31. Dezember 2022: 62.024.833)			
280.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	240.847	0,10
358.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	355.785	0,15
513.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	633.493	0,28
468.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	470.796	0,21
134.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	130.314	0,06
42.626.500	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.931% 31-Jan-2025	42.632.491	18,67
9.290.900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	9.052.045	3,96
Gesamtanlagen in Anleihen		84.213.027	36,88
Aktien			
Bermudas - 1.056.605			
(31. Dezember 2022: -)			
5.426	RenaissanceRe Holdings Ltd	1.056.605	0,46
Brasilien - 1.118.460			
(31. Dezember 2022: 1.165.105)			
373.276	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.118.460	0,49
Finnland - 901.167			
(31. Dezember 2022: 1.635.546)			
25.094	Neste Oyj	901.167	0,39
Frankreich - 1.752.608			
(31. Dezember 2022: 4.273.715)			
989	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	806.026	0,35
9.514	Sanofi SA	946.582	0,42
Guernsey - 534.154			
(31. Dezember 2022: 250.954)			
991.973	Amedeo Air Four Plus Ltd	534.154	0,23
Hongkong - 1.484.968			
(31. Dezember 2022: 4.726.170)			
170.400	AIA Group Ltd	1.484.968	0,65
Indien - 2.230.135			
(31. Dezember 2022: 1.972.756)			
108.614	HDFC Bank Ltd	2.230.135	0,98
Indonesien - 1.364.113			
(31. Dezember 2022: 1.352.279)			
3.478.800	Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.364.113	0,60
Irland - 6.557.986			
(31. Dezember 2022: 14.051.083)			
1.200.838	Greencoat Renewables Plc	1.340.810	0,59
6.327	Linde Plc	2.593.342	1,13
8.858	Ryanair Holdings Plc ADR	1.194.590	0,52
5.859	Trane Technologies Plc	1.429.244	0,63

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Japan - 1.087.926			
(31. Dezember 2022: 1.723.089)			
11.500	Sony Group Corp	1.087.926	0,48
Niederlande - 3.558.770			
(31. Dezember 2022: 4.398.457)			
2.517	ASML Holding NV	1.912.624	0,84
57.478	Universal Music Group NV	1.646.146	0,72
Republik Korea - 1.612.918			
(31. Dezember 2022: 1.893.938)			
26.479	Samsung Electronics Co Ltd	1.612.918	0,71
Spanien - 1.123.323			
(31. Dezember 2022: -)			
15.592	Amadeus IT Group SA	1.123.323	0,49
Schweiz - 6.944.657			
(31. Dezember 2022: 6.552.228)			
23.493	Alcon Inc	1.832.101	0,80
3.347	Lonza Group AG	1.413.107	0,62
19.661	Nestle SA	2.283.774	1,00
4.866	Roche Holding AG	1.415.675	0,62
Taiwan - 3.021.472			
(31. Dezember 2022: -)			
28.857	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.021.472	1,32
Vereinigtes Königreich - 23.711.518			
(31. Dezember 2022: 39.807.803)			
35.929	3i Group Plc	1.107.239	0,48
36.557	Anglo American Plc	925.642	0,40
17.285	AstraZeneca Plc	2.329.866	1,02
188.164	BAE Systems Plc	2.663.147	1,17
29.062	Diageo Plc	1.060.164	0,46
135.252	Informa Plc	1.341.451	0,59
112.198	Land Securities Group Plc (REIT)	1.014.417	0,44
82.360	Prudential Plc	928.756	0,41
32.940	Reckitt Benckiser Group Plc	2.282.564	1,00
67.844	Relx Plc	2.688.896	1,18
129.848	Rentokil Initial Plc	730.893	0,32
145.251	Shell Plc	4.745.152	2,08
39.035	Unilever Plc	1.893.331	0,83
Vereinigte Staaten von Amerika - 33.607.065			
(31. Dezember 2022: 45.692.770)			
7.850	Alphabet Inc - Class A	1.100.884	0,48
18.736	Amazon.com Inc	2.873.353	1,26
5.582	AMETEK Inc	921.784	0,40
9.369	CME Group Inc	1.977.608	0,87
17.331	ConocoPhillips	2.019.148	0,88
5.429	Danaher Corp	1.266.531	0,56
2.152	Deere & Co	859.745	0,38
23.490	Dominion Energy Inc	1.105.909	0,48
3.714	Eli Lilly & Co	2.158.131	0,95
7.126	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	1.051.976	0,46
5.534	Goldman Sachs Group Inc/The	2.139.638	0,94
4.850	Hubbell Inc - Class B	1.591.746	0,70
2.639	Lam Research Corp	2.083.636	0,91
2.230	Mastercard Inc	951.508	0,42
13.687	Microsoft Corp	5.136.526	2,25
46.080	Newmont Corp	1.921.997	0,84
7.492	NVIDIA Corp	3.709.926	1,62
3.736	Zoetis Inc	737.019	0,32
Gesamtanlagen in Aktien		91.667.845	40,14
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 4.510.260			
(31. Dezember 2022: 11.801.868)			
554.778	Bluefield Solar Income Fund Ltd	832.215	0,36
834.566	International Public Partnerships Ltd	1.459.335	0,64

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Kapitalbeteiligungsinstrumente Forts.			
Guernsey Forts.			
205.302	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	266.106	0,12
1.347.453	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	1.952.604	0,85
Luxemburg - 1.029.921			
(31. Dezember 2022: 1.873.853)			
569.083	BBGI Global Infrastructure SA	1.029.921	0,45
Vereinigtes Königreich - 5.682.762			
(31. Dezember 2022: 9.704.884)			
2.425.804	BioPharma Credit Plc/The Fund	2.057.082	0,90
1.513.800	Greencoat UK Wind Plc/Funds	2.915.231	1,28
849.099	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	710.449	0,31
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		11.222.943	4,91
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 3.071.915			
(31. Dezember 2022: 13.654.880)			
7.037	Amundi Physical Gold ETC	578.188	0,25
2.935	Invesco Physical Gold ETC	585.606	0,26
29.943	iShares Physical Gold ETC	1.204.682	0,53
30.899	iShares Physical Silver ETC	703.439	0,31
Jersey - 21.667			
(31. Dezember 2022: 2.318.069)			
764	Wisdomtree Carbon - ETC	21.667	0,01
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		3.093.582	1,36
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Curacao - 1.188.862			
(31. Dezember 2022: -)			
11.203	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	1.188.862	0,52
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		1.188.862	0,52
Optionsscheine			
Luxemburg - 5.017.215			
(31. Dezember 2022: 7.247.965)			
48.221	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	5.017.215	2,20
Vereinigtes Königreich - 15.076.499			
(31. Dezember 2022: 16.669.861)			
59.512	Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	6.363.618	2,79
60.393	Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	6.354.551	2,78
22.240	Goldman Sachs Series 2023-06 Senior Secured Index Linked Notes relating to the Goldman Sachs Systemic Skew US Series 2F Total Return Strategy due 07-May-2025	2.358.330	1,03
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		20.093.714	8,80
Währungsoptionen - 491.775			
(31. Dezember 2022: -)			
158	IMM JPY Call 08-Mar-2024 69.500	491.775	0,22
Währungsoptionen insgesamt		491.775	0,22
Börsengehandelte Rohstoffoptionen - 937.040			
(31. Dezember 2022: -)			
4.420	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 40.500	937.040	0,41
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		937.040	0,41

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Indexoptionen – 3.590.072 (31. Dezember 2022: 3.078.593)			
95	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4,850.000	593.750	0,26
127	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4,700.000	1.493.520	0,65
14	CBOE S&P 500 Index Put 14-Mar-2024 4,000.000	10.220	0,00
13	CBOE S&P 500 Index Put 14-Mar-2024 4,100.000	11.960	0,01
167	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4,350.000	1.480.622	0,65
Indexoptionen insgesamt		3.590.072	1,57
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Offene Terminkontrakte – 720.098 (31. Dezember 2022: 3.968.295)			
23	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.391.195	0,09
48	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	11.597.400	0,16
105	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	21.607.852	0,07
Offene Terminkontrakte insgesamt		720.098	0,32
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 735.250 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 811.455)		735.250	0,32
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		225.350.042	98,69
		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Währungsoptionen – (217.250) (31. Dezember 2022: –)			
(158)	IMM JPY Call 08-Mar-2024 72.000	(217.250)	(0,09)
Währungsoptionen insgesamt		(217.250)	(0,09)
Aktioptionen – (17.435) (31. Dezember 2022: –)			
(144)	Standard Chartered Plc Put 16-Feb-2024 620,000	(17.435)	(0,01)
Aktioptionen insgesamt		(17.435)	(0,01)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen – (663.000) (31. Dezember 2022: –)			
(4.420)	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 43.000	(508.300)	(0,22)
(2.210)	iShares Physical Gold Options Put 21-Jun-2024 39.000	(154.700)	(0,07)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		(663.000)	(0,29)
Optionen auf Futures – (14.250) (31. Dezember 2022: –)			
(48)	U.S. Treasury Bond Future Put 26-Jan-2024 120.000	(14.250)	(0,01)
Optionen auf Futures insgesamt		(14.250)	(0,01)
Indexoptionen – (1.893.829) (31. Dezember 2022: (1.606.798))			
(95)	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4,950.000	(243.200)	(0,11)
(127)	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4,775.000	(796.925)	(0,35)
(167)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4,000.000	(853.704)	(0,37)
Indexoptionen insgesamt		(1.893.829)	(0,83)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (65.341)				
(31. Dezember 2022: (1.257.323))				
176	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	8.886.058	(65.341)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(65.341)	(0,03)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (4.575.014) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (18.323.199))			(4.575.014)	(2,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(7.446.119)	(3,26)
Nettoumlaufvermögen			10.453.544	4,69
Summe Nettovermögen			228.357.467	100,00
Die Kontrahenten für Währungsoptionen ist UBS AG. Der Kontrahent für Aktioptionen ist die UBS AG. Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG. Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG. Der Kontrahent für börsengehandelte Rohstoffoptionen ist UBS AG.				
Portfolioanalyse			% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				92,05
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				0,50
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				2,22
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				0,52
Sonstiges Umlaufvermögen				4,71
Gesamtvermögen				100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Ab- rechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
Euro	US-Dollar	1.518.697	1.653.425	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	29.854
Euro	US-Dollar	1.066.293	1.148.941	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	32.907
Euro	US-Dollar	194.232	209.782	16. Jan. 24	State Street Bank	5.499
Euro	US-Dollar	898.872	982.479	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	13.805
Euro	US-Dollar	537.193	569.792	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	25.606
Euro	US-Dollar	718.966	776.360	16. Jan. 24	UBS AG	20.521
Euro	US-Dollar	438.662	475.843	16. Jan. 24	UBS AG	10.357
Euro	US-Dollar	228.700	250.930	16. Jan. 24	State Street Bank	2.555
Euro	US-Dollar	156.927	171.028	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	2.905
Euro	US-Dollar	419.364	451.905	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	12.906
Euro	US-Dollar	500.842	548.898	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	6.230
Euro	US-Dollar	357.699	390.057	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	6.406
Euro	US-Dollar	2.623.324	2.795.389	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	112.227
Euro	US-Dollar	145.306	154.285	16. Jan. 24	State Street Bank	6.768
Euro	US-Dollar	175.321	187.270	16. Jan. 24	UBS AG	7.051
Euro	US-Dollar	272.203	287.846	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	13.855
Pfund Sterling	US-Dollar	267.098	337.074	16. Jan. 24	State Street Bank	3.371
Pfund Sterling	US-Dollar	1.943.659	2.464.371	16. Jan. 24	UBS AG	13.031
Pfund Sterling	US-Dollar	522.848	658.593	16. Jan. 24	UBS AG	7.832
Pfund Sterling	US-Dollar	166.654	209.709	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	2.710
Pfund Sterling	US-Dollar	243.788	305.400	16. Jan. 24	State Street Bank	5.334
Pfund Sterling	US-Dollar	683.054	826.774	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	43.852
Pfund Sterling	US-Dollar	749.615	949.859	16. Jan. 24	State Street Bank	5.606
Pfund Sterling	US-Dollar	423.635	539.076	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	893
Pfund Sterling	US-Dollar	1.227.481	1.540.031	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	24.525
Pfund Sterling	US-Dollar	422.392	529.771	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	8.613
Pfund Sterling	US-Dollar	259.810	323.081	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	8.075
Pfund Sterling	US-Dollar	182.192	223.085	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	9.138
Pfund Sterling	US-Dollar	616.705	758.638	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	27.419
Pfund Sterling	US-Dollar	279.803	343.191	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	13.448
Pfund Sterling	US-Dollar	271.232	329.601	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	16.114
Pfund Sterling	US-Dollar	163.346	198.176	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	10.026
Pfund Sterling	US-Dollar	590.828	719.730	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	33.344
Pfund Sterling	US-Dollar	128.230	156.142	16. Jan. 24	State Street Bank	7.301
Pfund Sterling	US-Dollar	337.027	428.126	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	1.451
Pfund Sterling	US-Dollar	343.887	436.276	16. Jan. 24	State Street Bank	2.045
Hongkong-Dollar	US-Dollar	3.108.565	398.202	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	172
Schweizer Franken	US-Dollar	210.050	239.614	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	12.704
Schweizer Franken	US-Dollar	229.503	262.105	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	13.581
Schweizer Franken	US-Dollar	452.947	522.643	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	21.450
Schweizer Franken	US-Dollar	368.156	420.258	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	21.981
Schweizer Franken	US-Dollar	91.991	105.712	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	4.790
Schweizer Franken	US-Dollar	57.416	66.585	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	2.384
Schweizer Franken	US-Dollar	132.227	153.716	16. Feb. 24	State Street Bank	5.119
Schweizer Franken	US-Dollar	454.460	520.092	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	25.819
Schweizer Franken	US-Dollar	293.100	338.810	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	13.270
Schweizer Franken	US-Dollar	931.459	1.060.746	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	58.148
US-Dollar	Hongkong-Dollar	353.230	2.755.237	16. Feb. 24	UBS AG	136
Japanischer Yen	Euro	169.042.903	1.085.364	14. Mrz. 24	State Street Bank	2.117
USD						735.250
US-Dollar	Euro	173.130	157.728	16. Jan. 24	State Street Bank	(1.691)
US-Dollar	Euro	38.742.489	36.549.662	16. Jan. 24	State Street Bank	(1.768.091)
US-Dollar	Euro	237.938	217.478	16. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	(3.108)
US-Dollar	Euro	182.846	167.143	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.410)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	1.477.558	23.113.447.398	16. Jan. 24	State Street Bank	(20.748)
US-Dollar	Pfund Sterling	48.619.101	39.830.501	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(2.148.142)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	3.223.713	413.262	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(132)
US-Dollar	Schweizer Franken	8.983.145	7.999.302	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(625.839)
Japanischer Yen	Euro	169.042.902	1.088.193	14. Mrz. 24	UBS AG	(1.026)
Japanischer Yen	Euro	338.107.506	2.177.223	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.827)
USD						(4.575.014)

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Supranational - 18.330.775			
(31. Dezember 2022: 21.060.000)			
18.330.775	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	18.330.775	2,36
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		18.330.775	2,36
Anleihen			
Australien - 17.030.791			
(31. Dezember 2022: 16.404.263)			
13.950.000	Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026	8.974.291	1,15
8.200.000	Perenti Finance Pty Ltd 'REGS' 6.500% 07-Oct-2025	8.056.500	1,04
Österreich - 11.567.220			
(31. Dezember 2022: -)			
4.262.000	Benteler International AG '144A' 10.500% 15-May-2028	4.493.107	0,58
6.000.000	Benteler International AG 'REGS' 9.375% 15-May-2028	7.074.113	0,91
Brasilien - 15.178.470			
(31. Dezember 2022: 18.003.600)			
15.000.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026	15.178.470	1,95
Ägypten - 6.582.614			
(31. Dezember 2022: 1.583.963)			
7.200.000	Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	6.582.614	0,85
Finnland - 5.040.222			
(31. Dezember 2022: 4.688.392)			
5.000.000	PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026	5.040.222	0,65
Frankreich - 83.553.021			
(31. Dezember 2022: 61.374.097)			
4.560.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 7.000% 01-May-2029	5.329.761	0,69
8.805.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	9.733.707	1,25
6.000.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	5.555.965	0,71
8.850.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	10.381.265	1,34
9.000.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	9.871.986	1,27
4.500.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	4.494.413	0,58
3.000.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	3.308.755	0,43
6.200.000	IPD 3 BV 'REGS' 8.000% 15-Jun-2028	7.329.697	0,94
2.180.000	IPD 3 BV 'REGS' FRN 8.675% 15-Jun-2028	2.449.531	0,31
5.000.000	Lion/Polaris Lux 4 SA 'REGS' FRN 7.925% 01-Jul-2026	5.531.821	0,71
1.000.000	Paprec Holding SA 'REGS' 3.500% 01-Jul-2028	1.066.234	0,14
3.238.000	Paprec Holding SA 'REGS' 6.500% 17-Nov-2027	3.835.464	0,49
5.458.000	Paprec Holding SA 'REGS' 7.250% 17-Nov-2029	6.486.360	0,83
7.000.000	Picard Bondco SA 'REGS' 5.375% 01-Jul-2027	7.266.752	0,94
1.000.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	911.310	0,12
Deutschland - 111.421.164			
(31. Dezember 2022: 48.359.070)			
5.000.000	BK LC Lux Finco1 Sarl 'REGS' 5.250% 30-Apr-2029	5.508.201	0,71
8.000.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 3.500% 11-Feb-2027	8.573.827	1,10
6.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 1.125% 05-Nov-2029	7.028.718	0,90
3.000.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	3.250.436	0,42
7.550.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 8.750% 15-May-2028	9.126.632	1,17
2.500.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 8.750% 15-May-2028	3.022.064	0,39
5.000.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	5.486.402	0,71
11.500.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 7.500% 21-Aug-2026	13.133.292	1,69
9.000.000	Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025	9.905.778	1,28
8.352.380	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS' 6.000% 30-Jul-2026	9.227.526	1,19

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Deutschland Forts.			
5.000.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	5.416.600	0,70
7.200.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	7.364.741	0,95
8.000.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	8.544.795	1,10
2.800.000	ZF Europe Finance BV 'EMTN' 6.125% 13-Mar-2029	3.293.309	0,42
11.000.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 5.750% 03-Aug-2026	12.538.843	1,61
Ghana - 2.528.913			
(31. Dezember 2022: 1.815.292)			
2.650.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.125% 04-Apr-2026	2.528.913	0,33
Israel - 3.888.400			
(31. Dezember 2022: 7.254.375)			
4.000.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.125% 30-Jun-2025	3.888.400	0,50
Italien - 23.169.907			
(31. Dezember 2022: 15.394.275)			
5.000.000	Fiber Bidco Spa 'REGS' 11.000% 25-Oct-2027	6.049.417	0,78
6.000.040	Fiber Bidco Spa 'REGS' FRN 9.893% 25-Oct-2027	6.759.598	0,87
3.250.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' 10.000% 06-Feb-2028	3.705.770	0,48
6.050.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 9.393% 06-Feb-2028	6.655.122	0,85
Luxemburg - 39.488.962			
(31. Dezember 2022: 42.295.364)			
3.000.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	2.975.220	0,38
4.000.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.125% 15-Nov-2025	4.283.320	0,55
5.000.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.875% 01-May-2026	5.370.350	0,69
8.520.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' 8.750% 01-May-2028	9.622.362	1,24
3.270.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' FRN 9.175% 01-May-2028	3.655.185	0,47
8.300.000	PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	9.123.244	1,18
4.505.263	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	4.459.281	0,57
Niederlande - 61.921.690			
(31. Dezember 2022: 52.381.853)			
5.100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 1.500% 01-Mar-2025	5.536.545	0,71
12.750.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	13.077.562	1,68
4.844.441	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	5.328.602	0,69
2.537.405	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	2.790.998	0,36
14.105.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	15.132.303	1,95
2.000.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' FRN 7.752% 15-Aug-2026	2.215.720	0,28
8.065.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	7.610.981	0,98
10.500.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	10.228.979	1,32
Nigeria - 7.109.730			
(31. Dezember 2022: 4.629.805)			
2.000.000	IHS Holding Ltd 'REGS' 5.625% 29-Nov-2026	1.745.970	0,22
5.000.000	IHS Netherlands Holdco BV '144A' 8.000% 18-Sep-2027	4.469.800	0,58
1.000.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	893.960	0,12
Norwegen - 8.646.671			
(31. Dezember 2022: 7.199.824)			
5.703.000	DNO ASA '144A' 7.875% 09-Sep-2026	5.378.827	0,69
3.278.170	DNO ASA '144A' 8.375% 29-May-2024	3.267.844	0,42
Polen - 11.958.412			
(31. Dezember 2022: 2.088.757)			
5.238.000	Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.125% 01-Nov-2025	4.989.997	0,64
1.000.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 3.125% 01-Nov-2025	952.653	0,12

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Polen Forts.		
5.852.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	6.015.762	0,78
	Slowenien - 5.516.299		
	(31. Dezember 2022: -)	5.516.299	0,71
4.995.000	United Group BV 'REGS' FRN 7.252% 15-Feb-2026	5.516.299	0,71
	Spanien - 17.841.968		
	(31. Dezember 2022: 26.431.335)	17.841.968	2,30
7.000.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	7.578.005	0,98
2.500.000	Lorca Telecom Bondco SA '144A' 4.000% 18-Sep-2027	2.704.678	0,35
7.000.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	7.559.285	0,97
	Schweden - 24.017.651		
	(31. Dezember 2022: 3.888.733)	24.017.651	3,09
8.000.000	Assemblin Group AB 'REGS' FRN 8.964% 05-Jul-2029	9.020.421	1,16
5.000.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027	5.313.795	0,68
4.000.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	4.350.189	0,56
4.900.000	Ytinrete BidCo AB FRN 10.931% 12-Jul-2028	5.333.246	0,69
	Tansania - 9.323.984		
	(31. Dezember 2022: 8.788.500)	9.323.984	1,20
9.450.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	9.323.984	1,20
	Vereinigtes Königreich - 128.179.778		
	(31. Dezember 2022: 87.101.398)	128.179.778	16,50
2.000.000	B&M European Value Retail SA 4.000% 15-Nov-2028	2.369.512	0,30
5.000.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	6.030.820	0,78
1.250.000	CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027	1.414.044	0,18
8.475.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	10.442.722	1,34
3.000.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	3.714.492	0,48
8.000.000	EC Finance Plc 'REGS' 3.000% 15-Oct-2026	8.544.194	1,10
1.000.000	EnQuest Plc 9.000% 27-Oct-2027	1.171.997	0,15
7.500.000	Galaxy Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jul-2026	9.249.186	1,19
1.000.000	Greene King Finance Plc FRN 7139% 15-Dec-2034	1.007.031	0,13
5.050.000	Harbour Energy Plc 'REGS' 5.500% 15-Oct-2026	4.941.198	0,64
4.714.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 8.500% 15-Mar-2029	5.500.156	0,71
14.650.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026	14.507.455	1,87
3.250.000	Marston's Issuer Plc FRN 7.889% 16-Jul-2035	3.069.058	0,39
8.500.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 8.250% 11-Oct-2028	9.805.837	1,26
4.500.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 10.000% 11-Oct-2028	5.982.115	0,77
5.000.000	Premier Foods Finance Plc 3.500% 15-Oct-2026	5.934.775	0,76
6.000.000	Rolls-Royce Plc 'EMTN' 3.375% 18-Jun-2026	7.271.705	0,94
5.000.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' FRN 9.752% 31-Jul-2025	5.414.084	0,70
1.250.000	Synthomer Plc 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025	1.368.151	0,18
6.000.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 5.000% 15-Apr-2027	7.470.551	0,96
11.000.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	12.970.695	1,67
	Vereinigte Staaten von Amerika - 129.735.465		
	(31. Dezember 2022: 83.606.929)	129.735.465	16,70
7.000.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	6.977.991	0,90
5.300.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	5.158.720	0,66
5.500.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	5.412.853	0,70
2.500.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	2.709.266	0,35
7.500.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	8.137.475	1,05
13.000.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	12.645.591	1,63
6.000.000	Belden Inc 'REGS' 3.375% 15-Jul-2027	6.429.579	0,83

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
8.000.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	8.042.656	1,03
3.000.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	3.288.208	0,42
5.000.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	5.029.675	0,65
2.500.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	2.308.863	0,30
3.000.000	Fenix Marine Service Holdings Ltd 8.000% 15-Jan-2024	3.015.510	0,39
7.606.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	7.513.996	0,97
5.000.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	6.153.569	0,79
9.400.000	Oi European Group BV 'REGS' 2.875% 15-Feb-2025	10.278.968	1,32
9.000.000	Oi European Group BV 'REGS' 6.250% 15-May-2028	10.422.393	1,34
8.900.000	Silgan Holdings Inc 3.250% 15-Mar-2025	9.772.755	1,26
6.000.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	5.644.865	0,72
8.500.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	8.381.949	1,08
2.571.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	2.410.583	0,31
Gesamtanlagen in Anleihen		723.701.332	93,15
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)			
	Luxemburg - 4.435.142		
	(31. Dezember 2022: -)	4.435.142	0,57
4.000.000	Albion Financing 3 S.a r.l. (Albion Financing LLC) 2023-B Incremental Euro Term Loan 9.252% 16-Aug-2026	4.435.142	0,57
	Vereinigte Staaten von Amerika - 5.015.554		
	(31. Dezember 2022: -)	5.015.554	0,65
4.987.500	Arsenal AIC Parent LLC Term Loan 9.856% 27-Jun-2030	5.015.554	0,65
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		9.450.696	1,22
	Credit Default Swaps - 153.283		
	(31. Dezember 2022: -)		
(1.300.000)	CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2026	49.817	0,01
(2.700.000)	CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2026	103.466	0,01
Credit Default Swaps insgesamt		153.283	0,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 12.673.474 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 3.616.361)		12.673.474	1,63
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		764.309.560	98,38
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (14.541.434) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (28.018.215))		(14.541.434)	(1,87)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(14.541.434)	(1,87)
Nettoumlaufvermögen		271.277.34	3,49
Summe Nettovermögen		776.895.860	100,00
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		92,43	
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		1,18	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,60	
Sonstiges Umlaufvermögen		4,79	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Euro	US-Dollar	4.750.000	5.084.506	11. Jan. 24	Morgan Stanley	161.292
Euro	US-Dollar	3.708.000	3.926.650	11. Jan. 24	RBC Europe Limited	168.386
US-Dollar	Euro	9.388.003	8.488.000	25. Jan. 24	Morgan Stanley	8.383
Euro	US-Dollar	1.506.000	1.649.630	8. Feb. 24	HSBC Bank plc	15.501
US-Dollar	Pfund Sterling	6.187.588	4.837.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	20.569
USD						374.131
US-Dollar	Euro	3.278.987	3.000.000	11. Jan. 24	HSBC Bank plc	(34.148)
US-Dollar	Euro	4.370.436	4.000.000	11. Jan. 24	Morgan Stanley	(47.078)
US-Dollar	Euro	6.117.336	5.714.000	11. Jan. 24	Morgan Stanley	(193.082)
US-Dollar	Euro	105.399.360	99.698.000	11. Jan. 24	BNP Paribas	(4.704.965)
US-Dollar	Australischer Dollar	7.816.329	12.246.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(534.907)
US-Dollar	Euro	105.034.473	98.390.000	25. Jan. 24	Morgan Stanley	(3.690.879)
US-Dollar	Euro	4.431.218	4.014.000	8. Feb. 24	Morgan Stanley	(6.920)
US-Dollar	Euro	105.700.242	98.621.000	8. Feb. 24	HSBC Bank plc	(3.341.519)
US-Dollar	Euro	4.571.925	4.172.000	15. Feb. 24	BNP Paribas	(42.105)
US-Dollar	Euro	7.504.552	6.950.000	15. Feb. 24	Morgan Stanley	(181.811)
US-Dollar	Euro	98.400.154	89.480.000	15. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(560.393)
US-Dollar	Pfund Sterling	78.005.194	62.060.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(1.119.312)
USD						(14.457.119)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	197	227	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Schweizer Franken	US-Dollar	10.311	11.764	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	510
USD						517
CHF						435
US-Dollar	Schweizer Franken	110	96	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
USD						(3)
CHF						(3)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	27.514	31.795	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	956
Schweizer Franken	US-Dollar	1.437.644	1.640.176	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	71.066
USD						72.022
CHF						60.574
US-Dollar	Schweizer Franken	15.353	13.299	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(478)
USD						(478)
CHF						(402)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	68.656	79.342	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.380
Schweizer Franken	US-Dollar	4.363	5.024	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	170
Schweizer Franken	US-Dollar	33.985	39.273	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.180
Schweizer Franken	US-Dollar	1.771.946	2.021.574	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	87.592
USD						91.322
CHF						76.806
US-Dollar	Schweizer Franken	101.035	86.304	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.693)
US-Dollar	Schweizer Franken	8.380	7.251	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(251)
US-Dollar	Schweizer Franken	11.857	10.298	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(400)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Schweizer Franken	18.909	16.380	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(588)
USD						(2.932)
CHF						(2.466)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	106.216	116.970	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	287
US-Dollar	Euro	126.530	114.356	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	280
Euro	US-Dollar	92.515.084	99.531.059	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.645.011
Euro	US-Dollar	261.553	281.921	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.946
Euro	US-Dollar	71.379	76.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.895
Euro	US-Dollar	186.434	201.555	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.347
Euro	US-Dollar	132.859	144.734	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.999
Euro	US-Dollar	1.800.136	1.968.318	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19.799
Euro	US-Dollar	129.861	142.905	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	517
Euro	US-Dollar	379.153	414.419	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.328
Euro	US-Dollar	267.655	294.114	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.491
Euro	US-Dollar	302.529	330.996	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.125
Euro	US-Dollar	570.630	628.349	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.870
Euro	US-Dollar	332.604	366.494	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	842
Euro	US-Dollar	446.717	492.134	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.231
Euro	US-Dollar	456.082	497.419	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.290
US-Dollar	Euro	67.914	61.358	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	148
USD						2.700.406
EUR						2.446.130
US-Dollar	Euro	491.947	446.717	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.206)
Euro	US-Dollar	61.358	67.890	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(150)
Euro	US-Dollar	114.356	126.574	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(276)
US-Dollar	Euro	117.015	106.216	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(293)
US-Dollar	Euro	532.851	483.577	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.224)
US-Dollar	Euro	1.123.114	1.019.947	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.342)
US-Dollar	Euro	65.017	59.425	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(614)
US-Dollar	Euro	62.950	57.287	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(319)
US-Dollar	Euro	319.551	292.358	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.337)
US-Dollar	Euro	928.382	848.633	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8.871)
US-Dollar	Euro	12.060	11.058	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(153)
US-Dollar	Euro	125.914	114.421	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(456)
US-Dollar	Euro	34.772	31.919	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(480)
US-Dollar	Euro	54.314	50.240	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.171)
US-Dollar	Euro	19.418	18.015	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(478)
US-Dollar	Euro	2.115	1.962	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
USD						(22.422)
EUR						(20.311)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	3.611	3.264	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	3.998	4.404	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	5.142.703	5.532.705	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	147.030
Euro	US-Dollar	22	24	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	19.660	21.191	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	522
Euro	US-Dollar	85.685	92.635	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.998
Euro	US-Dollar	179	195	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	101.318	110.784	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.114
Euro	US-Dollar	2.626	2.864	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	36
Euro	US-Dollar	108.598	118.699	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.240
Euro	US-Dollar	41.225	45.300	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	230
Euro	US-Dollar	17.986	19.678	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	186
Euro	US-Dollar	1.732	1.907	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	49.969	55.060	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	126
Euro	US-Dollar	33.842	37.241	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	135
US-Dollar	Euro	24.381	22.028	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	53
US-Dollar	Euro	92	84	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
USD						152.699
EUR						138.321
US-Dollar	Euro	4.403	3.998	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
Euro	US-Dollar	22.028	24.373	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(54)
Euro	US-Dollar	3.264	3.613	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	112.470	102.139	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(335)
US-Dollar	Euro	5.530	5.032	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(28)
US-Dollar	Euro	1.512	1.383	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Euro	52.591	48.073	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(503)
US-Dollar	Euro	715	655	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	578	531	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	7.228	6.686	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(156)
US-Dollar	Euro	1.957	1.816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
USD						(1.176)
EUR						(1.065)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	2.683	2.955	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
US-Dollar	Euro	109.359	98.838	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	242
Euro	US-Dollar	10.019	11.039	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25
Euro	US-Dollar	81.312	89.537	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	266
Euro	US-Dollar	90.062	98.536	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	930
Euro	US-Dollar	3.479	3.823	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	225	245	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	37.418	41.176	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	149
Euro	US-Dollar	510.389	558.074	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.614
Euro	US-Dollar	188.057	203.310	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.385

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	4.992	5.381	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	133
Euro	US-Dollar	80.297	86.550	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.132
Euro	US-Dollar	26.039.522	28.014.255	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	744.471
USD						758.376
EUR						686.966
Euro	US-Dollar	98.838	109.398	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(239)
US-Dollar	Euro	2.956	2.683	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	3.188	2.893	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	91.395	83.000	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(272)
US-Dollar	Euro	94.029	85.570	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(477)
US-Dollar	Euro	25.336	23.180	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(265)
US-Dollar	Euro	261.891	239.395	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.502)
US-Dollar	Euro	29.340	26.662	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(106)
US-Dollar	Euro	3.764	3.455	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Euro	2.211	2.045	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
US-Dollar	Euro	18.260	16.941	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(450)
US-Dollar	Euro	3.775	3.502	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(93)
USD						(4.518)
EUR						(4.093)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	78.926	86.299	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	868
Euro	US-Dollar	29.804	32.468	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	448
Euro	US-Dollar	9.917	10.721	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	231
Euro	US-Dollar	4.026.558	4.331.917	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	115.120
USD						116.667
EUR						105.681
US-Dollar	Euro	40.495	37.016	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(387)
USD						(387)
EUR						(351)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	227.660	248.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.425
Euro	US-Dollar	42.971	46.317	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.141
Euro	US-Dollar	199.347.761	214.465.500	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.699.363
US-Dollar	Euro	69.611	62.892	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	152
USD						5.823.817
EUR						5.275.435
US-Dollar	Euro	37.059	33.652	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(91)
Euro	US-Dollar	62.892	69.587	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(154)
Euro	US-Dollar	33.096	36.631	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Euro	63.345	57.646	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(321)
US-Dollar	Euro	28.945	26.482	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(302)
US-Dollar	Euro	2.024.016	1.850.152	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(19.340)
US-Dollar	Euro	52.764	48.380	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(667)
US-Dollar	Euro	1.517.315	1.378.822	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.492)
US-Dollar	Euro	1.657	1.521	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Euro	21.160	19.572	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(456)
US-Dollar	Euro	46.169	42.833	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.137)
US-Dollar	Euro	13.601	12.346	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(34)
US-Dollar	Euro	43.829	39.776	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(101)
US-Dollar	Euro	150.271	136.467	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(447)
US-Dollar	Euro	87.836	80.282	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(829)
USD						(29.474)
EUR						(26.699)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	16.601	15.004	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Euro	US-Dollar	25.013.706	27.528.157	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99.631
Euro	US-Dollar	20.740	22.677	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	228
Euro	US-Dollar	1.007	1.085	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27
Euro	US-Dollar	1.064.885	1.145.642	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	30.445
USD						130.368
EUR						118.092
Euro	US-Dollar	15.004	16.607	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Euro	6.749	6.169	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Euro	257.546	235.422	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.461)
US-Dollar	Euro	2.576	2.362	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Euro	165	151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(2.596)
EUR						(2.352)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	64.589	82.051	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	278
Pfund Sterling	US-Dollar	17.727	22.569	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	159.980	200.816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.115
Pfund Sterling	US-Dollar	49.573.124	62.246.611	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	945.591
Pfund Sterling	US-Dollar	73.426	92.229	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.369
Pfund Sterling	US-Dollar	29.855	37.536	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	521
Pfund Sterling	US-Dollar	28.430	35.911	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	330
Pfund Sterling	US-Dollar	970.811	1.234.576	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.943
Pfund Sterling	US-Dollar	36.027	45.665	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	260
Pfund Sterling	US-Dollar	31.372	39.682	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	309
Pfund Sterling	US-Dollar	40.006	50.907	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	90
Pfund Sterling	US-Dollar	10.044	12.684	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	120
Pfund Sterling	US-Dollar	47.439	60.191	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	280
Pfund Sterling	US-Dollar	70.270	89.279	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	296
Pfund Sterling	US-Dollar	57.909	73.569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	249
Pfund Sterling	US-Dollar	83.872	106.788	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	126
US-Dollar	Pfund Sterling	43.732	34.234	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	93
USD						955.997
GBP						750.007
US-Dollar	Pfund Sterling	73.565	57.909	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(249)
US-Dollar	Pfund Sterling	106.782	83.872	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(127)
Pfund Sterling	US-Dollar	13.749	17.563	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(37)
US-Dollar	Pfund Sterling	82.056	64.589	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(278)
US-Dollar	Pfund Sterling	53.145	41.830	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(176)
US-Dollar	Pfund Sterling	93.875	73.985	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(437)
US-Dollar	Pfund Sterling	34.285	27.150	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(323)
US-Dollar	Pfund Sterling	68.644	53.945	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(121)
US-Dollar	Pfund Sterling	47.125	37.256	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(367)
US-Dollar	Pfund Sterling	59.358	46.830	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(338)
US-Dollar	Pfund Sterling	570.456	450.334	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.597)
US-Dollar	Pfund Sterling	83.211	65.877	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(764)
US-Dollar	Pfund Sterling	102.299	81.366	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.420)
US-Dollar	Pfund Sterling	200.558	159.670	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.977)
US-Dollar	Pfund Sterling	47.824	38.099	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(742)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.570	17.727	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(27)
USD						(11.980)
GBP						(9.399)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	10	13	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	3.473	4.421	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Pfund Sterling	US-Dollar	155.298	197.491	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	471
Pfund Sterling	US-Dollar	8.680	11.027	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Pfund Sterling	US-Dollar	828	1.055	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	24.728	31.040	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	481
Pfund Sterling	US-Dollar	7.799.477	9.793.432	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	148.772

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	54.433	68.372	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.015
Pfund Sterling	US-Dollar	53.526	67.297	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	934
Pfund Sterling	US-Dollar	15.538	19.627	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	180
Pfund Sterling	US-Dollar	30.607	38.886	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	129
Pfund Sterling	US-Dollar	12.674	16.064	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	91
Pfund Sterling	US-Dollar	10.835	13.705	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	107
Pfund Sterling	US-Dollar	11.317	14.401	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25
Pfund Sterling	US-Dollar	14.924	18.846	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	178
Pfund Sterling	US-Dollar	9.118	11.569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	54
US-Dollar	Pfund Sterling	3	2	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	13	10	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	53	42	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	154	121	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						152.480
GBP						119.625
US-Dollar	Pfund Sterling	11.026	8.680	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(37)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.055	828	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.691	2.160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	4.422	3.473	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.226	971	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.592	2.037	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.497	4.346	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(43)
US-Dollar	Pfund Sterling	7.429	5.861	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42)
US-Dollar	Pfund Sterling	91.368	72.128	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(576)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.853	7.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(81)
US-Dollar	Pfund Sterling	689	548	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Pfund Sterling	39	31	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	16.926	13.484	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(263)
USD						(1.081)
GBP						(848)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	275.396	350.220	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	835
Pfund Sterling	US-Dollar	13.984.950	17.560.236	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	266.758
USD						267.593
GBP						209.934
US-Dollar	Pfund Sterling	160.900	127.019	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.015)
USD						(1.015)
GBP						(796)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	105.154	133.724	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	319

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	5.339.177	6.704.151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	101.843
USD						102.162
GBP						80.149
US-Dollar	Pfund Sterling	61.426	48.491	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(387)
USD						(387)
GBP						(304)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	211	268	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	9.529	12.119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Pfund Sterling	US-Dollar	485.763	609.949	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9.266
USD						9.295
GBP						7.292
US-Dollar	Pfund Sterling	7.400	5.824	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Pfund Sterling	29.973	23.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(240)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.596	4.418	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(35)
USD						(300)
GBP						(235)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	5.640	7.165	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	24
Pfund Sterling	US-Dollar	66.515	84.684	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	100
Pfund Sterling	US-Dollar	17.681	22.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	74
Pfund Sterling	US-Dollar	1.977	2.508	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Pfund Sterling	US-Dollar	72.077	91.020	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	858
Pfund Sterling	US-Dollar	23.702	29.975	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	238
Pfund Sterling	US-Dollar	6.255	7.929	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	45
Pfund Sterling	US-Dollar	987.458	1.255.746	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.994
Pfund Sterling	US-Dollar	3.161	3.993	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Pfund Sterling	US-Dollar	5.643	7.088	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	105
Pfund Sterling	US-Dollar	50.386.227	63.267.586	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	961.101
Pfund Sterling	US-Dollar	24	30	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	13.277	16.904	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
US-Dollar	Pfund Sterling	268	211	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
US-Dollar	Pfund Sterling	6.440	5.042	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14
USD						965.622
GBP						757.558
US-Dollar	Pfund Sterling	16.903	13.277	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(20)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.674	13.635	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Pfund Sterling	84.689	66.515	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(100)
US-Dollar	Pfund Sterling	7.165	5.640	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(24)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	29.455	23.184	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(98)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.396	22.380	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(132)
US-Dollar	Pfund Sterling	15.788	12.502	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(149)
US-Dollar	Pfund Sterling	16.286	12.799	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Pfund Sterling	45.287	35.804	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(352)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.740	8.473	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(61)
US-Dollar	Pfund Sterling	579.899	457.789	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.657)
US-Dollar	Pfund Sterling	56.666	44.862	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(520)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.772	10.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(191)
US-Dollar	Pfund Sterling	11.024	8.777	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(164)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.549	2.031	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
USD						(5.566)
GBP						(4.367)

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 210.003			
(31. Dezember 2022: 219.717)			
216.237	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	210.003	0,71
Norwegen - 137.840			
(31. Dezember 2022: 156.127)			
158.520	Aquila European Renewables Plc	137.840	0,46
Vereinigtes Königreich - 158.954			
(31. Dezember 2022: -)			
160.720	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	158.954	0,54
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		506.797	1,71
Anleihen			
Australien - 407.093			
(31. Dezember 2022: 401.704)			
280.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	153.911	0,52
380.000	Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029	253.182	0,85
Österreich - 220.421			
(31. Dezember 2022: 202.258)			
190.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 3.150% 20-Jun-2044	220.421	0,74
Brasilien - 171.153			
(31. Dezember 2022: -)			
1.000.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	171.153	0,58
Kaiman-Inseln - 168.919			
(31. Dezember 2022: 154.734)			
200.000	Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030	168.919	0,57
Kolumbien - 150.318			
(31. Dezember 2022: 107.181)			
608.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.500% 26-Aug-2026	150.318	0,51
Deutschland - 215.326			
(31. Dezember 2022: 195.397)			
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	108.604	0,36
100.000	Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028	106.722	0,36
Mexiko - 328.375			
(31. Dezember 2022: 282.507)			
3.790.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	201.167	0,68
2.200.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	127.208	0,43
Neuseeland - 274.525			
(31. Dezember 2022: 262.189)			
320.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	274.525	0,92
Spanien - 161.079			
(31. Dezember 2022: 153.074)			
130.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	161.079	0,54
Vereinigte Staaten von Amerika - 5.397.920			
(31. Dezember 2022: 5.845.678)			
20.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	19.735	0,07
149.000	T-Mobile USA Inc 3.375 % 15-Apr-2029	138.736	0,47
47.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	44.615	0,15
555.809	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	548.356	1,85
586.644	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	561.520	1,89
542.734	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15-Apr-2032	609.218	2,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
855.500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	823.795	2,77
615.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	575.217	1,94
625.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	544.971	1,83
625.900	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	607.294	2,04
332.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	307.917	1,04
745.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	616.546	2,08
Gesamtanlagen in Anleihen		7.495.129	25,24
Aktien			
Bermudas - 140.206			
(31. Dezember 2022: -)			
720	RenaissanceRe Holdings Ltd	140.206	0,47
China - 124.358			
(31. Dezember 2022: 182.411)			
27.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	124.358	0,42
Dänemark - 221.207			
(31. Dezember 2022: 116.503)			
4.003	Novozymes A/S	221.207	0,74
Frankreich - 643.836			
(31. Dezember 2022: 396.555)			
4.802	Dassault Systemes SE	235.813	0,80
4.101	Sanofi SA	408.023	1,37
Deutschland - 477.151			
(31. Dezember 2022: 374.681)			
3.085	SAP SE	477.151	1,61
Hongkong - 411.329			
(31. Dezember 2022: 526.248)			
47.200	Alia Group Ltd	411.329	1,38
Indien - 364.010			
(31. Dezember 2022: 370.236)			
5.414	HDFC Bank Ltd ADR	364.010	1,23
Irland - 1.272.630			
(31. Dezember 2022: 569.378)			
126.106	Greencoast Renewables Plc	140.805	0,47
1.265	Linde Plc	518.504	1,75
6.496	Smurfit Kappa Group Plc	258.144	0,87
1.456	Trane Technologies Plc	355.177	1,19
Japan - 1.388.573			
(31. Dezember 2022: 1.256.500)			
6.000	FANUC Corp	175.583	0,59
6.000	Recruit Holdings Co Ltd	252.374	0,85
5.800	Sony Group Corp	548.693	1,85
6.600	Suzuki Motor Corp	281.015	0,95
12.200	Topcon Corp	130.908	0,44
Niederlande - 578.205			
(31. Dezember 2022: 432.598)			
20.189	Universal Music Group NV	578.205	1,95
Republik Korea - 271.790			
(31. Dezember 2022: 347.675)			
742	Samsung SDI Co Ltd	271.790	0,91
Schweiz - 1.480.551			
(31. Dezember 2022: 1.472.579)			
3.342	Alcon Inc	260.784	0,88
579	Lonza Group AG	244.454	0,82

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Schweiz Forts.		
1.142	Roche Holding AG	332.244	1,12
2.507	TE Connectivity Ltd	353.826	1,19
553	Zurich Insurance Group AG	289.243	0,98
	Vereinigtes Königreich - 2.641.729		
	(31. Dezember 2022: 2.560.912)	2.641.729	8,90
2.897	Ashtead Group Plc	202.925	0,68
2.169	AstraZeneca Plc	292.362	0,99
56.714	Barclays Plc	110.649	0,37
1.218	Ferguson Plc	235.180	0,79
97.981	Hays Plc	136.428	0,46
26.668	Informa Plc	264.498	0,89
11.784	National Grid Plc	159.311	0,54
26.682	Prudential Plc	300.887	1,01
1.957	Reckitt Benckiser Group Plc	135.610	0,46
8.169	RELX Plc	323.638	1,09
33.732	Rentokil Initial Plc	189.872	0,64
5.990	Unilever Plc	290.369	0,98
	Vereinigte Staaten von Amerika - 7.872.427		
	(31. Dezember 2022: 6.236.639)	7.872.427	26,51
1.322	Accenture Plc - Class A	464.960	1,56
1.391	Albermarle Corp	207.920	0,70
6.160	Alphabet Inc - Class A	863.878	2,91
2.400	Amazon.com Inc	368.064	1,24
3.250	Apple Inc	629.119	2,12
2.170	Applied Materials Inc	354.003	1,19
1.719	CME Group Inc	362.846	1,22
514	Cooper Cos Inc/The	195.168	0,66
1.548	Danaher Corp	361.133	1,22
884	Ecolab Inc	175.876	0,59
664	Eli Lilly & Co	385.837	1,30
4.939	Exelon Corp	177.088	0,60
678	Goldman Sachs Group Inc/The	262.139	0,88
868	Hubbell Inc - Class B	284.873	0,96
24.121	Laureate Education Inc	328.890	1,11
1.033	Mastercard Inc	440.766	1,48
5.086	Medtronic Plc	420.816	1,42
3.020	Microsoft Corp	1.133.361	3,82
2.554	Otis Worldwide Corp	229.055	0,77
1.431	Progressive Corp/The	226.635	0,76
Gesamtanlagen in Aktien		17.888.002	60,24
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
	Guernsey - 133.744		
	(31. Dezember 2022: 145.002)	133.744	0,45
92.294	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	133.744	0,45
	Vereinigtes Königreich - 870.245		
	(31. Dezember 2022: 912.637)	870.245	2,93
219.434	Greencoat UK Wind Plc/Funds	422.580	1,42
488.862	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	447.665	1,51
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		1.003.989	3,38

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Börsengehandelte Rohstoffe			
	Irland - 601.476		
	(31. Dezember 2022: 529.735)	601.476	2,02
14.950	iShares Physical Gold ETC	601.476	2,02
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		601.476	2,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 658.916 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 142.246)		658.916	2,22
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		28.154.309	94,81
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (88.838) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (132.984))		(88.838)	(0,30)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(88.838)	(0,30)
Nettoumlaufvermögen		1.630.294	5,49
Summe Nettovermögen		29.695.765	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			92,28
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			2,21
Sonstiges Umlaufvermögen			5,51
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
US-Dollar	Pfund Sterling	929.106	761.000	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(40.870)
US-Dollar	Euro	490.740	456.811	16. Feb. 24	State Street Bank	(16.211)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	242.687	409.232	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(15.987)
US-Dollar	Australischer Dollar	464.455	703.304	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(14.876)
USD						(87.944)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	215.370	161.703	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	804
Kanadischer Dollar	US-Dollar	678.296	506.204	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.601
Kanadischer Dollar	US-Dollar	38.057.397	28.063.545	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	652.511
USD						658.916
CAD						873.393
Kanadischer Dollar	US-Dollar	286.783	217.285	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(894)
USD						(894)
CAD						(1.185)

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
	Grundstoffe - 752.480.300		
	(31. Dezember 2022: 826.329.000)	752.480.300	4,21
262.600	ADEKA Corp	752.480.300	4,21
	Kommunikationsdienstleistungen - 2.262.294.150		
	(31. Dezember 2022: 3.930.990.250)	2.262.294.150	12,67
351.700	Atrae Inc	258.675.350	1,45
121.800	Cover Corp	333.244.800	1,86
421.500	Direct Marketing MiX Inc	185.670.750	1,04
25.500	Fibergate Inc/Japan	23.485.500	0,13
646.300	Vector Inc	731.611.600	4,10
593.900	Vision Inc/Tokyo Japan	729.606.150	4,09
	Kommunikation - 247.243.500		
	(31. Dezember 2022: 631.309.500)	247.243.500	1,38
164.500	Minkabu The Infonoid Inc	247.243.500	1,38
	Nicht-Basiskonsumgüter - 1.658.903.450		
	(31. Dezember 2022: 2.254.983.200)	1.658.903.450	9,29
208.700	Nifco Inc/Japan	759.981.050	4,26
210.100	Resorttrust Inc	513.064.200	2,87
288.600	Yonex Co Ltd	385.858.200	2,16
	Basiskonsumgüter - 453.105.900		
	(31. Dezember 2022: 906.457.000)	453.105.900	2,54
101.400	Ain Holdings Inc	453.105.900	2,54
	Nicht-zyklische Konsumgüter - 370.118.400		
	(31. Dezember 2022: 681.472.000)	370.118.400	2,07
156.300	Nakanishi Inc	370.118.400	2,07
	Finanzwerte - 2.392.095.600		
	(31. Dezember 2022: 2.375.009.700)	2.392.095.600	13,40
879.000	Anicom Holdings Inc	477.297.000	2,67
501.100	Premium Group Co Ltd	913.254.750	5,12
261.700	Rakuten Bank Ltd	552.317.850	3,09
84.600	Zenkoku Hoshu Co Ltd	449.226.000	2,52
	Industrie - 3.174.926.600		
	(31. Dezember 2022: 2.478.808.000)	3.174.926.600	17,79
816.900	Aida Engineering Ltd	673.942.500	3,78
32.500	Enplas Corp	389.350.000	2,18
701.800	Insourco Co Ltd	618.636.700	3,47
17.800	Maruwa Co Ltd/Aichi	525.901.000	2,95
92.900	Pilot Corp	389.994.200	2,18
524.400	TRE Holdings Corp	577.102.200	3,23
	Informationstechnologie - 4.129.814.900		
	(31. Dezember 2022: 6.205.405.000)	4.129.814.900	23,13
124.700	Dentsu Soken Inc	729.495.000	4,08
794.500	MCJ Co Ltd	872.758.250	4,89
639.800	m-up Holdings Inc	689.064.600	3,86
66.900	Optorun Co Ltd	108.980.100	0,61
485.100	TechMatrix Corp	849.167.550	4,76
130.800	Ulvac Inc	880.349.400	4,93
	Grundstoffe - 1.293.900.650		
	(31. Dezember 2022: 1.535.684.250)	1.293.900.650	7,25
49.900	C Uyemura & Co Ltd	553.391.000	3,10
546.300	Sakata INX Corp	740.509.650	4,15

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
	Versorger - 631.208.550		
	(31. Dezember 2022: 795.425.400)	631.208.550	3,54
271.400	Nippon Gas Co Ltd	631.208.550	3,54
	Gesamtanlagen in Aktien	17.366.092.000	97,27
	Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 4.287.476 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 7.278.763)	4.287.476	0,02
	Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt	17.370.379.476	97,29
	Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (159.429.964) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (205.976.575))	(159.429.964)	(0,89)
	Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt	(159.429.964)	(0,89)
	Nettoumlaufvermögen	642.302.224	3,60
	Summe Nettovermögen	17.853.251.736	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,73	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,02	
Sonstiges Umlaufvermögen		4,25	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Japanischer Yen	6.852	1.151.365	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7.437
Schweizer Franken	Japanischer Yen	22.381	3.772.841	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12.358
Schweizer Franken	Japanischer Yen	11.114	1.848.092	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	31.629
Schweizer Franken	Japanischer Yen	14.606	2.433.269	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	36.944
Schweizer Franken	Japanischer Yen	7.581	1.235.518	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46.629
Schweizer Franken	Japanischer Yen	1.289.410	214.376.956	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.698.894
JPY						3.833.891
CHF						22.658
Japanischer Yen	Schweizer Franken	2.888.925	17.454	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63.023)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	1.496.110	9.143	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(50.288)
JPY						(113.311)
CHF						(670)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	28	4.419	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Euro	Japanischer Yen	29	4.541	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	71
JPY						84
EUR						1
Euro	Japanischer Yen	86	13.612	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(85)
Euro	Japanischer Yen	43	6.801	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	Japanischer Yen	56	8.829	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(34)
Euro	Japanischer Yen	4.959	777.630	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.107)
Japanischer Yen	Euro	10.308	66	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
Japanischer Yen	Euro	5.155	33	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(47)
JPY						(1.323)
EUR						(8)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	10.499	1.639.399	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.783
Euro	Japanischer Yen	11.185	1.724.666	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	26.839
JPY						31.622
EUR						202
Euro	Japanischer Yen	31.975	5.038.663	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(31.474)
Euro	Japanischer Yen	16.254	2.545.837	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(573)
Euro	Japanischer Yen	20.901	3.286.037	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12.919)
Euro	Japanischer Yen	1.891.993	296.703.518	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(422.297)
Japanischer Yen	Euro	2.091.172	13.387	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(51.28)
Japanischer Yen	Euro	3.889.607	24.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18.140)
Japanischer Yen	Euro	4.427.939	28.568	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(45.734)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.						
Japanischer Yen	Euro	1.991.467	12.834	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18.269)
JPY						(554.534)
EUR						(3.537)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	1.644	256.621	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	748
Euro	Japanischer Yen	1.711	263.772	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.105
JPY						4.853
EUR						31
Euro	Japanischer Yen	5.019	790.901	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4.940)
Euro	Japanischer Yen	2.521	394.895	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(89)
Euro	Japanischer Yen	3.262	512.864	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.016)
Euro	Japanischer Yen	288.051	45.172.410	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(64.294)
Japanischer Yen	Euro	598.901	3.842	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.793)
Japanischer Yen	Euro	299.476	1.930	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.748)
JPY						(76.880)
EUR						(490)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	1.068	166.717	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	487
Euro	Japanischer Yen	1.111	171.332	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.667
JPY						3.154
EUR						20
Euro	Japanischer Yen	3.263	514.188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.212)
Euro	Japanischer Yen	1.637	256.433	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
Euro	Japanischer Yen	2.122	333.563	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.312)
Euro	Japanischer Yen	186.891	29.308.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(41.715)
Japanischer Yen	Euro	388.188	2.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.810)
Japanischer Yen	Euro	193.705	1.248	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.777)
JPY						(49.884)
EUR						(318)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Japanischer Yen	398	5.515	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	26
Norwegische Krone	Japanischer Yen	603	8.385	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Norwegische Krone	Japanischer Yen	403	5.457	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	162
Norwegische Krone	Japanischer Yen	69.159	919.853	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	43.406
JPY						43.607
NOK						3.127
Japanischer Yen	Norwegische Krone	12.770	927	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(141)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	6.264	465	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(211)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged) Forts.						
Norwegische Krone	Japanischer Yen	1.192	16.781	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(177)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	780	10.869	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
JPY						(535)
NOK						(38)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Japanischer Yen	422	5.854	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Norwegische Krone	Japanischer Yen	639	8.881	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Norwegische Krone	Japanischer Yen	428	5.787	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	171
Norwegische Krone	Japanischer Yen	72.944	970.185	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	45.781
JPY						45.994
NOK						3.298
Japanischer Yen	Norwegische Krone	13.403	973	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(148)
Japanischer Yen	Norwegische Krone	6.502	483	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(218)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	1.270	17.880	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(189)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	833	11.605	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
JPY						(561)
NOK						(40)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)						
Schwedische Krone	Japanischer Yen	815	11.479	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	30
Schwedische Krone	Japanischer Yen	408	5.621	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	138
Schwedische Krone	Japanischer Yen	71.575	994.785	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16.224
JPY						16.392
SEK						1.159
Japanischer Yen	Schwedische Krone	13.450	958	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(83)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	6.873	497	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(147)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	405	5.719	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.228	17.540	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(195)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	621	8.814	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
JPY						(470)
SEK						(33)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)						
Schwedische Krone	Japanischer Yen	868	12.231	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	33
Schwedische Krone	Japanischer Yen	432	5.956	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	147
Schwedische Krone	Japanischer Yen	75.347	1.047.205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.079
JPY						17.259
SEK						1.220
Japanischer Yen	Schwedische Krone	14.091	1.004	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(87)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	7133	516	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(153)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged) Forts.						
Schwedische Krone	Japanischer Yen	428	6.057	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.306	18.655	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(208)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	657	9.317	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(43)
JPY						(496)
SEK						(35)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	771.973	7.155	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.182
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	2.762	295.430	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	531
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	1.000	106.347	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	825
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	2.835	301.033	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.765
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	400	42.427	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	442
JPY						9.745
SGD						91
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	686.321	6.424	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.144)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	340.955	3.204	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.446)
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	8.324	894.443	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.295)
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	4.187	449.701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(991)
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	5.423	584.650	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.488)
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	485.278	52.641.604	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(633.618)
JPY						(644.982)
SGD						(6.011)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	65.986.280	465.603	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	191.269
US-Dollar	Japanischer Yen	211.282	29.838.680	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.865
US-Dollar	Japanischer Yen	214.790	30.282.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	69.534
JPY						278.668
USD						1.969
Japanischer Yen	US-Dollar	31.923.260	226.460	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(78.141)
US-Dollar	Japanischer Yen	627.052	88.873.739	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(264.130)
US-Dollar	Japanischer Yen	312.687	44.430.172	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(243.983)
US-Dollar	Japanischer Yen	406.179	58.118.649	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(720.992)
US-Dollar	Japanischer Yen	35.398.759	5.157.687.551	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(155.441.482)
JPY						(156.748.728)
USD						(1.107.430)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	506.413	3.573	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.468
US-Dollar	Japanischer Yen	1.600	225.940	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	136

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged) Forts.

US-Dollar	Japanischer Yen						
		1.626	229.301	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		528
						JPY	2.130
						USD	15
Japanischer Yen	US-Dollar	247.998	1.759	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(607)
US-Dollar	Japanischer Yen	4.728	670.151	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(1.991)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.374	337.301	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(1.852)
US-Dollar	Japanischer Yen	3.057	437.369	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(5.425)
US-Dollar	Japanischer Yen	218	31.017	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(196)
US-Dollar	Japanischer Yen	269.857	39.318.767	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon		(1.184.982)
						JPY	(1.195.053)
						USD	(8.443)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	18.223	129	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	53
US-Dollar	Japanischer Yen	58	8.208	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Japanischer Yen	59	8.330	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
JPY						77
USD						1
Japanischer Yen	US-Dollar	8.848	63	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Japanischer Yen	172	24.411	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Japanischer Yen	86	12.230	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(67)
US-Dollar	Japanischer Yen	111	15.950	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(198)
US-Dollar	Japanischer Yen	9.758	1.421.721	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42.847)
JPY						(43.207)
USD						(305)

BNY MELLON LONG-TERM EUROPEAN EQUITY FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Dänemark - 1.035.039		1.035.039	4,98
3.730	Coloplast A/S	387.976	1,87
6.900	Novo Nordisk A/S	647.063	3,11
Finnland - 385.688		385.688	1,85
8.500	Kone Oyj	385.688	1,85
Frankreich - 3.007.129		3.007.129	14,46
2.500	Air Liquide SA	440.825	2,12
9.840	Dassault Systemes SE	436.232	2,10
210	Hermes International SCA	403.515	1,94
960	L'Oreal SA	433.488	2,08
540	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	397.305	1,91
1.750	Sartorius Stedim Biotech	417.550	2,01
7.750	TotalEnergies SE	478.214	2,30
Deutschland - 3.030.184		3.030.184	14,57
2.330	adidas AG	430.304	2,07
4.810	Carl Zeiss Meditec AG	473.592	2,28
6.600	CTS Eventim AG & Co KGaA	414.975	1,99
12.000	Infineon Technologies AG	452.190	2,18
2.680	Merck KGaA	385.518	1,85
625	Rational AG	436.563	2,10
3.130	SAP SE	437.042	2,10
Hongkong - 328.418		328.418	1,58
32.260	Prudential Plc	328.418	1,58
Irland - 424.076		424.076	2,04
11.500	Experian Plc	424.076	2,04
Italien - 1.686.994		1.686.994	8,11
26.577	Brembo SpA	297.131	1,43
1.370	Ferrari NV	421.755	2,03
9.290	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	455.024	2,19
4.290	Reply SpA	513.084	2,46
Niederlande - 1.908.249		1.908.249	9,17
970	ASM International NV	458.398	2,20
740	ASML Holding NV	507.640	2,44
18.900	Universal Music Group NV	488.659	2,35
3.520	Wolters Kluwer NV	453.552	2,18
Spanien - 878.904		878.904	4,23
6.530	Amadeus IT Group SA	424.711	2,04
11.500	Industria de Diseno Textil SA	454.193	2,19
Schweden - 476.550		476.550	2,29
35.310	Atlas Copco AB	476.550	2,29
Schweiz - 4.152.917		4.152.917	19,97
670	Belimo Holding AG	334.011	1,61
35	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	381.717	1,83
1.445	Kuehne + Nagel International AG	450.483	2,17
840	Lonza Group AG	320.167	1,54
3.670	Nestle SA	384.850	1,85
4.540	Novartis AG	413.068	1,99
1.430	Roche Holding AG	375.582	1,81
4.600	SGS SA	358.404	1,72
1.540	Sika AG	453.755	2,18
560	Tecan Group AG	208.156	1,00
1.040	VAT Group AG	472.724	2,27
Vereinigtes Königreich - 3.223.789		3.223.789	15,50
34.550	Big Yellow Group Plc	486.771	2,34
16.450	Compass Group Plc	407.311	1,96
10.200	Diageo Plc	335.912	1,62
11.300	Diploma Plc	467.277	2,25
13.100	Greggs Plc	392.039	1,88

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
17.500	Halma Plc	461.700	2,22
3.910	Spirax-Sarco Engineering Plc	474.846	2,28
11.240	Victrex Plc	197.933	0,95
Gesamtanlagen in Aktien		20.537.937	98,75
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		20.537.937	98,75
Nettoumlaufvermögen		259.112	1,25
Summe Nettovermögen		20.797.049	100,00

*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,65
Sonstiges Umlaufvermögen	1,35
Gesamtvermögen	100,00

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 30.153.933			
(31. Dezember 2022: 27.398.684)			
170.400	CSL Ltd	30.153.933	2,05
Kanada - 65.203.120			
(31. Dezember 2022: 56.297.551)			
634.235	Alimentation Couche-Tard Inc	33.825.684	2,30
275.634	Canadian National Railway Co	31.377.436	2,13
Dänemark - 52.905.114			
(31. Dezember 2022: 48.752.169)			
566.000	Novo Nordisk A/S	52.905.114	3,60
Frankreich - 90.203.343			
(31. Dezember 2022: 75.212.764)			
575.500	Dassault Systemes SE	25.457.243	1,73
74.500	L'Oreal SA	33.565.975	2,28
42.500	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	31.180.125	2,12
Hongkong - 44.618.179			
(31. Dezember 2022: 61.133.179)			
3.092.200	AIA Group Ltd	24.419.578	1,66
1.972.000	Prudential Plc	20.198.601	1,37
Irland - 31.091.591			
(31. Dezember 2022: -)			
841.100	Experian Plc	31.091.591	2,11
Japan - 88.090.176			
(31. Dezember 2022: 69.821.364)			
77.200	Keyence Corp	30.776.945	2,09
989.900	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	37.581.446	2,56
40.600	SMC Corp	19.731.785	1,34
Niederlande - 30.263.040			
(31. Dezember 2022: -)			
44.400	ASML Holding NV	30.263.040	2,06
Spanien - 32.707.389			
(31. Dezember 2022: 12.974.310)			
829.400	Industria de Diseno Textil SA	32.707.389	2,22
Schweiz - 65.478.156			
(31. Dezember 2022: 64.413.885)			
29.700	Lonza Group AG	11.315.705	0,77
257.000	Nestle SA	26.989.120	1,83
103.200	Roche Holding AG	27.173.331	1,85
Taiwan - 40.233.720			
(31. Dezember 2022: 28.859.172)			
427.262	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	40.233.720	2,74
Vereinigtes Königreich - 30.474.498			
(31. Dezember 2022: 88.306.687)			
1.229.600	Compass Group Plc	30.474.498	2,07
Vereinigte Staaten von Amerika - 840.845.254			
(31. Dezember 2022: 584.623.327)			
87.310	Adobe Inc	47.195.005	3,21
302.360	Alphabet Inc	38.606.049	2,62
403.994	Amphenol Corp - Class A	36.289.741	2,47
145.117	Automatic Data Processing Inc	30.628.431	2,08
9.202	Booking Holdings Inc	29.551.840	2,01
550.268	Cisco Systems Inc	25.184.371	1,71
233.951	Cognex Corp	8.842.433	0,60
412.443	Cognizant Technology Solutions Corp	28.222.238	1,92
60.030	Costco Wholesale Corp	35.903.530	2,44
379.490	Edwards Lifesciences Corp	26.220.024	1,78
498.069	Fastenal Co	29.217.758	1,98
393.930	Fortinet Inc	20.887.440	1,42
114.116	Intuitive Surgical Inc	34.875.176	2,37
109.001	Linde Plc	40.560.768	2,76

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
101.665	Mastercard Inc	39.285.075	2,67
14.040	Mettler-Toledo International Inc	15.449.212	1,05
169.419	Microsoft Corp	57.697.141	3,92
82.680	Moody's Corp	29.250.494	1,99
271.360	NIKE Inc	26.675.106	1,81
74.730	Old Dominion Freight Line Inc	27.429.991	1,86
31.280	O'Reilly Automotive Inc	26.927.091	1,83
233.613	Paychex Inc	25.204.468	1,71
105.016	Stryker Corp	28.510.182	1,94
191.179	Texas Instruments Inc	29.520.652	2,01
338.287	TJX Cos Inc/The	28.744.968	1,95
166.187	Walt Disney Co/The	13.592.121	0,92
102.960	Waters Corp	30.697.269	2,09
93.000	West Pharmaceutical Services Inc	29.676.680	2,02
Gesamtanlagen in Aktien		1.442.267.513	98,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 17.133 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 77.797)		17.133	0,00
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.442.284.646	98,02
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (298.865) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (163.798))		(298.865)	(0,02)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(298.865)	(0,02)
Nettoumlaufvermögen		29.486.325	2,00
Summe Nettovermögen		1.471.472.106	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,72
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen	2,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse JPY J (Acc) (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	13.836	2.136.568	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	94
Japanischer Yen	Euro	3.113.494	19.989	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	37
Japanischer Yen	Euro	2.744.577	17.547	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	106
Japanischer Yen	Euro	286.630.676	1.829.160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14.463
EUR						14.700

JPY						
Japanischer Yen	Euro	1.626.443	10.482	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(20)
EUR						(20)
JPY						(3.113)

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)

Schwedische Krone	Euro	1.203	108	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Schwedische Krone	Euro	682	61	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schwedische Krone	Euro	1.018	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schwedische Krone	Euro	110.807	9.818	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	134
EUR						136
SEK						1.514
Euro	Schwedische Krone	70	784	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
EUR						(1)
SEK						(11)

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)

Euro	Singapur-Dollar	33.768	49.123	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	49
Singapur-Dollar	Euro	45.116	30.917	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
EUR						101
SGD						147
Singapur-Dollar	Euro	78.896	54.196	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
Singapur-Dollar	Euro	65.681	45.377	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(292)
Singapur-Dollar	Euro	7.216.813	4.996.411	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(42.611)
EUR						(42.943)
SGD						(62.565)

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged)

Singapur-Dollar	Euro	48.669	33.378	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27
Euro	Singapur-Dollar	198.241	287.918	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	608
Euro	Singapur-Dollar	169.966	247.253	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	245
Euro	Singapur-Dollar	96.071	139.381	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	397
Euro	Singapur-Dollar	56.703	82.157	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	309
Euro	Singapur-Dollar	37.399	54.115	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	253

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged) Forts.						
Singapur-Dollar	Euro	230.455	157.926	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	264
EUR						2.103
SGD						3.064
Euro	Singapur-Dollar	33.379	48.669	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
Euro	Singapur-Dollar	135.535	197.475	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17)
Euro	Singapur-Dollar	31.757	46.354	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(61)
Singapur-Dollar	Euro	398.610	273.819	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(203)
Singapur-Dollar	Euro	336.340	232.368	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.496)
Singapur-Dollar	Euro	36.707.105	25.413.403	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(216.734)
EUR						(218.540)
SGD						(318.399)

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse USD W (Hedged)

Euro	US-Dollar	9.381	10.257	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	93
EUR						93
USD						103
US-Dollar	Euro	16.756	15.317	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(145)
US-Dollar	Euro	10.035	9.119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Euro	13.887	12.873	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(299)
US-Dollar	Euro	1.528.356	1.420.731	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(36.884)
EUR						(37.361)
USD						(41.245)

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
China - 22.493.817			
(31. Dezember 2022: 28.229.600)		22.493.817	5,30
367.500	BYD Co Ltd 'H'	10.085.836	2,38
428.200	Meituan '144A'	4.492.577	1,06
34.459	NXP Semiconductors NV	7.915.404	1,86
Frankreich - 19.462.450			
(31. Dezember 2022: 9.994.055)		19.462.450	4,58
262.782	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	9.418.039	2,22
205.688	Dassault Systemes SE	10.044.411	2,36
Deutschland - 42.154.037			
(31. Dezember 2022: 31.278.610)		42.154.037	9,93
115.064	Deutsche Post AG	5.703.101	1,34
387.949	Infineon Technologies AG	16.157.796	3,81
172.021	KION Group AG	7.374.868	1,74
101.646	Knorr-Bremse AG	6.616.027	1,56
91.268	Mercedes-Benz Group AG	6.302.245	1,48
Israel - 11.683.973			
(31. Dezember 2022: -)		11.683.973	2,75
269.682	Mobileye Global Inc - Class A	11.683.973	2,75
Japan - 40.300.142			
(31. Dezember 2022: 45.407.708)		40.300.142	9,49
554.500	Denso Corp	8.353.877	1,97
78.100	East Japan Railway Co	4.497.951	1,06
301.500	FANUC Corp	8.856.830	2,08
423.800	Kubota Corp	6.367.520	1,50
286.000	Suzuki Motor Corp	12.223.964	2,88
Republik Korea - 6.717.099			
(31. Dezember 2022: 18.792.497)		6.717.099	1,58
18.338	Samsung SDI Co Ltd	6.717.099	1,58
Singapur - 6.590.383			
(31. Dezember 2022: 7.690.808)		6.590.383	1,55
131.937	STMicroelectronics NV	6.590.383	1,55
Südafrika - 6.667.855			
(31. Dezember 2022: -)		6.667.855	1,57
265.391	Anglo American Plc	6.667.855	1,57
Schweden - 7.306.630			
(31. Dezember 2022: 8.697.802)		7.306.630	1,72
365.098	Epiroc AB	7.306.630	1,72
Schweiz - 7.674.625			
(31. Dezember 2022: 16.289.080)		7.674.625	1,81
84.875	Landis+Gyr Group AG	7.674.625	1,81
Taiwan - 4.755.429			
(31. Dezember 2022: 10.684.307)		4.755.429	1,12
686.000	Chroma ATE Inc	4.755.429	1,12
Vereinigtes Königreich - 5.968.322			
(31. Dezember 2022: 16.799.877)		5.968.322	1,40
4.372.934	Dowlais Group Plc	5.968.322	1,40
Vereinigte Staaten von Amerika - 229.252.926			
(31. Dezember 2022: 241.273.854)		229.252.926	53,98
84.402	Akamai Technologies Inc	9.990.243	2,35
65.233	Alphabet Inc	9.194.918	2,16
102.556	Amphenol Corp - Class A	10.169.966	2,39
48.672	ANSYS Inc	17.664.042	4,16
151.539	Aptiv Plc	13.596.837	3,20
44.115	CrowdStrike Holdings Inc	11.263.662	2,65
15.493	Deere & Co	6.196.735	1,46
44.428	Eaton Corp Plc	10.706.037	2,52
91.947	Emerson Electric Co	8.949.661	2,11
20.869	Hubbell Inc - Class B	6.868.718	1,62
95.943	Lumentum Holdings Inc	5.031.251	1,18

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
22.943	NVIDIA Corp	11.361.718	2,68
66.756	ON Semiconductor Corp	5.577.464	1,31
77.862	Power Integrations Inc	6.396.363	1,51
59.185	QUALCOMM Inc	8.560.222	2,02
12.772	Roper Technologies Inc	6.964.252	1,64
39.950	Schneider Electric SE	8.009.511	1,89
51.052	Splunk Inc	7.780.325	1,83
59.385	TE Connectivity Ltd	8.346.859	1,97
42.027	Texas Instruments Inc	7.164.133	1,69
195.745	Trimble Inc	10.414.613	2,45
130.458	Twilio Inc - Class A	9.894.587	2,33
171.941	Uber Technologies Inc	10.587.267	2,49
89.682	Visteon Corp	11.205.766	2,64
782.326	Zuora Inc	7.357.776	1,73
Gesamtanlagen in Aktien		411.027.688	96,78
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.020.241 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 1.732.480)		4.020.241	0,95
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		415.047.929	97,73
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (63.717) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (309.404))		(63.717)	(0,02)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(63.717)	(0,02)
Nettoumlaufvermögen		9.724.817	2,29
Summe Nettovermögen		424.709.029	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,46
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,94
Sonstiges Umlaufvermögen	2,60
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	449.024	518.881	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15.597
Schweizer Franken	US-Dollar	158.544	183.568	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.149
Schweizer Franken	US-Dollar	124.113	141.845	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.889
Schweizer Franken	US-Dollar	89.307	101.840	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.463
Schweizer Franken	US-Dollar	18.413.980	21.008.102	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	910.251
Schweizer Franken	US-Dollar	173.860	204.836	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.110
Schweizer Franken	US-Dollar	7.237	8.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	150
Schweizer Franken	US-Dollar	217.966	256.100	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.347
Schweizer Franken	US-Dollar	150	175	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	2.874	3.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	100
USD						947.060
CHF						796.525
Schweizer Franken	US-Dollar	191.083	229.027	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.579)
US-Dollar	Schweizer Franken	47.871	40.891	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(802)
US-Dollar	Schweizer Franken	132.069	113.038	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.481)
US-Dollar	Schweizer Franken	42.469	36.474	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(946)
US-Dollar	Schweizer Franken	33.216	28.848	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.122)
US-Dollar	Schweizer Franken	16.184	14.192	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(709)
USD						(7.639)
CHF						(6.425)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	64	75	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	US-Dollar	80	94	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	US-Dollar	165	191	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Schweizer Franken	US-Dollar	58	67	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	US-Dollar	45	51	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	US-Dollar	6.809	7.768	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	337
USD						349
CHF						294
Schweizer Franken	US-Dollar	69	83	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Schweizer Franken	51	43	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(2)
CHF						(2)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	30.563	36.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	371
Schweizer Franken	US-Dollar	38.360	45.072	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	589
Schweizer Franken	US-Dollar	79.315	91.654	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.755
Schweizer Franken	US-Dollar	27.858	32.255	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	905
Schweizer Franken	US-Dollar	21.691	24.790	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.029
Schweizer Franken	US-Dollar	7.630	8.705	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	377
Schweizer Franken	US-Dollar	3.262.251	3.721.830	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	161.262

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	US-Dollar	110	126	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
USD						167.293
CHF						140.702
Schweizer Franken	US-Dollar	33.132	39.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(274)
US-Dollar	Schweizer Franken	19.726	16.850	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(331)
US-Dollar	Schweizer Franken	21.309	18.374	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(561)
US-Dollar	Schweizer Franken	24.113	20.638	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(453)
USD						(1.619)
CHF						(1.362)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	1.990	2.344	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	24
Schweizer Franken	US-Dollar	2.497	2.934	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	38
Schweizer Franken	US-Dollar	5.136	5.935	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	178
Schweizer Franken	US-Dollar	2.112	2.430	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	84
Schweizer Franken	US-Dollar	1.786	2.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
Schweizer Franken	US-Dollar	1.390	1.588	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	66
Schweizer Franken	US-Dollar	209.617	239.147	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.362
USD						10.810
CHF						9.092
Schweizer Franken	US-Dollar	2.168	2.599	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.561	1.336	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
USD						(47)
CHF						(40)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	197	233	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	US-Dollar	248	291	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	509	588	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18
Schweizer Franken	US-Dollar	179	208	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Schweizer Franken	US-Dollar	140	160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Schweizer Franken	US-Dollar	20.963	23.916	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.036
USD						1.073
CHF						902
Schweizer Franken	US-Dollar	217	260	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Schweizer Franken	152	130	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
USD						(5)
CHF						(4)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	392.454	429.120	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.317

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	141.778	156.035	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	548
Euro	US-Dollar	106.252	114.627	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.720
Euro	US-Dollar	16.281.473	17.516.195	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	465.488
USD						473.073
EUR						428.528
Euro	US-Dollar	164.768	183.027	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.054)
Euro	US-Dollar	151.985	168.869	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.013)
Euro	US-Dollar	189.890	209.746	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(27)
US-Dollar	Euro	301.892	273.976	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(694)
US-Dollar	Euro	21.447	19.477	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Euro	100.160	91.048	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(395)
US-Dollar	Euro	213.502	195.760	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.700)
US-Dollar	Euro	180.174	166.656	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.886)
US-Dollar	Euro	52.831	49.014	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.302)
USD						(11.135)
EUR						(10.087)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	13.421	14.675	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	148
Euro	US-Dollar	4.827	5.312	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	3.576	3.858	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	92
Euro	US-Dollar	549.801	591.495	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15.719
USD						15.978
EUR						14.473
Euro	US-Dollar	4.751	5.277	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
Euro	US-Dollar	4.331	4.812	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
Euro	US-Dollar	5.407	5.972	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	2.897	2.634	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	111.081	100.942	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(402)
USD						(473)
EUR						(428)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	84.554	93.115	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	228
US-Dollar	Euro	774	699	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	1.988	2.190	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	140.851	151.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.606
Euro	US-Dollar	748	809	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	4.019	4.378	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	60
Euro	US-Dollar	189.432	208.480	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	733
Euro	US-Dollar	514.932	563.041	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.664
Euro	US-Dollar	250	275	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	7.150	7.798	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	34.671	37.896	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	396
Euro	US-Dollar	250	274	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	10.098	11.119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	33
Euro	US-Dollar	496	547	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	150	162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	21.916.269	23.578.312	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	626.587
US-Dollar	Euro	93.501	84.476	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	204
USD						637.643
EUR						577.601
US-Dollar	Euro	2.189	1.988	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
Euro	US-Dollar	84.476	93.469	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(207)
Euro	US-Dollar	216.996	241.044	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.388)
Euro	US-Dollar	699	774	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	US-Dollar	199.964	222.178	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.332)
Euro	US-Dollar	249.907	276.040	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Euro	93.151	84.554	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(233)
US-Dollar	Euro	12.534	11.375	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
US-Dollar	Euro	20.111	18.264	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(60)
US-Dollar	Euro	139.271	126.600	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(550)
US-Dollar	Euro	86.782	79.318	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(819)
US-Dollar	Euro	2.208	2.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	114.057	104.351	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.191)
US-Dollar	Euro	11.366	10.329	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(41)
US-Dollar	Euro	595.247	546.408	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8.220)
US-Dollar	Euro	280.375	259.340	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6.047)
USD						(20.171)
EUR						(18.272)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	11.086	12.122	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	122
Euro	US-Dollar	3.968	4.367	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	2.922	3.152	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	75
Euro	US-Dollar	454.675	489.155	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12.999
USD						13.211
EUR						11.967
Euro	US-Dollar	4.708	5.229	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
Euro	US-Dollar	4.336	4.818	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
Euro	US-Dollar	5.417	5.983	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	3.005	2.731	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
USD						(72)
EUR						(65)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	19.979	21.846	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	220
Euro	US-Dollar	7.167	7.888	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	28
Euro	US-Dollar	5.294	5.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	135
Euro	US-Dollar	818.965	881.072	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23.414
USD						23.797
EUR						21.556
Euro	US-Dollar	8.534	9.479	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(55)
Euro	US-Dollar	7.822	8.691	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
Euro	US-Dollar	9.768	10.789	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	5.343	4.857	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
USD						(129)
EUR						(117)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.007	4.413	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	324.105	354.385	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.565
Euro	US-Dollar	117.033	128.802	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	453
Euro	US-Dollar	86.437	93.250	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.213
Euro	US-Dollar	13.426.709	14.444.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	383.870
USD						390.112
EUR						353.378
Euro	US-Dollar	137.076	152.267	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(877)
Euro	US-Dollar	126.214	140.235	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(841)
Euro	US-Dollar	157.621	174.103	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Euro	4.415	4.007	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	67.611	61.359	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(155)
US-Dollar	Euro	85.990	78.167	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(339)
US-Dollar	Euro	43.348	39.449	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(220)
US-Dollar	Euro	37.807	34.665	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(478)
US-Dollar	Euro	96.400	88.491	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.331)
US-Dollar	Euro	57.373	53.228	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.414)
USD						(5.689)
EUR						(5.153)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	14.641	16.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	161
Euro	US-Dollar	5.252	5.780	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	3.879	4.185	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	99
Euro	US-Dollar	600.160	645.674	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	17.159
USD						17.439
EUR						15.797

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	6.254	6.947	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
Euro	US-Dollar	5.732	6.369	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(38)
Euro	US-Dollar	7.158	7.907	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	3.916	3.560	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(15)
USD						(94)
EUR						(85)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	3.936	4.335	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
US-Dollar	Euro	2.899	2.620	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	258.096	278.441	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.607
Euro	US-Dollar	295	319	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	432	471	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	346.850	381.728	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.342
Euro	US-Dollar	959.948	1.049.633	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.558
Euro	US-Dollar	918	1.010	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	120.272	131.458	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.373
Euro	US-Dollar	19.294	21.201	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	107
Euro	US-Dollar	283.468	310.142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.928
Euro	US-Dollar	874	962	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	2.546	2.805	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	1.111	1.224	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	4.005	4.317	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	106
Euro	US-Dollar	39.602.215	42.605.489	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.132.229
US-Dollar	Euro	123.726	111.783	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	270
USD						1.155.566
EUR						1.046.756
US-Dollar	Euro	1.224	1.111	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	111.783	123.683	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(274)
Euro	US-Dollar	414.620	460.569	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.652)
Euro	US-Dollar	377.282	419.193	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.514)
Euro	US-Dollar	471.399	520.692	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(67)
Euro	US-Dollar	2.620	2.900	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	65.639	60.897	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.617)
US-Dollar	Euro	81.232	75.138	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.752)
US-Dollar	Euro	144.573	132.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.996)
US-Dollar	Euro	196.844	178.877	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(712)
US-Dollar	Euro	91.819	84.188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.161)
US-Dollar	Euro	11.364	10.342	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
US-Dollar	Euro	6.676	6.102	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Euro	250.140	227.382	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(987)
US-Dollar	Euro	47.856	43.460	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(142)
US-Dollar	Euro	12.964	11.765	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Euro	4.336	3.936	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	26.678	24.751	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(657)
US-Dollar	Euro	7.450	6.816	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(78)
USD						(14.780)
EUR						(13.388)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	401	443	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	820	897	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	295	325	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	219	236	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	33.587	36.134	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	960
USD						976
EUR						884
Euro	US-Dollar	353	393	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	US-Dollar	322	357	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	215	195	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(5)
EUR						(5)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	6.021	4.559	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.414	5.610	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Singapur-Dollar	US-Dollar	15.522	11.668	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	100
Singapur-Dollar	US-Dollar	5.514	4.158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22
Singapur-Dollar	US-Dollar	4.053	3.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
Singapur-Dollar	US-Dollar	628.365	468.008	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8.358
USD						8.547
SGD						11.280
Singapur-Dollar	US-Dollar	6.683	5.077	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.753	3.650	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14)
USD						(25)
SGD						(33)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.972	3.008	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Singapur-Dollar	US-Dollar	4.891	3.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Singapur-Dollar	US-Dollar	10.241	7.698	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	66
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.638	2.744	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.674	1.993	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	34

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged) Forts.						
Singapur-Dollar	US-Dollar	414.580	308.781	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.515
USD						5.638
SGD						7.441
Singapur-Dollar	US-Dollar	4.410	3.350	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.816	2.408	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
USD						(16)
SGD						(21)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	78.262	99.653	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	111
Pfund Sterling	US-Dollar	163.441	207.847	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	496
Pfund Sterling	US-Dollar	42.988	53.862	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	935
Pfund Sterling	US-Dollar	6.668.131	8.372.855	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	127.192
USD						128.734
GBP						100.996
Pfund Sterling	US-Dollar	70.500	90.057	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(189)
Pfund Sterling	US-Dollar	62.845	80.281	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(172)
Pfund Sterling	US-Dollar	60.035	76.554	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(26)
US-Dollar	Pfund Sterling	46.493	36.698	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(287)
US-Dollar	Pfund Sterling	179.049	141.259	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.018)
USD						(1.692)
GBP						(1.327)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	14.201	18.082	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	20
Pfund Sterling	US-Dollar	29.094	36.999	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	88
Pfund Sterling	US-Dollar	7.564	9.478	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	165
Pfund Sterling	US-Dollar	1.188.457	1.492.289	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22.669
USD						22.942
GBP						17.999
Pfund Sterling	US-Dollar	12.651	16.160	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(34)
Pfund Sterling	US-Dollar	11.395	14.557	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(31)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.633	13.559	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.789	6.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(54)
USD						(124)
GBP						(97)

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Österreich - 1.374.858			
(31. Dezember 2022: 647.931)		1.374.858	2,72
13.466	Eurotelesites AG	48.275	0,09
20.614	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	914.231	1,81
53.867	Telekom Austria AG - Class A	412.352	0,82
Belgien - 2.147.358			
(31. Dezember 2022: 1.539.066)		2.147.358	4,26
30.566	Bekaert SA	1.419.179	2,81
1.345	Cofinimmo SA (REIT)	96.100	0,19
3.559	D'ieteren Group	632.079	1,26
Dänemark - 447.184			
(31. Dezember 2022: 446.651)		447.184	0,89
19.354	GN Store Nord AS	447.184	0,89
Finnland - 601.209			
(31. Dezember 2022: 662.152)		601.209	1,19
90.606	Outokumpu Oyj	407.999	0,81
7.345	Valmet Oyj	193.210	0,38
Frankreich - 14.945.252			
(31. Dezember 2022: 15.744.352)		14.945.252	29,62
11.171	Alten SA	1.504.734	2,98
8.432	Arkema SA	868.707	1,72
12.826	Cie Plastic Omnium SA	155.900	0,31
11.483	Covivio SA/France (REIT)	559.107	1,11
20.722	Eiffage SA	2.009.205	3,98
34.766	Elis SA	654.644	1,30
6.118	Fnac Darty SA	168.673	0,33
29.907	JCDecaux SA	543.709	1,08
40.097	Klepierre SA (REIT)	996.611	1,98
27.041	Maisons du Monde SA '144A'	154.269	0,31
33.761	Metropole Television SA	437.036	0,87
14.883	Nexity SA	251.895	0,50
18.488	Publicis Groupe SA	1.559.463	3,09
39.145	Rexel SA	975.885	1,93
46.131	SCOR SE	1.223.394	2,42
2.245	Sopra Steria Group SACA	446.194	0,88
7.707	Trigano SA	1.144.104	2,27
10.958	Ubisoft Entertainment SA	252.801	0,50
15.428	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	1.038.921	2,06
Deutschland - 11.639.656			
(31. Dezember 2022: 10.090.037)		11.639.656	23,07
13.318	AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	181.791	0,36
9.622	Bechtle AG	436.646	0,87
18.644	Brenntag SE	1.546.706	3,07
3.178	Cewe Stiftung & Co KGAA	323.520	0,64
14.081	Covestro AG '144A'	743.195	1,47
9.052	Dermapharm Holding SE	385.887	0,76
55.460	Deutsche EuroShop AG	1.243.690	2,47
23.304	Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	144.135	0,29
28.295	DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	983.534	1,95
11.929	flatexDEGIRO AG	132.621	0,26
398.134	Heidelberger Druckmaschinen AG	488.510	0,97
13.874	HelloFresh SE	198.017	0,39
18.768	HUGO BOSS AG	1.261.585	2,50
5.840	KION Group AG	227.118	0,45
8.127	Krones AG	911.037	1,81
3.241	Rheinmetall AG	929.843	1,84
741	Sartorius AG - Preference	244.530	0,48
7.736	Siltronic AG	681.928	1,35
244.731	Telefonica Deutschland Holding AG	575.363	1,14
Irland - 632.962			
(31. Dezember 2022: 488.924)		632.962	1,25
454	ICON Plc	117.100	0,23
2.000	ICON Plc	515.862	1,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Italien - 5.496.393			
(31. Dezember 2022: 3.570.841)		5.496.393	10,89
197.187	Anima Holding SpA '144A'	795.847	1,58
36.718	Banca IFIS SpA	578.859	1,15
418.851	BPER Banca	1.265.768	2,51
27.409	Buzzi Unicem SpA	758.407	1,50
120.132	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT)	278.706	0,55
108.877	Iren SpA	214.325	0,42
120.158	Italgas SpA	623.620	1,24
414.215	MFE-MediaForEurope NV	980.861	1,94
Luxemburg - 947.814			
(31. Dezember 2022: 585.211)		947.814	1,88
96.160	Corestate Capital Holding SA	39.546	0,08
15.332	Eurofins Scientific SE	908.268	1,80
Niederlande - 6.429.856			
(31. Dezember 2022: 5.562.087)		6.429.856	12,74
10.366	Aalberts NV	408.887	0,81
151.759	Aegon Ltd	797.949	1,58
9.093	Arcadis NV	443.920	0,88
11.695	BE Semiconductor Industries NV	1.603.677	3,18
21.497	OCI NV	564.189	1,12
52.547	Signify NV '144A'	1.597.429	3,16
25.705	TKH Group NV Dutch Cert	1.013.805	2,01
Spanien - 2.217.274			
(31. Dezember 2022: 3.001.643)		2.217.274	4,39
2.079	Acciona SA	277.494	0,55
41.678	Almirall SA	353.534	0,70
108.267	Gestamp Automocion SA '144A'	383.590	0,76
385.714	Sacyr SA	1.202.656	2,38
Schweden - 628.579			
(31. Dezember 2022: 470.635)		628.579	1,25
150.610	Scandic Hotels Group AB '144A'	628.579	1,25
Gesamtanlagen in Aktien		47.508.395	94,15
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		47.508.395	94,15
Nettoumlaufvermögen		2.950.460	5,85
Summe Nettovermögen		50.458.855	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		93,87	
Sonstiges Umlaufvermögen		6,13	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Australischer Dollar - 9.571.870			
(31. Dezember 2022: 5.239.416)			
13.520.000	Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	6.784.638	2,04
4.310.000	Queensland Treasury Corp '144A' 5.250% 21-Jul-2036	2.787.232	0,84
Brasilianischer Real - 8.958.473			
(31. Dezember 2022: -)			
67.000.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	8.958.473	2,69
Kanadischer Dollar - 8.035.880			
(31. Dezember 2022: 29.614.868)			
2.055.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 0.950% 15-Jun-2025	1.335.681	0,40
1.150.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.253% 15-Mar-2027	783.714	0,23
3.670.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.253% 15-Mar-2027	2.501.070	0,75
4.182.459	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	3.415.415	1,03
Kolumbianischer Peso - 8.138.145			
(31. Dezember 2022: 5.550.566)			
28.975.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	5.969.255	1,80
10.864.800.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	2.168.890	0,65
Euro - 42.737.297			
(31. Dezember 2022: 45.041.858)			
1.928.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 4.625% 23-Jul-2029	1.990.245	0,60
1.800.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025	1.785.150	0,54
1.952.000	CBRE Global Investors Open-Ended Funds SCA SICAV-SIF-Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028	1.730.263	0,52
2.200.000	Cie de Saint-Gobain SA 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	2.143.995	0,64
1.100.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	1.091.915	0,33
940.000	Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029	833.249	0,25
5.332.590	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	5.246.137	1,58
4.570.000	European Union 0.450% 04-Jul-2041	3.007.746	0,90
1.520.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 1.744% 19-Jul-2024	1.498.636	0,45
839.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	290.781	0,09
870.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	832.172	0,25
1.594.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.000% 15-Sep-2028	1.589.279	0,48
1.375.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	1.347.500	0,40
820.000	Loxam SAS 'EMTN' 6.375% 15-May-2028	853.390	0,26
1.265.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 0.375% 03-Jan-2026	1.197.164	0,36
1.220.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 0.500% 23-Feb-2024	1.214.034	0,36
933.000	Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026	884.871	0,27
370.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028	339.309	0,10
1.096.000	Orsted AS 'EMTN' 3.250% 13-Sep-2031	1.087.939	0,33
340.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	331.908	0,10
3.620.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	3.503.146	1,05
1.130.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025	187.919	0,06
3.010.000	Spain Government Bond '144A' 1.900% 31-Oct-2052	2.094.419	0,63
800.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	796.944	0,24
200.000	Teleperformance SE 'EMTN' 5.250% 22-Nov-2028	209.447	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
452.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	384.383	0,11
2.178.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	1.988.873	0,60
1.665.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027	1.438.144	0,43
1.711.000	Universal Music Group NV 'EMTN' 3.000% 30-Jun-2027	1.713.909	0,51
1.255.000	Ziggo BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2030	1.124.430	0,34
Indische Rupie - 4.048.374			
(31. Dezember 2022: 2.825.493)			
375.430.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	4.048.374	1,22
Indonesische Rupiah - 12.266.125			
(31. Dezember 2022: 6.569.977)			
78.387.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	4.556.769	1,37
131.288.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	7.709.356	2,32
Japanischer Yen - 9.266.638			
(31. Dezember 2022: -)			
1.226.950.000	Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	5.339.230	1,60
775.250.000	Japan Government Forty Year Bond 1.000% 20-Mar-2062	3.927.408	1,18
Malaysischer Ringgit - 3.321.255			
(31. Dezember 2022: 1.901.092)			
16.990.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	3.321.255	1,00
Mexikanischer neuer Peso - 14.118.954			
(31. Dezember 2022: 8.174.470)			
150.000.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	7.187.647	2,16
1.414.400.000	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	6.931.307	2,08
Neuseeländischer Dollar - 22.744.607			
(31. Dezember 2022: 21.339.235)			
2.480.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	1.380.687	0,41
7.250.000	New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	3.495.596	1,05
12.470.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	6.987.844	2,10
6.980.000	New Zealand Government Bond 1.750% 15-May-2041	2.625.444	0,79
1.920.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2.500% 20-Sep-2040	1.366.824	0,41
2.430.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	1.881.987	0,56
5.400.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	3.051.471	0,92
3.820.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3.500% 14-Apr-2033	1.954.754	0,59
Norwegische Krone - 5.329.206			
(31. Dezember 2022: -)			
23.240.000	Norway Government Bond '144A' 1.375% 19-Aug-2030	1.835.509	0,55
40.300.000	Norway Government Bond '144A' 1.750% 13-Mar-2025	3.493.697	1,05
Peruanischer neuer Sol - 5.572.603			
(31. Dezember 2022: 4.006.342)			
23.290.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	5.572.603	1,67
Pfund Sterling - 41.356.202			
(31. Dezember 2022: 39.522.627)			
929.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	1.012.417	0,31
2.231.000	AT&T Inc 2.900% 04-Dec-2026	2.447.762	0,74

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Pfund Sterling Forts.				
854.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 9.250% 15-Sep-2028	985.054	0,30	
660.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8.375% 20-Dec-2083	805.897	0,24	
1.930.000	Clarion Funding Plc 'EMTN' 2.625% 18-Jan-2029	2.029.063	0,61	
1.830.000	Commonwealth Bank of Australia FRN 5.770% 16-Jan-2025	2.107.030	0,63	
1.331.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024	1.509.879	0,45	
300.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	322.991	0,10	
1.030.000	Direct Line Insurance Group Plc FRN (Perpetual) 4.750% 07-Dec-2027	930.588	0,28	
1.940.000	DS Smith Plc 'EMTN' 2.875% 26-Jul-2029	2.009.599	0,60	
767.705	Gwynt y Mor OFTO Plc 2.778% 17-Feb-2034	786.727	0,24	
1.908.000	Hiscox Ltd 6.000% 22-Sep-2027	2.256.844	0,68	
595.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 10.875% 15-Dec-2027	715.917	0,22	
1.010.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 6.625% 31-May-2033	1.225.428	0,37	
1.400.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024	1.477.924	0,44	
3.170.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	3.528.645	1,06	
1.700.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 30-Mar-2027	1.992.084	0,60	
820.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024	919.891	0,28	
370.000	Mobico Group Plc 2.375% 20-Nov-2028	373.861	0,11	
517.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.500% 20-Jan-2041	377.058	0,11	
1.282.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	1.305.682	0,39	
1.380.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc 'EMTN' 3.875% 17-Oct-2024	1.566.742	0,47	
1.080.000	Nationwide Building Society FRN 5.770% 10-Jan-2025	1.245.071	0,37	
2.097.000	Nestle Holdings Inc 5.250% 21-Sep-2026	2.469.473	0,74	
1.421.000	Orsted AS 'EMTN' 4.875% 12-Jan-2032	1.625.009	0,49	
1.400.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 1.000% 20-Feb-2025	1.544.647	0,46	
316.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	263.949	0,08	
1.150.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	1.142.081	0,34	
740.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078	833.381	0,25	
1.336.000	Welltower OP LLC 4.800% 20-Nov-2028	1.545.508	0,47	
Uruguayischer Peso - 2.383.816				
(31. Dezember 2022: -)		2.383.816	0,72	
110.896.432	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	2.383.816	0,72	
US-Dollar - 123.555.601				
(31. Dezember 2022: 130.594.809)		123.555.601	37,13	
2.300.000	American Express Co 2.500% 30-Jul-2024	2.041.591	0,61	
2.233.000	Apple Inc 3.000% 20-Jun-2027	1.938.538	0,58	
890.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	801.236	0,24	
1.182.000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.550% 30-May-2033	1.060.704	0,32	
3.500.000	Asian Development Bank 'GMTN' 4.000% 12-Jan-2033	3.157.592	0,95	
1.810.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 6.406% 27-Aug-2026	1.659.807	0,50	
2.948.000	Bahamas Government International Bond 'REGS' 8.950% 15-Oct-2032	2.510.088	0,75	
3.540.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 6.387% 05-Aug-2026	3.243.567	0,97	
1.746.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Aug-2025	1.582.099	0,48	
760.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	681.860	0,20	
3.904.000	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	3.306.244	0,99	
2.513.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.214% 27-May-2025	2.217.120	0,67	
2.639.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 7.450% 30-Apr-2044	2.537.271	0,76	
1.203.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	1.114.516	0,34	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
3.610.000	European Investment Bank 'REGS' FRN 6.403% 21-May-2028	3.348.396	1,01	
3.760.000	Inter-American Development Bank FRN 5.643% 12-Apr-2027	3.388.874	1,02	
2.998.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 5.693% 20-Mar-2028	2.692.792	0,81	
2.070.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 15-Jan-2025	1.809.091	0,54	
1.780.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 5.829% 19-Aug-2027	1.612.025	0,48	
3.618.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	3.026.705	0,91	
245.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	235.287	0,07	
2.235.000	Intesa Sanpaolo SpA 'REGS' 7.200% 28-Nov-2033	2.146.394	0,65	
1.010.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	833.264	0,25	
1.470.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.109% 22-Apr-2051	961.961	0,29	
1.060.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 6.421% 17-Jun-2026	970.999	0,29	
2.556.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 6.421% 17-Jun-2026	2.341.389	0,70	
2.660.000	Lowe's Cos Inc 3.000% 15-Oct-2050	1.645.735	0,49	
400.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	327.105	0,10	
877.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' FRN 6.339% 21-Mar-2025	794.826	0,24	
1.718.000	Morocco Government International Bond 'REGS' 6.500% 08-Sep-2033	1.641.010	0,49	
1.933.000	National Australia Bank Ltd/New York 3.500% 09-Jun-2025	1.715.891	0,52	
690.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 10-Aug-2025	623.999	0,19	
1.860.000	NVIDIA Corp 3.500% 01-Apr-2050	1.414.190	0,43	
2.428.000	PepsiCo Inc 3.600% 01-Mar-2024	2.185.004	0,66	
3.654.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.000% 25-May-2034	3.336.422	1,00	
1.420.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027	1.215.528	0,37	
1.150.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Perpetual) 10.000% 14-Nov-2028	1.112.620	0,33	
970.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	1.081.368	0,33	
696.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN 6.187% 06-Jul-2027	638.766	0,19	
3.550.000	Svensk Exportkredit AB 'GMTN' FRN 6.387% 03-Aug-2026	3.257.308	0,98	
2.499.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	2.243.430	0,67	
1.840.000	Trane Technologies Financing Ltd 5.250% 03-Mar-2033	1.725.355	0,52	
2.445.000	Trimble Inc 6.100% 15-Mar-2033	2.366.477	0,71	
1.690.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 9.250% 13-Nov-2028	1.642.483	0,49	
2.740.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 5.528% 31-Jul-2025	2.470.354	0,74	
7.813.364	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	6.628.762	1,99	
15.385.000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	13.374.403	4,02	
17.010.000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	14.862.467	4,47	
2.383.000	Verizon Communications Inc FRN 6.218% 20-Mar-2026	2.159.583	0,65	
226.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	201.986	0,06	
508.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	216.128	0,07	
580.000	Warnermedia Holdings Inc 3.788% 15-Mar-2025	513.247	0,15	
1.490.000	Warnermedia Holdings Inc 3.788% 15-Mar-2025	1.318.515	0,40	
2.050.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	1.623.229	0,49	
Gesamtanlagen in Anleihen		321.405.046	96,58	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Optionen auf Futures - 84.423			
(31. Dezember 2022: -)			
171	U.S. 10 Year Treasury Note Future Put 23-Feb-2024 111.000	84.423	0,03
Optionen auf Futures insgesamt		84.423	0,03

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 1.690.990				
(31. Dezember 2022: 1.150.143)				
360	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	25.784.852	762.510	0,23
390	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	72.454.395	650.698	0,20
209	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	20.507.075	277.782	0,08
Offene Terminkontrakte insgesamt		1.690.990		0,51
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 7.956.116 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 14.690.440)			7.956.116	2,39
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		331.136.575		99,51

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (3.794.690)				
(31. Dezember 2022: -)				
(57)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.819.697)	(207.866)	(0,06)
(93)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(11.126.520)	(403.341)	(0,12)
(162)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(22.258.800)	(654.731)	(0,20)
(104)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(13.713.440)	(438.001)	(0,13)
(41)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(38.365.623)	(374.111)	(0,11)
(198)	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(12.989.144)	(128.818)	(0,04)
(278)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(28.332.214)	(724.130)	(0,22)
(49)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(5.933.127)	(548.561)	(0,17)
(45)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(5.314.830)	(315.131)	(0,09)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(3.794.690)		(1,14)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (7.250.684) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (2.570.305))			(7.250.684)	(2,18)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(11.045.374)		(3,32)
Nettoumlaufvermögen		12.690.453		3,81
Summe Nettovermögen		332.781.654		100,00

Der Kontrahent für Optionen auf Futures 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	91,98
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,51
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,28
Sonstiges Umlaufvermögen	5,23
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
Australischer Dollar	Euro	4.687.833	2.862.732	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	14.141
Australischer Dollar	Euro	755.819	454.191	16. Feb. 24	State Street Bank	9.647
Australischer Dollar	Euro	5.333.322	3.249.842	16. Feb. 24	State Street Bank	23.161
Australischer Dollar	Euro	545.095	332.118	16. Feb. 24	UBS AG	2.401
Australischer Dollar	Euro	549.680	336.538	16. Feb. 24	State Street Bank	795
Kanadischer Dollar	Euro	328.076	222.005	16. Feb. 24	State Street Bank	1.172
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	13.758.490.467	3.425.126	16. Feb. 24	State Street Bank	84.014
Euro	Australischer Dollar	603.676	979.971	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	2.278
Euro	Japanischer Yen	232.788	36.167.764	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	886
Euro	Japanischer Yen	212.267	33.103.710	16. Feb. 24	UBS AG	11
Euro	Neuseeländischer Dollar	5.519.928	9.658.057	16. Feb. 24	State Street Bank	18.909
Euro	Pfund Sterling	213.837	185.579	16. Feb. 24	UBS AG	657
Euro	Pfund Sterling	898.360	773.017	16. Feb. 24	State Street Bank	10.370
Euro	Pfund Sterling	806.091	701.102	16. Feb. 24	State Street Bank	712
Euro	Pfund Sterling	533.125	462.623	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	1.695
Euro	Pfund Sterling	842.650	731.137	16. Feb. 24	State Street Bank	2.770
Euro	US-Dollar	3.855.840	4.167.052	16. Feb. 24	UBS AG	100.925
Euro	US-Dollar	1.577.972	1.725.378	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	23.241
Euro	US-Dollar	335.458	368.828	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	3.108
Euro	US-Dollar	13.968.833	15.349.918	16. Feb. 24	State Street Bank	137.080
Euro	US-Dollar	337.802	364.620	16. Feb. 24	UBS AG	9.244
Euro	US-Dollar	3.006.145	3.257.579	16. Feb. 24	State Street Bank	70.753
Euro	US-Dollar	169.925.575	182.027.844	16. Feb. 24	State Street Bank	5.900.967
Euro	US-Dollar	162.193	173.719	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	5.655
Euro	US-Dollar	2.513.524	2.703.179	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	77.700
Euro	US-Dollar	419.302	457.561	16. Feb. 24	UBS AG	6.995
Euro	US-Dollar	244.143	266.573	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	3.936
Euro	US-Dollar	553.043	605.255	16. Feb. 24	UBS AG	7.650
Euro	US-Dollar	201.445	221.332	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	2.003
Euro	US-Dollar	3.867.879	4.259.165	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	29.961
Euro	US-Dollar	3.165.534	3.464.919	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	43.309
Euro	US-Dollar	516.789	565.415	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	7.296
Japanischer Yen	Euro	23.222.669	146.020	16. Feb. 24	State Street Bank	2.881
Japanischer Yen	Euro	535.163.603	3.332.339	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	99.049
Japanischer Yen	Euro	28.508.040	178.219	16. Feb. 24	State Street Bank	4.571
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	3.212.502	691.009	16. Feb. 24	State Street Bank	10.764
Mexikanischer Peso	Euro	10.477.468	543.809	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	9.137
Mexikanischer Peso	Euro	6.066.666	319.465	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	702
Mexikanischer Peso	Euro	5.437.568	284.396	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	2.570
Neuseeländischer Dollar	Euro	1.178.983	666.267	16. Feb. 24	State Street Bank	5.256
Neuseeländischer Dollar	Euro	684.196	379.449	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	10.254
Norwegische Krone	Euro	9.470.812	808.121	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	33.743
Pfund Sterling	Euro	608.881	697.831	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	1.611
Pfund Sterling	Euro	1.355.155	1.542.127	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	14.584
Pfund Sterling	Euro	1.298.400	1.479.405	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	12.109
Pfund Sterling	US-Dollar	4.360.000	5.344.109	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	192.918
Schwedische Krone	Euro	40.444.007	3.614.661	16. Feb. 24	UBS AG	33.390
US-Dollar	Euro	4.846.338	4.354.889	16. Feb. 24	State Street Bank	12.128
EUR						7049.109
Australischer Dollar	Euro	680.476	417.940	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(340)
Kanadischer Dollar	Euro	5.262.803	3.595.606	16. Feb. 24	State Street Bank	(15.521)
Euro	Australischer Dollar	386.421	636.708	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(4.320)
Euro	Australischer Dollar	117.933	192.818	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(397)

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts.						
Euro	Australischer Dollar	626.901	1.056.142	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(21.242)
Euro	Australischer Dollar	8.877.472	14.753.426	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(176.548)
Euro	Kanadischer Dollar	11.786.073	17.373.339	16. Feb. 24	State Street Bank	(32.350)
Euro	Japanischer Yen	136.424	21.473.999	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(1.264)
Euro	Japanischer Yen	2.766.543	436.391.557	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(31.534)
Euro	Japanischer Yen	2.998.413	486.533.888	16. Feb. 24	State Street Bank	(121.168)
Euro	Mexikanischer Peso	570.248	10.895.974	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(4.785)
Euro	Mexikanischer Peso	7.314.904	139.902.656	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(68.429)
Euro	Mexikanischer Peso	928.612	17.712.918	16. Feb. 24	UBS AG	(6.184)
Euro	Neuseeländischer Dollar	22.072.671	39.910.701	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(659.591)
Euro	Neuseeländischer Dollar	3.434.704	6.037.045	16. Feb. 24	State Street Bank	(3.865)
Euro	Neuseeländischer Dollar	685.576	1.239.881	16. Feb. 24	UBS AG	(20.633)
Euro	Norwegische Krone	5.783.552	69.378.634	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(383.536)
Euro	Pfund Sterling	54.656.402	47.747.040	16. Feb. 24	State Street Bank	(192.178)
Euro	Pfund Sterling	975.012	853.722	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(5.687)
Euro	Pfund Sterling	2.925.924	2.560.079	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(14.922)
Euro	Pfund Sterling	3.389.992	2.980.165	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(33.421)
Euro	Schwedische Krone	3.404.574	39.814.309	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(186.678)
Euro	Schwedische Krone	3.368.295	38.541.389	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(108.140)
Japanischer Yen	Euro	437.562.391	2.838.250	16. Feb. 24	State Street Bank	(32.667)
Koreanischer Won	US-Dollar	4.757.169.074	3.697.473	16. Feb. 24	State Street Bank	(25.564)
Pfund Sterling	Euro	1.654.970	1.916.794	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(15.677)
Pfund Sterling	Euro	2.747.907	3.179.947	16. Feb. 24	State Street Bank	(23.337)
Pfund Sterling	Euro	2.284.907	2.640.998	16. Feb. 24	State Street Bank	(16.250)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	8.468.984	35.102.245.306	16. Feb. 24	State Street Bank	(457.274)
US-Dollar	Euro	249.269	232.329	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(7.714)
US-Dollar	Euro	1.489.788	1.356.036	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(13.593)
US-Dollar	Euro	3.065.919	2.796.472	16. Feb. 24	State Street Bank	(33.784)
US-Dollar	Euro	1.255.604	1.146.781	16. Feb. 24	UBS AG	(15.361)
US-Dollar	Euro	1.065.737	978.876	16. Feb. 24	State Street Bank	(18.545)
US-Dollar	Euro	3.809.430	3.506.087	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(73.424)
US-Dollar	Euro	958.860	881.306	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(17.281)
US-Dollar	Euro	491.045	455.120	16. Feb. 24	State Street Bank	(12.641)
US-Dollar	Euro	1.340.178	1.219.868	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(12.238)
US-Dollar	Euro	2.964.259	2.690.888	16. Feb. 24	State Street Bank	(19.805)
US-Dollar	Euro	3.810.971	3.478.934	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(44.882)
US-Dollar	Euro	4.205.344	3.833.223	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(43.804)
US-Dollar	Euro	3.089.429	2.835.392	16. Feb. 24	State Street Bank	(51.519)
US-Dollar	Euro	3.552.154	3.237.170	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(36.338)
US-Dollar	Indische Rupie	4.503.094	376.111.933	16. Feb. 24	State Street Bank	(10.985)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	653.736	10.158.902.239	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.993)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	9.667.434	151.657.869.029	16. Feb. 24	State Street Bank	(127.497)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	4.373.961	20.309.611	16. Feb. 24	State Street Bank	(63.221)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	613.703	2.338.215	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	(16.750)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	5.341.797	20.364.000	16. Feb. 24	State Street Bank	(148.647)
EUR						(3.434.524)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	62.899	67.696	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	236
Schweizer Franken	Euro	65.045	68.754	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.496
Schweizer Franken	Euro	330	350	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	Euro	11.726.875	12.427.760	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	237.500
EUR						239.239
CHF						221.664
Euro	Schweizer Franken	3.213	3.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(49)
Euro	Schweizer Franken	13.727	12.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(245)
Euro	Schweizer Franken	23.676	22.343	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(455)
Euro	Schweizer Franken	1.376	1.301	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(30)
Euro	Schweizer Franken	2.096	1.981	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(43)
Euro	Schweizer Franken	12.404	11.764	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(302)
Euro	Schweizer Franken	3.561	3.375	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(84)
Euro	Schweizer Franken	15.062	14.199	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(273)
EUR						(1.481)
CHF						(1.372)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	1.285	1.359	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
Schweizer Franken	Euro	236.199	250.316	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.784
EUR						4.813
CHF						4.459
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	178	192	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	17.532	18.597	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	326
Schweizer Franken	Euro	166.450	179.145	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	624
Schweizer Franken	Euro	1.117	1.186	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21
Schweizer Franken	Euro	281	299	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Schweizer Franken	Euro	8.164	8.631	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	186
Schweizer Franken	Euro	7.232	7.653	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	158
Schweizer Franken	Euro	174.178	184.111	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.005
Schweizer Franken	Euro	1.047	1.104	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27
Schweizer Franken	Euro	627	662	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16
Schweizer Franken	Euro	50.003	53.042	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	962
Schweizer Franken	Euro	885	938	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18
Schweizer Franken	Euro	31.535.191	33.419.967	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	638.671
Schweizer Franken	Euro	1.257	1.329	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	29
EUR						645.049
CHF						597.661
Euro	Schweizer Franken	1.185	1.117	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
Euro	Schweizer Franken	192	178	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	Schweizer Franken	18.604	17.532	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(330)
Euro	Schweizer Franken	3.837	3.607	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(59)
Euro	Schweizer Franken	71.032	66.941	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.266)
Euro	Schweizer Franken	9.667	9.123	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(186)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	Schweizer Franken	1.536	1.453	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(33)
Euro	Schweizer Franken	2.199	2.078	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(45)
Euro	Schweizer Franken	42.643	40.416	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.008)
Euro	Schweizer Franken	37.672	35.513	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(683)
Euro	Schweizer Franken	1.993	1.880	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(37)
Euro	Schweizer Franken	5.176	4.896	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(112)
EUR						(3.781)
CHF						(3.503)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	7.625	6.575	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	63
EUR						63
GBP						55
Pfund Sterling	Euro	3.109	3.577	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	2.844	3.311	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(40)
Pfund Sterling	Euro	470.503	549.034	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7.883)
EUR						(7.924)
GBP						(6.887)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	42	49	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
EUR						-
GBP						-
Pfund Sterling	Euro	5.951	6.847	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
Pfund Sterling	Euro	281	327	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4)
Pfund Sterling	Euro	5.390	6.277	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(77)
Pfund Sterling	Euro	887.885	1.036.081	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14.876)
EUR						(14.959)
GBP						(13.001)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.170	4.612	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Euro	36	33	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	33	36	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	38	42	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.483	1.623	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18
Euro	US-Dollar	11.299	12.343	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	160
Euro	US-Dollar	508	558	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	966	1.057	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	2.048	2.212	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	53
US-Dollar	Euro	1.126	1.012	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

[illegible]

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	
US-Dollar	Euro	9.954	9.250	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(268)
					EUR	(269)
					USD	(298)

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Brasilien - 1.043.584			
(31. Dezember 2022: 662.557)		1.043.584	9,42
8.357	Afya Ltd - Class A	181.765	1,64
42.810	Fleury SA	159.383	1,44
51.410	Raia Drogasil SA	311.787	2,81
51.412	WEG SA	390.649	3,53
China - 1.951.972			
(31. Dezember 2022: 3.025.027)		1.951.972	17,62
33.281	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	74.214	0,67
8.820	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	203.027	1,83
15.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	25.270	0,23
14.900	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A'	131.485	1,19
33.400	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	213.030	1,92
28.500	Medlive Technology Co Ltd '144A'	30.884	0,28
88.200	NARI Technology Co Ltd 'A'	277.514	2,50
34.350	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	69.609	0,63
9.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	42.960	0,39
38.847	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	345.927	3,12
3.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	143.485	1,30
1.700	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	43.387	0,39
20.300	Sungrow Power Supply Co Ltd	250.580	2,26
11.840	Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	100.600	0,91
Frankreich - 295.107			
(31. Dezember 2022: 212.218)		295.107	2,66
590	L'Oréal SA	295.107	2,66
Deutschland - 319.109			
(31. Dezember 2022: 233.275)		319.109	2,88
7.645	Infineon Technologies AG	319.109	2,88
Hongkong - 533.460			
(31. Dezember 2022: 622.561)		533.460	4,81
43.800	AIA Group Ltd	381.700	3,44
7.809	Prudential Plc	88.060	0,79
64.000	Vitasoy International Holdings Ltd	63.700	0,58
Indien - 3.359.465			
(31. Dezember 2022: 2.893.240)		3.359.465	30,32
2.222	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	152.376	1,38
67.522	Bandhan Bank Ltd '144A'	195.595	1,77
8.263	Dr Lal PathLabs Ltd '144A'	255.972	2,31
8.793	Godrej Consumer Products Ltd	119.484	1,08
8.776	Havells India Ltd	144.313	1,30
31.779	HDFC Bank Ltd	652.507	5,89
21.563	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	167.429	1,51
9.727	Hindustan Unilever Ltd	310.774	2,81
4.322	Info Edge India Ltd	266.860	2,41
50.666	Marico Ltd	333.552	3,01
1.321	PB Fintech Ltd	12.621	0,11
31.272	Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	241.923	2,18
16.979	Syngene International Ltd '144A'	143.339	1,29
7.947	Tata Consultancy Services Ltd	362.720	3,27
Indonesien - 483.988			
(31. Dezember 2022: 346.456)		483.988	4,37
1.304.500	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	483.988	4,37
Mexiko - 259.552			
(31. Dezember 2022: 144.450)		259.552	2,34
73.908	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	153.386	1,38
11.110	Regional SAB de CV	106.166	0,96
Niederlande - 339.667			
(31. Dezember 2022: 260.144)		339.667	3,07
447	ASML Holding NV	339.667	3,07
Republik Korea - 185.345			
(31. Dezember 2022: 190.237)		185.345	1,67
506	Samsung SDI Co Ltd	185.345	1,67

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Südafrika - 542.479			
(31. Dezember 2022: 490.957)		542.479	4,90
1.613	Capitec Bank Holdings Ltd	177.668	1,61
12.055	Clicks Group Ltd	211.904	1,91
19.677	Discovery Ltd	152.907	1,38
Taiwan - 1.236.743			
(31. Dezember 2022: 779.937)		1.236.743	11,16
25.000	Chroma ATE Inc	173.303	1,56
20.000	Delta Electronics Inc	204.135	1,84
33.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	637.086	5,75
4.000	Voltronic Power Technology Corp	222.219	2,01
Vereinigte Staaten von Amerika - 136.565			
(31. Dezember 2022: 272.193)		136.565	1,23
7.360	Livent Corp	136.565	1,23
Gesamtanlagen in Aktien		10.687.036	96,45
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 1.793 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 381)		1.793	0,02
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		10.688.829	96,47
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (31) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.240))		(31)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(31)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		391.918	3,53
Summe Nettovermögen		11.080.716	100,00
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,54	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,02	
Sonstiges Umlaufvermögen		4,44	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EURE (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	143	159	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	132	147	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	90	99	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	103	112	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	215	236	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.234	11.015	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	326
USD						331
EUR						299
US-Dollar	Euro	59	54	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	98	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	77	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(4)
EUR						(4)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	140	155	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	128	142	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	87	96	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	101	110	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	210	232	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.043	10.810	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	320
USD						324
EUR						292
US-Dollar	Euro	59	54	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	98	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	76	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(4)
EUR						(4)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	143	158	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	131	146	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Euro	US-Dollar	89	99	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	102	112	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	214	235	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	10.197	10.975	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	325
USD						330
EUR						298
US-Dollar	Euro	59	54	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	98	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	77	71	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(4)
EUR						(4)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	148	188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	92	117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	105	133	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.421	13.080	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	202
US-Dollar	Pfund Sterling	68	53	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						202
GBP						158
Pfund Sterling	US-Dollar	137	175	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	220	281	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	116	92	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	91	72	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(5)
GBP						(4)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	148	188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	92	117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	105	133	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	220	281	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.421	13.080	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	202
US-Dollar	Pfund Sterling	68	53	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						202
GBP						158
Pfund Sterling	US-Dollar	137	175	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	91	72	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	116	92	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(4)
GBP						(3)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	147	188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	92	117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	104	132	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Pfund Sterling	US-Dollar	10.383	13.032	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	202

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EQUITY FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Bermudas - 5.711.626			
(31. Dezember 2022: –)			
29.331	RenaissanceRe Holdings Ltd	5.711.626	1,30
China - 4.400.024			
(31. Dezember 2022: 10.560.330)			
973.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	4.400.024	1,00
Dänemark - 11.945.535			
(31. Dezember 2022: 3.510.619)			
101.167	Chr Hansen Holding A/S	8.528.633	1,94
61.428	Orsted AS '144A'	3.416.902	0,78
Frankreich - 19.334.748			
(31. Dezember 2022: 21.395.841)			
1.998	Hermes International SCA	4.252.634	0,97
20.855	L'Oreal SA	10.431.294	2,38
197.536	Technip Energies NV	4.650.820	1,06
Deutschland - 9.239.266			
(31. Dezember 2022: 13.559.243)			
221.348	Infineon Technologies AG	9.239.266	2,11
Hongkong - 9.373.428			
(31. Dezember 2022: 10.727.872)			
1.075.600	AIA Group Ltd	9.373.428	2,14
Indien - 8.995.935			
(31. Dezember 2022: 4.990.576)			
438.128	HDFC Bank Ltd	8.995.935	2,05
Indonesien - 8.642.137			
(31. Dezember 2022: 3.730.448)			
23.293.300	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	8.642.137	1,97
Japan - 8.750.706			
(31. Dezember 2022: 13.557.241)			
92.500	Sony Group Corp	8.750.706	2,00
Niederlande - 28.712.771			
(31. Dezember 2022: 30.124.781)			
10.724	ASML Holding NV	8.148.977	1,86
269.345	Relx Plc	10.675.087	2,43
69.284	Wolters Kluwer NV	9.888.707	2,25
Spanien - 2.248.504			
(31. Dezember 2022: –)			
51.396	Industria de Diseno Textil SA	2.248.504	0,51
Schweiz - 8.109.636			
(31. Dezember 2022: 28.903.539)			
19.208	Lonza Group AG	8.109.636	1,85
Taiwan - 7.769.944			
(31. Dezember 2022: 3.662.933)			
402.470	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.769.944	1,77
Vereinigtes Königreich - 25.544.784			
(31. Dezember 2022: 27.371.292)			
62.928	AstraZeneca Plc	8.482.140	1,93
82.610	Croda International Plc	5.344.343	1,22
143.079	Genus Plc	3.929.735	0,90
785.283	Informa Plc	7.788.566	1,77
Vereinigte Staaten von Amerika - 273.972.546			
(31. Dezember 2022: 194.643.250)			
34.664	Accenture Plc - Class A	12.191.675	2,78
99.424	Alphabet Inc - Class A	13.943.222	3,18
95.574	Amazon.com Inc	14.657.229	3,34
118.017	Apple Inc	22.845.141	5,21
35.822	Applied Materials Inc	5.843.822	1,33
152.078	Boston Scientific Corp	8.559.710	1,95

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
109.374	CMS Energy Corp	6.343.145	1,45
19.351	Costco Wholesale Corp	12.833.486	2,92
40.516	Danaher Corp	9.451.978	2,15
87.541	Darling Ingredients Inc	4.395.871	1,00
33.108	Ecolab Inc	6.587.002	1,50
68.130	Eversource Energy	4.221.675	0,96
35.507	ICON Plc	10.144.705	2,31
160.306	Ingersoll Rand Inc	12.472.608	2,84
43.790	JPMorgan Chase & Co	7.457.656	1,70
28.706	Mastercard Inc	12.248.420	2,79
77.592	Microsoft Corp	29.119.114	6,64
23.899	New Linde Plc	9.792.334	2,23
84.479	NextEra Energy Inc	5.157.021	1,18
25.533	NVIDIA Corp	12.643.559	2,88
66.408	Progressive Corp/The	10.517.367	2,40
18.013	Roper Technologies Inc	9.836.089	2,24
106.148	Sanofi SA	10.561.048	2,41
46.164	Trane Technologies Plc	11.261.246	2,57
40.353	Veralto Corp	3.351.518	0,76
38.200	Zoetis Inc	7.535.905	1,72
Gesamtanlagen in Aktien		432.751.590	98,63
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		432.751.590	98,63
Nettoumlaufvermögen		6.008.145	1,37
Summe Nettovermögen		438.759.735	100,00
* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,50	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,50	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 59.364			
(31. Dezember 2022: 719.874)		59.364	0,35
67.709	Cordiant Digital Infrastructure Ltd./Fund	59.364	0,35
Irland - 827.132			
(31. Dezember 2022: 662.864)		827.132	4,87
1.786	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	166.139	0,98
33.554	iShares Global Clean Energy UCITS ETF	274.252	1,62
171.142	iShares MSCI India UCITS ETF	133.119	0,78
1.955	Leadenhall Ucits IIs Fund Plc	253.622	1,49
Vereinigtes Königreich - 164.751			
(31. Dezember 2022: 3.163.828)		164.751	0,97
22.254	Aquila European Renewables Plc	17.469	0,10
40.147	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	50.350	0,30
49.425	Harmony Energy Income Trust Plc	45.096	0,27
33.985	Pantheon Infrastructure Plc	32.455	0,19
21.707	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	19.381	0,11
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.051.247	6,19
Anleihen			
Brasilien - 497.396			
(31. Dezember 2022: -)		497.396	2,93
3.720.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	497.396	2,93
Frankreich - 710.421			
(31. Dezember 2022: 1.879.479)		710.421	4,18
712.934	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	710.421	4,18
Ungarn - 83.591			
(31. Dezember 2022: 464.102)		83.591	0,49
87.000	Hungary Government International Bond 1.250% 22-Oct-2025	83.591	0,49
Indonesien - 115.894			
(31. Dezember 2022: -)		115.894	0,68
1.387.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	80.629	0,47
580.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-Feb-2033	35.265	0,21
Irland - 106.309			
(31. Dezember 2022: 548.831)		106.309	0,63
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	106.309	0,63
Italien - 1.085.714			
(31. Dezember 2022: 5.052.346)		1.085.714	6,39
397.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2024	396.644	2,33
691.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	689.070	4,06
Luxemburg - 136.431			
(31. Dezember 2022: 255.287)		136.431	0,80
142.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	136.431	0,80
Mexiko - 796.412			
(31. Dezember 2022: 1.559.660)		796.412	4,69
5.360.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	266.443	1,57
11.060.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	529.969	3,12
Rumänien - 71.221			
(31. Dezember 2022: -)		71.221	0,42
78.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.000% 25-May-2034	71.221	0,42

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigtes Königreich - 342.515			
(31. Dezember 2022: 4.087.033)		342.515	2,01
105.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' FRN 8.375% 20-Dec-2083	128.211	0,75
100.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	112.055	0,66
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	102.249	0,60
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.168.793			
(31. Dezember 2022: 3.902.429)		1.168.793	6,88
169.000	American Express Co 3.375% 03-May-2024	151.431	0,89
121.000	Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	112.100	0,66
135.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	111.377	0,66
114.000	PepsiCo Inc 3.600% 01-Mar-2024	102.591	0,60
785.953	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	691.294	4,07
Gesamtanlagen in Anleihen		5.114.697	30,10
Aktien			
Bermudas - 151.176			
(31. Dezember 2022: 220.647)		151.176	0,89
489	Credicorp Ltd	66.618	0,39
481	RenaissanceRe Holdings Ltd	84.558	0,50
Brasilien - 88.105			
(31. Dezember 2022: 296.517)		88.105	0,52
32.571	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	88.105	0,52
Dänemark - 27.438			
(31. Dezember 2022: 250.876)		27.438	0,16
550	Novozymes A/S	27.438	0,16
Finnland - 139.049			
(31. Dezember 2022: 880.963)		139.049	0,82
4.289	Neste Oyj	139.049	0,82
Frankreich - 144.113			
(31. Dezember 2022: 1.038.745)		144.113	0,85
86	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	63.275	0,37
900	Sanofi SA	80.838	0,48
Hongkong - 119.583			
(31. Dezember 2022: 1.216.901)		119.583	0,70
15.200	AIA Group Ltd	119.583	0,70
Indien - 178.412			
(31. Dezember 2022: 816.982)		178.412	1,05
9.625	HDFC Bank Ltd	178.412	1,05
Indonesien - 135.886			
(31. Dezember 2022: 199.577)		135.886	0,80
405.700	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	135.886	0,80
Irland - 438.393			
(31. Dezember 2022: 2.363.830)		438.393	2,58
71.682	Greencoat Renewables Plc	72.255	0,43
680	Linde Plc	251.622	1,48
520	Trane Technologies Plc	114.516	0,67
Japan - 85.404			
(31. Dezember 2022: 1.051.378)		85.404	0,50
1.000	Sony Group Corp	85.404	0,50
Niederlande - 362.293			
(31. Dezember 2022: 1.094.172)		362.293	2,13
206	ASML Holding NV	141.316	0,83
4.048	Technip Energies NV	86.040	0,51
5.219	Universal Music Group NV	134.937	0,79

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Norwegen - 42.396			
(31. Dezember 2022: 273.769)			
35.408	Aker Carbon Capture ASA	42.396	0,25
Republik Korea - 123.839			
(31. Dezember 2022: 433.608)			
2.252	Samsung Electronics Co Ltd	123.839	0,73
Schweiz - 591.242			
(31. Dezember 2022: 1.837.056)			
2.178	Alcon Inc	153.337	0,90
297	Lonza Group AG	113.202	0,67
2.052	Nestle SA	215.180	1,27
417	Roche Holding AG	109.523	0,64
Taiwan - 284.952			
(31. Dezember 2022: 540.267)			
2.484	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	234.799	1,38
1.000	Voltronic Power Technology Corp	50.153	0,30
Vereinigtes Königreich - 1.746.252			
(31. Dezember 2022: 9.550.877)			
3.106	3i Group Plc	86.412	0,51
4.781	Anglo American Plc	109.287	0,64
1.484	AstraZeneca Plc	180.582	1,06
989	Croda International Plc	57.761	0,34
5.859	Halma Plc	154.577	0,91
36.216	Impact Healthcare Reit Plc (REIT) - Class B	37.669	0,22
11.863	Informa Plc	106.219	0,62
19.710	Land Securities Group Plc (REIT)	160.878	0,95
6.970	Prudential Plc	70.957	0,42
3.443	Reckitt Benckiser Group Plc	215.385	1,27
6.090	Relx Plc	217.900	1,28
10.725	Rentokil Initial Plc	54.500	0,32
26.244	Schroder Bsc Social Impact Trust Plc	26.422	0,16
80.928	Shaftesbury Capital Plc (REIT)	127.846	0,75
3.194	Unilever Plc	139.857	0,82
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.234.700			
(31. Dezember 2022: 8.275.213)			
679	Alphabet Inc - Class A	85.965	0,51
1.674	Amazon.com Inc	231.764	1,36
471	AMETEK Inc	70.216	0,41
803	CME Group Inc	153.017	0,90
460	Danaher Corp	96.879	0,57
209	Deere & Co	75.379	0,44
319	Eli Lilly & Co	167.342	0,99
624	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	83.161	0,49
470	Goldman Sachs Group Inc/The	164.050	0,97
466	Hubbell Inc - Class B	138.069	0,81
222	Lam Research Corp	158.239	0,93
184	Mastercard Inc	70.877	0,42
1.166	Microsoft Corp	395.037	2,33
644	NVIDIA Corp	287.893	1,69
319	Zoetis Inc	56.812	0,33
Gesamtanlagen in Aktien		6.893.233	40,56
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 253.578			
(31. Dezember 2022: 2.768.419)			
46.257	Bluefield Solar Income Fund Ltd	62.643	0,37
43.006	International Public Partnerships Ltd	67.889	0,40
18.932	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	22.153	0,13
77.123	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	100.893	0,59
Luxemburg - 33.868			
(31. Dezember 2022: 370.043)			
20.729	BBGI Global Infrastructure SA	33.868	0,20

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Kapitalbeteiligungsinstrumente Forts.			
Vereinigtes Königreich - 360.342			
(31. Dezember 2022: 2.848.062)			
120.698	BioPharma Credit Plc/The Fund	92.400	0,55
125.441	Greencoat UK Wind Plc/Funds	218.083	1,28
66.007	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	49.859	0,29
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		647.788	3,81
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 717.648			
(31. Dezember 2022: 3.191.487)			
1.809	Amundi Physical Gold ETC	134.183	0,79
508	Invesco Physical Gold ETC	91.504	0,54
12.201	iShares Physical Gold ETC	443.149	2,61
2.375	iShares Physical Silver ETC	48.812	0,28
Jersey - 34.922			
(31. Dezember 2022: 877.325)			
1.364	Wisdomtree Carbon - ETC	34.922	0,21
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		752.570	4,43
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Curacao - 92.066			
(31. Dezember 2022: –)			
961	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	92.066	0,54
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		92.066	0,54
Optionsscheine			
Luxemburg - 331.667			
(31. Dezember 2022: 1.290.415)			
3.531	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	331.667	1,95
Vereinigtes Königreich - 1.178.051			
(31. Dezember 2022: 3.521.153)			
5.222	Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	504.097	2,97
5.281	Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	501.640	2,95
	Goldman Sachs Series 2023-06 Senior Secured Index Linked Notes relating to the Goldman Sachs Systemic Skew US Series 2F Total		
1.800	Return Strategy due 07-May-2025	172.314	1,01
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		1.509.718	8,88
Währungsoptionen - 33.718			
(31. Dezember 2022: –)			
12	IMM JPY Call 08-Mar-2024 69.500	33.718	0,20
Währungsoptionen insgesamt		33.718	0,20
Börsengehandelte Rohstoffoptionen – 71.005			
(31. Dezember 2022: –)			
371	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 40.500	71.005	0,42
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		71.005	0,42
Indexoptionen - 249.714			
(31. Dezember 2022: 595.942)			
7	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4,850.000	39.496	0,23
10	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4,700.000	106.166	0,63
13	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4,350.000	104.052	0,61
Indexoptionen insgesamt		249.714	1,47

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 31.236				
(31. Dezember 2022: 972.959)				
2	E-mini Russell 2000 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	187.713	15.181	0,09
41	Micro E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	894.296	3.377	0,02
9	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.672.024	12.678	0,08
Offene Terminkontrakte insgesamt			31.236	0,19
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 332.221 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 635.186)			332.221	1,96
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			16.779.213	98,75

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Währungsoptionen - (14.896)			
(31. Dezember 2022: -)			
(12)	IMM JPY Call 08-Mar-2024 72.000	(14.896)	(0,09)
Währungsoptionen insgesamt		(14.896)	(0,09)
Aktioptionen - (1.311)			
(31. Dezember 2022: -)			
(12)	Standard Chartered Plc Put 16-Feb-2024 620.000	(1.311)	(0,01)
Aktioptionen insgesamt		(1.311)	(0,01)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen - (50.208)			
(31. Dezember 2022: -)			
(371)	iShares Physical Gold Options Call 21-Jun-2024 43.000	(38.517)	(0,23)
(185)	iShares Physical Gold Options Put 21-Jun-2024 39.000	(11.691)	(0,07)
Börsengehandelte Rohstoffoptionen insgesamt		(50.208)	(0,30)
Optionen auf Futures - (1.340)			
(31. Dezember 2022: -)			
(5)	U.S. Treasury Bond Future Put 26-Jan-2024 120.000	(1.340)	(0,01)
Optionen auf Futures insgesamt		(1.340)	(0,01)
Indexoptionen - (134.717)			
(31. Dezember 2022: (318.687))			
(7)	CBOE S&P 500 Index Call 15-Feb-2024 4.950.000	(16.178)	(0,10)
(10)	CBOE S&P 500 Index Call 18-Jan-2024 4.775.000	(56.649)	(0,33)
(6)	CBOE S&P 500 Index Put 15-Mar-2024 3.650.000	(1.896)	(0,01)
(13)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Sep-2024 4.000.000	(59.994)	(0,35)
Indexoptionen insgesamt		(134.717)	(0,79)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (4.487)				
(31. Dezember 2022: (294.152))				
14	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2024	638.120	(4.487)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(4.487)	(0,03)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (150.856) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (343.366))			(150.856)	(0,89)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(357.815)	(2,12)
Nettoumlaufvermögen			573.291	3,49
Summe Nettovermögen			16.994.689	100,00

Die Kontrahenten für Währungsoptionen ist UBS AG.
Der Kontrahent für Aktioptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG.
Der Kontrahent für börsengehandelte Rohstoffoptionen ist UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	90,12
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,52
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,99
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,07
Sonstiges Umlaufvermögen	5,30
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (B)	Betrag Abrechnungs- (V)	datum	Kontrahent	
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)						
Euro	Pfund Sterling	278.387	240.364	16. Jan. 24	State Street Bank	1.973
Euro	Pfund Sterling	4.414	3.789	16. Jan. 24	State Street Bank	57
Euro	Pfund Sterling	6.228.855	5.407.554	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	10.262
Indonesische Rupiah	US-Dollar	2.943.768.928	185.251	16. Jan. 24	State Street Bank	5.031
Pfund Sterling	Euro	38.016	43.495	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	223
Pfund Sterling	Euro	16.050	18.353	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	104
Pfund Sterling	Euro	68.728	78.480	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	556
Pfund Sterling	Euro	1.054.509	1.202.780	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	9.887
Pfund Sterling	Euro	38.337	43.672	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	415
Pfund Sterling	Euro	47.363	54.286	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	181
Pfund Sterling	Euro	105.590	120.733	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	694
Pfund Sterling	Euro	194.241	221.565	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	1.808
Pfund Sterling	Euro	112.995	129.906	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	36
Pfund Sterling	Euro	750.670	858.877	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	4.380
Pfund Sterling	Euro	24.131	27.722	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	28
Euro	Ungarischer Forint	74.552	28.502.192	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	569
Euro	Ungarischer Forint	75.532	29.020.198	16. Feb. 24	Barclays Bank PLC	204
Euro	US-Dollar	12.052	13.152	16. Feb. 24	UBS AG	201
Euro	US-Dollar	122.217	134.032	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	1.441
Euro	US-Dollar	18.072	19.830	16. Feb. 24	State Street Bank	203
Euro	US-Dollar	49.414	54.327	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	460
Euro	US-Dollar	30.907	33.854	16. Feb. 24	State Street Bank	402
Euro	US-Dollar	41.022	44.260	16. Feb. 24	State Street Bank	1.139
Euro	US-Dollar	117.894	127.140	16. Feb. 24	UBS AG	3.329
Euro	US-Dollar	331.651	360.221	16. Feb. 24	UBS AG	7.057
Euro	US-Dollar	556.894	608.436	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	8.634
Euro	US-Dollar	486.631	522.174	16. Feb. 24	UBS AG	16.102
Euro	US-Dollar	22.172	24.308	16. Feb. 24	State Street Bank	268
Euro	US-Dollar	359.287	396.082	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	2.379
Euro	US-Dollar	3.242	3.562	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	33
Euro	US-Dollar	118.180	129.339	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	1.633
Euro	US-Dollar	22.564	24.637	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	364
Euro	US-Dollar	369.321	402.125	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	6.968
Euro	US-Dollar	86.555	94.769	16. Feb. 24	UBS AG	1.159
Euro	US-Dollar	7.064.062	7.588.618	16. Feb. 24	UBS AG	225.987
Ungarischer Forint	Euro	57.522.390	149.256	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	54
Neuseeländischer Dollar	Euro	66.781	36.428	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	1.609
Schweizer Franken	Euro	21.866	22.751	16. Feb. 24	State Street Bank	917
Schweizer Franken	Euro	223.229	232.523	16. Feb. 24	UBS AG	9.105
Schweizer Franken	Euro	37.746	40.098	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	759
Schweizer Franken	Euro	39.590	41.240	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	1.614
Schweizer Franken	Euro	8.597	9.147	16. Feb. 24	State Street Bank	159
Schweizer Franken	Euro	3.948	4.209	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	65
Schweizer Franken	Euro	31.411	32.746	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	1.254
Schweizer Franken	Euro	55.448	57.850	16. Feb. 24	UBS AG	2.168
Australischer Dollar	Euro	49.175	30.002	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	165
Japanischer Yen	Euro	14.198.592	91.164	14. Mrz. 24	State Street Bank	160
EUR						332.196
Euro	Pfund Sterling	126.610	110.631	16. Jan. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(614)
Euro	Pfund Sterling	21.730	19.008	16. Jan. 24	UBS AG	(129)
Euro	Pfund Sterling	51.513	44.898	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(119)
Pfund Sterling	Euro	43.119	49.662	16. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(76)
Pfund Sterling	Euro	21.749	25.328	16. Jan. 24	State Street Bank	(317)
Pfund Sterling	Euro	673.311	776.196	16. Jan. 24	HSBC Bank plc	(1.900)
Pfund Sterling	Euro	16.113	18.545	16. Jan. 24	State Street Bank	(16)
Pfund Sterling	Euro	68.827	79.347	16. Jan. 24	State Street Bank	(198)
Pfund Sterling	Euro	11.664	13.462	16. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(49)
Pfund Sterling	Euro	239.873	277.212	16. Jan. 24	State Street Bank	(1.362)
Pfund Sterling	Euro	196.714	229.474	16. Jan. 24	State Street Bank	(3.256)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	351.046	5.491.409.754	16. Jan. 24	State Street Bank	(4.447)

Devisenterminkontrakte Forts.						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
Euro	Neuseeländischer Dollar	25.365	45.941	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(802)
Euro	Schweizer Franken	28.015	26.855	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.054)
Euro	Schweizer Franken	793.633	759.178	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(28.118)
Hongkong-Dollar	Euro	75.931	8.923	16. Feb. 24	Citigroup Global Markets Limited	(155)
Hongkong-Dollar	Euro	634.523	74.529	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(1.255)
Hongkong-Dollar	Euro	907.458	108.288	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.496)
Hongkong-Dollar	Euro	263.681	30.745	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(296)
US-Dollar	Euro	22.551	21.032	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(711)
US-Dollar	Euro	103.428	93.872	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(673)
US-Dollar	Euro	178.698	163.126	16. Feb. 24	Royal Bank of Scotland	(2.102)
US-Dollar	Euro	400.362	364.478	16. Feb. 24	State Street Bank	(3.713)
US-Dollar	Euro	196.343	178.555	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.630)
US-Dollar	Euro	1.630.180	1.517.573	16. Feb. 24	State Street Bank	(48.623)
US-Dollar	Euro	199.823	182.438	16. Feb. 24	State Street Bank	(2.378)
US-Dollar	Euro	292.179	266.515	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.234)
US-Dollar	Euro	59.114	53.878	16. Feb. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(610)
US-Dollar	Euro	1.811.651	1.658.706	16. Feb. 24	UBS AG	(26.233)
US-Dollar	Euro	199.823	181.998	16. Feb. 24	State Street Bank	(1.938)
US-Dollar	Euro	108.599	98.254	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(396)
US-Dollar	Euro	226.825	206.353	16. Feb. 24	HSBC Bank plc	(1.962)
Japanischer Yen	Euro	14.198.591	91.402	14. Mrz. 24	UBS AG	(78)
Japanischer Yen	Euro	28.398.706	182.846	14. Mrz. 24	Canadian Imperial Bank of Commerce	(188)
EUR						(142.128)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	5	6	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	6	5	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	625	542	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	Pfund Sterling	51	44	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
EUR						1
GBP						1
Pfund Sterling	Euro	867	999	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	622	719	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	Euro	971	1.126	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
Pfund Sterling	Euro	73.848	86.174	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.237)
EUR						(1.250)
GBP						(1.086)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	159	175	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Euro	283	255	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
EUR						2
USD						2
US-Dollar	Euro	206	188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	321	292	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse (EUR) USD E (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	23.863	22.177	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(643)
						EUR (647)
						USD (717)

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	1.682	1.850	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
US-Dollar	Euro	2.980	2.681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
						EUR 22
						USD 24
US-Dollar	Euro	3.386	3.076	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	252.017	234.205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(6.789)
US-Dollar	Euro	2.161	1.971	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
						EUR (6.831)
						USD (7.567)

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 5.283.804			
(31. Dezember 2022: -)			
39.561	iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF	5.283.804	5,61
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		5.283.804	5,61
Anleihen			
Australien - 8.201.282			
(31. Dezember 2022: 3.719.153)			
960.000	Angle Asset Finance Trust 2023-1 '2023-1 C' FRN 8.102% 17-Jan-2029	664.734	0,70
720.000	Liberty PRIME Series 2022-1 '2022-1SME C' FRN 8.040% 10-Oct-2054	490.777	0,52
941.000	Liberty Series 2023-1 '2023-1 B' FRN 7.058% 25-Jun-2054	636.071	0,67
880.000	Mortgage House RMBS Osmium Series 2023-1 '2023-1 A2' FRN 6.798% 15-Aug-2054	609.346	0,65
563.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	670.866	0,71
760.000	Pepper Residential Securities Trust NO 34 FRN 8.004% 12-Dec-2063	523.952	0,56
690.000	Pepper Residential Securities Trust NO 35 FRN 6.854% 12-May-2064	477.678	0,51
1.020.000	Pepper SPARKZ Trust No. 6 'SPK-6 C' FRN 7.702% 16-Mar-2032	706.181	0,75
1.800.000	Resimac Bastille Trust Series 2023-1NC '2023-1NC B' FRN 7.690% 09-Jan-2055	1.252.107	1,33
650.000	Santos Finance Ltd 'EMTN' 5.250% 13-Mar-2029	636.698	0,68
660.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'EMTN' 1.450% 28-Mar-2029	646.105	0,69
300.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 4.375% 03-May-2033	350.338	0,37
808.000	Triton Bond Trust 2022-1 in respect of Series 1 '2022-1 C' FRN 6.040% 11-Sep-2053	536.429	0,57
Österreich - 1.648.436			
(31. Dezember 2022: 782.706)			
417.000	Benteler International AG '144A' 10.500% 15-May-2028	439.697	0,47
400.000	Benteler International AG 'REGS' 9.375% 15-May-2028	473.475	0,50
500.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	500.985	0,53
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	234.279	0,25
Bermudas - 315.636			
(31. Dezember 2022: -)			
275.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	315.636	0,33
Brasilien - 398.453			
(31. Dezember 2022: 840.581)			
200.000	Coruipie Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	154.000	0,16
300.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	244.453	0,26
Kanada - 855.899			
(31. Dezember 2022: 1.070.266)			
1.039.000	Emera US Finance LP 2.639% 15-Jun-2031	855.899	0,91
Chile - 176.832			
(31. Dezember 2022: 201.424)			
200.000	Sociedad de Transmisión Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	176.832	0,19
China - 508.654			
(31. Dezember 2022: 840.996)			
600.000	Prosus NV 'REGS' 2.031% 03-Aug-2032	508.654	0,54
Kolumbien - 260.468			
(31. Dezember 2022: 552.883)			
300.000	Aris Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	260.468	0,28

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Elfenbeinküste - 399.932			
(31. Dezember 2022: 202.805)			
240.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	225.313	0,24
175.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.250% 22-Mar-2030	174.619	0,18
Zypern - 409.656			
(31. Dezember 2022: -)			
359.000	Bank of Cyprus Plc 'EMTN' FRN 7.375% 25-Jul-2028	409.656	0,43
Ecuador - 191.072			
(31. Dezember 2022: 187.728)			
290.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 6.000% 31-Jul-2030	135.072	0,14
175.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2040	56.000	0,06
Finnland - 947.403			
(31. Dezember 2022: -)			
800.000	Fortum Oyj 'EMTN' 4.500% 26-May-2033	947.403	1,01
Frankreich - 7.912.147			
(31. Dezember 2022: 7.750.465)			
200.000	ALD SA 'EMTN' 4.875% 06-Oct-2028	234.630	0,25
388.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 7.000% 01-May-2029	455.063	0,48
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 5.750% 13-Jun-2032	403.333	0,43
546.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	540.471	0,57
400.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Dec-2027	395.201	0,42
477.000	Emeria SASU 'REGS' 3.375% 31-Mar-2028	455.014	0,48
400.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	469.935	0,50
476.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	523.450	0,56
400.000	iliad SA 5.375% 15-Feb-2029	454.841	0,48
300.000	IPD 3 BV 'REGS' 8.000% 15-Jun-2028	355.518	0,38
300.000	Kering SA 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2032	399.617	0,42
500.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 5.500% 05-Mar-2034	581.022	0,62
200.000	Orano SA 'EMTN' 5.375% 15-May-2027	231.957	0,25
450.000	Paprec Holding SA 'REGS' 3.500% 01-Jul-2028	482.888	0,51
197.000	Paprec Holding SA 'REGS' 7.250% 17-Nov-2029	234.329	0,25
420.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	454.161	0,48
300.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	357.222	0,38
81.000	WEA Finance LLC '144A' 4.125% 20-Sep-2028	72.263	0,08
39.000	WEA Finance LLC '144A' 4.625% 20-Sep-2048	26.571	0,03
881.000	WEA Finance LLC 'REGS' 2.875% 15-Jan-2027	784.661	0,83
Deutschland - 3.456.902			
(31. Dezember 2022: 2.840.697)			
500.000	Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	584.450	0,62
460.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	436.802	0,46
128.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 1.875% 24-May-2030	134.304	0,14
250.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 2.750% 19-Mar-2029	278.264	0,30
101.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 3.250% 19-May-2033	115.605	0,12
450.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	495.016	0,53
800.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	921.775	0,98
396.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	406.071	0,43
100.000	Vonovia SE 1.000% 16-Jun-2033	84.615	0,09
Griechenland - 544.505			
(31. Dezember 2022: -)			
468.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	544.505	0,58
Guatemala - 777.944			
(31. Dezember 2022: -)			
400.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	350.262	0,37

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Guatemala Forts.		
450.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	427.682	0,46
	Hongkong - 189.251		
	(31. Dezember 2022: -)	189.251	0,20
200.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	189.251	0,20
	Ungarn - 728.040		
	(31. Dezember 2022: -)	728.040	0,77
343.000	Hungary Government International Bond 5.375% 12-Sep-2033	406.032	0,43
300.000	OTP Bank Nyrt FRN 2.875% 15-Jul-2029	322.008	0,34
	Indien - 162.860		
	(31. Dezember 2022: -)	162.860	0,17
180.000	Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	162.860	0,17
	Indonesien - 866.227		
	(31. Dezember 2022: 813.208)	866.227	0,92
400.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 5.315% 14-Apr-2032	393.971	0,42
500.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	472.256	0,50
	Irland - 1.861.786		
	(31. Dezember 2022: 143.624)	1.861.786	1,98
225.827	Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC FRN 5.394% 17-Aug-2033	236.033	0,25
500.000	Mulcair Securities No 3 DAC FRN 5.719% 24-Apr-2065	549.245	0,58
465.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	488.435	0,52
270.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	316.518	0,34
222.994	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 6.971% 17-Aug-2031	271.555	0,29
	Israel - 320.365		
	(31. Dezember 2022: 276.397)	320.365	0,34
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.750% 09-May-2027	320.365	0,34
	Italien - 2.177.184		
	(31. Dezember 2022: 326.445)	2.177.184	2,31
100.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.875% 26-Sep-2029	98.935	0,10
100.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	114.449	0,12
324.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	379.029	0,40
210.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 4.500% 20-Feb-2043	240.677	0,26
350.000	Fiber Bidco SpA 'REGS' 11.000% 25-Oct-2027	424.654	0,45
400.000	Fiber Bidco SpA 'REGS' FRN 9.893% 25-Oct-2027	451.893	0,48
409.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' 10.000% 06-Feb-2028	467.547	0,50
	Luxemburg - 1.474.619		
	(31. Dezember 2022: 1.423.841)	1.474.619	1,57
300.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	258.371	0,28
451.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	387.218	0,41
177.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	186.383	0,20
110.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' 8.750% 01-May-2028	124.636	0,13
530.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	518.011	0,55
	Mexiko - 363.842		
	(31. Dezember 2022: 2.090.898)	363.842	0,39
400.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN 5.125% 18-Jan-2033	363.842	0,39

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Niederlande - 2.992.926		
	(31. Dezember 2022: 4.135.766)	2.992.926	3,18
220.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	276.897	0,29
285.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	303.382	0,32
270.000	Coöperatieve Rabobank UA '144A' FRN 3.758% 06-Apr-2033	243.181	0,26
491.000	Dutch Property Finance 2021-2 BV FRN 4.752% 28-Apr-2059 4.752% 28-Apr-2059	533.113	0,57
200.000	ING Groep NV FRN 6.114% 11-Sep-2034	209.990	0,22
400.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 1.500% 01-Mar-2025	435.889	0,46
500.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	514.416	0,55
451.000	TMNL Holding BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	476.058	0,51
	Nigeria - 358.320		
	(31. Dezember 2022: 353.412)	358.320	0,38
400.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	358.320	0,38
	Panama - 418.150		
	(31. Dezember 2022: 419.481)	418.150	0,44
450.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	418.150	0,44
	Peru - 880.649		
	(31. Dezember 2022: 802.392)	880.649	0,94
400.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' FRN 4.000% 08-Jul-2030	383.470	0,41
700.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	497.179	0,53
	Polen - 584.450		
	(31. Dezember 2022: -)	584.450	0,62
500.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	584.450	0,62
	Portugal - 492.000		
	(31. Dezember 2022: 105.496)	492.000	0,52
400.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	492.000	0,52
	Republik Korea - 194.977		
	(31. Dezember 2022: 896.012)	194.977	0,21
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	194.977	0,21
	Rumänien - 280.049		
	(31. Dezember 2022: 254.370)	280.049	0,30
55.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	49.410	0,05
125.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	127.550	0,14
88.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Sep-2033	103.089	0,11
	Slowenien - 526.412		
	(31. Dezember 2022: -)	526.412	0,56
500.000	United Group BV 'REGS' 4.625% 15-Aug-2028	526.412	0,56
	Südafrika - 178.459		
	(31. Dezember 2022: 1.628.667)	178.459	0,19
300.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS' 5.500% 04-Sep-2026	178.459	0,19
	Spanien - 4.075.908		
	(31. Dezember 2022: 2.200.813)	4.075.908	4,33
500.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	515.950	0,55
300.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	349.098	0,37
700.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	682.029	0,73
539.000	Grifols Escrow Issuer SA 'REGS' 3.875% 15-Oct-2028	546.062	0,58
400.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	433.953	0,46
400.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	425.335	0,45
444.000	Kaixo Bondco Telecom SA 'REGS' 5.125% 30-Sep-2029	462.310	0,49

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Spanien Forts.		
700.000	Merlin Properties Sociemi SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	661.171	0,70
	Schweden - 1.303.611		
	(31. Dezember 2022: 422.870)	1.303.611	1,38
402.000	Assemblin Group AB 'REGS' FRN 8.964% 05-Jul-2029	453.680	0,48
400.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	373.170	0,39
437.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	476.761	0,51
	Schweiz - 1.880.162		
	(31. Dezember 2022: 1.631.099)	1.880.162	2,00
386.000	UBS Group AG 0.875% 03-Nov-2031	346.962	0,37
430.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	436.610	0,46
180.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	187.473	0,20
710.000	UBS Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	909.117	0,97
	Thailand - 711.545		
	(31. Dezember 2022: 478.421)	711.545	0,76
400.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.466% 23-Sep-2036	336.811	0,36
410.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	374.734	0,40
	Vereinigtes Königreich - 14.118.595		
	(31. Dezember 2022: 8.683.376)	14.118.595	14,99
457.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	410.532	0,44
370.000	3i Group Plc 4.875% 14-Jun-2029	428.583	0,46
530.000	AA Bond Co Ltd 5.500% 31-Jul-2027	641.806	0,68
355.000	B&M European Value Retail SA 8.125% 15-Nov-2030	481.696	0,51
400.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	398.019	0,42
394.000	Canada Square Funding 2020-1 Plc '2020-1 B' FRN 7.020% 17-Dec-2056	502.190	0,53
379.000	CPUK Finance Ltd 6.136% 28-Aug-2031	502.642	0,53
400.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	491.511	0,52
370.000	Direct Line Insurance Group Plc FRN (Perpetual) 4.750% 07-Dec-2027	370.292	0,39
419.000	EC Finance Plc 'REGS' 3.000% 15-Oct-2026	447.019	0,48
180.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	182.854	0,19
460.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	540.922	0,58
200.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.206% 17-Aug-2029	174.623	0,19
300.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 3.500% 17-Jul-2031	340.840	0,36
630.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	719.743	0,77
668.000	Newday Funding Master Issuer PLC - Series 2021- 2 6.847% 15-Jul-2029	848.341	0,90
400.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 10.000% 11-Oct-2028	531.044	0,56
430.000	Premier Foods Finance Plc 3.500% 15-Oct-2026	510.341	0,54
274.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 8.250% 06-Nov-2028	376.822	0,40
517.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 'EMTN' 3.875% 14-Sep-2033	607.331	0,65
126.000	SW Finance I Plc 7.375% 12-Dec-2041	171.915	0,18
360.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	378.694	0,40
545.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-CRE1 Plc '2021-CRE1 B' FRN 7.248% 20-Jan-2055	690.918	0,73
521.000	Twin Bridges 2022-2 Plc '2022-2 B' FRN 7.220% 12-Jun-2055	669.874	0,71
1.300.000	United Kingdom Gilt 3.250% 31-Jan-2033	1.620.210	1,72
416.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 7.625% 23-Aug-2029	564.999	0,60
468.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	514.834	0,55
	Vereinigte Staaten von Amerika - 20.186.246		
	(31. Dezember 2022: 28.698.529)	20.186.246	21,44
233.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.375% 15-Aug-2031	210.209	0,22

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
461.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 4.700% 01-Jul-2030	451.646	0,48
622.000	Amgen Inc 5.250% 02-Mar-2033	638.738	0,68
396.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	394.901	0,42
600.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	592.392	0,63
449.000	Arsenal AIC Parent LLC '144A' 8.000% 01-Oct-2030	469.030	0,50
482.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	463.977	0,49
500.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	543.848	0,58
500.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B.V. '144A' 7.250% 15-Feb-2031	526.875	0,56
473.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	425.012	0,45
100.000	Bank of America Corp FRN 5.288% 25-Apr-2034	100.514	0,11
510.000	Capital One Financial Corp FRN 7.624% 30-Oct-2031	559.981	0,59
550.000	Citigroup Inc FRN 3.785% 17-Mar-2033	496.111	0,53
403.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	405.341	0,43
262.000	Columbia Pipelines Operating Co LLC '144A' 6.544% 15-Nov-2053	287.944	0,31
600.000	Comcast Corp 4.800% 15-May-2033	608.704	0,65
470.000	Constellation SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029	479.875	0,51
250.000	CVS Health Corp 5.050% 25-Mar-2048	235.951	0,25
95.000	CVS Health Corp 5.875% 01-Jun-2053	100.795	0,11
78.000	Duke Energy Indiana LLC 5.400% 01-Apr-2053	80.210	0,09
130.000	FedEx Corp 0.950% 04-May-2033	113.908	0,12
350.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350% 04-Nov-2027	368.939	0,39
223.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	264.432	0,28
350.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	430.463	0,46
475.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 3.625% 15-Jan-2032	407.129	0,43
320.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 5.750% 01-Apr-2033	319.187	0,34
52.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 5.750% 01-Apr-2033	51.868	0,05
260.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031	228.015	0,24
720.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 1.928% 28-Apr-2032	580.855	0,62
24.000	Nasdaq Inc 5.950% 15-Aug-2053	26.075	0,03
452.000	Nasdaq Inc 6.100% 28-Jun-2063	493.670	0,52
400.000	Oil European Group BV 'REGS' 6.250% 15-May-2028	463.714	0,49
245.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	252.379	0,27
640.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.340% 19-May-2063	652.966	0,69
450.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 5.939% 18-Aug-2034	469.294	0,50
142.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.037% 28-Oct-2033	148.875	0,16
330.000	Prologis Euro Finance LLC 'EMTN' 4.250% 31-Jan-2043	371.273	0,39
264.000	Realty Income Corp 4.875% 06-Jul-2030	310.257	0,33
186.285	Santander Drive Auto Receivables Trust 2021-3 '2021-3 C' 0.950% 15-Sep-2027	184.806	0,20
400.000	Silgan Holdings Inc 3.250% 15-Mar-2025	441.410	0,47
250.000	Standard Industries Inc/NJ 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	262.357	0,28
117.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.122% 26-Jan-2034	113.705	0,12
453.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 5.867% 08-Jun-2034	463.648	0,49
27.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	28.094	0,03
2.200.000	United States Treasury Note/Bond 3.875% 15-Aug-2033	2.203.781	2,34
279.000	US Bancorp FRN 5.836% 12-Jun-2034	288.366	0,31
144.000	US Bancorp FRN 5.850% 21-Oct-2033	148.841	0,16
100.000	Verizon Communications Inc 4.250% 31-Oct-2030	117.650	0,12
100.000	Verizon Communications Inc 4.272% 15-Jan-2036	94.418	0,10
236.000	Virginia Electric and Power Co 5.000% 01-Apr-2033	239.746	0,25
510.000	Warnermedia Holdings Inc 5.141% 15-Mar-2052	442.162	0,47
300.000	Wells Fargo & Co FRN 5.389% 24-Apr-2034	301.978	0,32
360.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 5.557% 25-Jul-2034	367.819	0,39

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
440.000	Windsor Holdings III LLC '144A' 8.500% 15-Jun-2030	462.112	0,49
Gesamtanlagen in Anleihen		84.331.854	89,56
Total Return Swaps			
	Europa - 311.472 (31. Dezember 2022: -)	311.472	0,33
400.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	717	0,00
14.350.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	310.755	0,33
Vereinigte Staaten von Amerika - 190.667 (31. Dezember 2022: -)			
5.700.000	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index 20-Mar-2024	190.667	0,20
Total Return Swaps insgesamt		502.139	0,53
Credit Default Swaps - 756.979 (31. Dezember 2022: 282.538)			
430.000	CDS Apache Corporation 1.000% 20-Dec-2028	7.184	0,01
360.000	CDS Intesa SanPaolo SpA 1.000% 20-Dec-2028	14.097	0,02
420.000	CDS M.D.C. Holdings Inc 1.000% 20-Dec-2028	2.889	0,00
410.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2028	11.913	0,01
430.000	CDS Unicredit SpA 1.000% 20-Dec-2028	14.534	0,02
(190.000)	CDS UPC Holding BV 5.000% 20-Dec-2028	13.392	0,01
(600.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2028	6.881	0,01
(370.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2028	27.836	0,03
(350.000)	CDS Ziggo Bond Company B.V. 5.000% 20-Dec-2028	17.972	0,02
(702.900)	CDX North American High Yield Index Series 41 Version 2 5.000% 20-Dec-2028	41.505	0,04
(30.360.000)	CDX North American Investment Grade Index Series 41 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	598.776	0,64
Credit Default Swaps insgesamt		756.979	0,81
Währungsoptionen - 3.654 (31. Dezember 2022: -)			
230.000	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 159.350	52	0,00
114.000	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 185.200	-	0,00
(114.000)	Sterling/Yen Call 02-Jan-2024 188.000	-	0,00
220.000	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 149.100	56	0,00
64.595.000	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 141.700	3.546	0,00
Währungsoptionen insgesamt		3.654	0,00
Zinsswaps - 179.392 (31. Dezember 2022: -)			
1.426.000	IRS Receive Fixed 2.800% Pay 1T EUR-EXT-CPI 28-Jul-2053	179.392	0,19
Zinsswaps insgesamt		179.392	0,19
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD mögen %
Offene Terminkontrakte - 6.008 (31. Dezember 2022: 1.211.995)			
(34)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.838.281)	5.252 0,00

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(11)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.263.680)	756	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			6.008	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.534.086 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 149.653)			1.534.086	1,63
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			92.597.916	98,33
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Total Return Swaps				
	Europa - (83.769) (31. Dezember 2022: -)		(83.769)	(0,09)
150.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024		(828)	(0,00)
3.091.000	iBoxx EUR Liquid High Yield Index 20-Mar-2024		(82.941)	(0,09)
Total Return Swaps insgesamt			(83.769)	(0,09)
	Credit Default Swaps - (830.110) (31. Dezember 2022: (135.318))			
770.000	CDS Barrick Gold Corporation 1.000% 20-Dec-2028		(19.428)	(0,02)
150.000	CDS Beazer Homes USA Inc 5.000% 20-Dec-2028		(13.463)	(0,01)
670.000	CDS BorgWarner Inc 1.000% 20-Dec-2028		(9.821)	(0,01)
780.000	CDS British American Tobacco plc 1.000% 20-Dec-2028		(6.917)	(0,01)
480.000	CDS Canadian Natural Resources Limited 1.000% 20-Dec-2028		(8.380)	(0,01)
750.000	CDS Imperial Brands Plc 1.000% 20-Dec-2028		(6.822)	(0,01)
210.000	CDS KB Home 5.000% 20-Dec-2028		(32.666)	(0,04)
(580.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2028		(17.609)	(0,02)
360.000	CDS Lennar Corp 5.000% 20-Dec-2028		(67.626)	(0,07)
430.000	CDS PulteGroup Inc 5.000% 20-Dec-2028		(80.754)	(0,09)
(400.000)	CDS Rolls Royce Plc 1.000% 20-Dec-2028		(3.380)	(0,00)
440.000	CDS Toll Brothers Finance Corp 1.000% 20-Dec-2028		(704)	(0,00)
340.000	CDS Transdigm Inc 5.000% 20-Dec-2028		(49.943)	(0,05)
410.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2028		(72.972)	(0,08)
840.000	CDS Yum! Brands Inc 1.000% 20-Dec-2028		(8.051)	(0,01)
945.000	iTraxx Europe Crossover Index Series 40 Version 1 5.000% 20-Dec-2028		(83.671)	(0,09)
7.825.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(168.395)	(0,18)
9.690.000	iTraxx Europe Senior Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(163.029)	(0,17)
(1.445.000)	iTraxx Europe Sub Financials Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028		(16.479)	(0,02)
Credit Default Swaps insgesamt			(830.110)	(0,89)
	Währungsoptionen - (8.372) (31. Dezember 2022: -)			
(230.000)	Euro/Yen Call 04-Jan-2024 162.000		(1)	(0,00)
(230.000)	Euro/Yen Put 04-Jan-2024 155.650		(465)	(0,00)
(114.000)	Sterling/Yen Put 02-Jan-2024 180.000		(399)	(0,00)
(220.000)	US Dollar/Yen Call 25-Jan-2024 153.000		(6)	(0,00)
(220.000)	US Dollar/Yen Put 25-Jan-2024 143.900		(5.358)	(0,01)
(64.595.000)	Yen/US Dollar Call 16-Jan-2024 138.790		(1.729)	(0,00)
(64.595.000)	Yen/US Dollar Put 16-Jan-2024 145.500		(414)	(0,00)
Währungsoptionen insgesamt			(8.372)	(0,01)
	Zinsswaps - (50.944) (31. Dezember 2022: -)			
2.130.000	IRS RPI 28-Jul-2053		(50.944)	(0,05)
Zinsswaps insgesamt			(50.944)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (764.360)				
(31. Dezember 2022: (51.598))				
(78)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(10.308.456)	(110.454)	(0,12)
(67)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(10.197.265)	(181.013)	(0,19)
(7)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(1.100.123)	(74.810)	(0,08)
(166)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(19.593.142)	(45.629)	(0,05)
(22)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(2.391.125)	(50.040)	(0,05)
(26)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.487.250)	(302.414)	(0,32)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(764.360)	(0,81)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.490.085) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (2.304.824))			(1.490.085)	(1,58)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(3.227.640)	(3,43)
Nettoumlaufvermögen			4.789.244	5,10
Summe Nettovermögen			94.159.520	100,00
The counterparties for credit default swaps are Barclays Bank Plc, BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, JPMorgan Chase, Merrill Lynch and Morgan Stanley. Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Goldman Sachs und HSBC Bank plc. Die Kontrahenten für Zinsswaps sind Goldman Sachs und Morgan Stanley. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist JPMorgan Securities Plc. Die Kontrahenten für Total Return Swaps sind Goldman Sachs und Morgan Stanley.				
Portfolioanalyse			% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				90,66
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				0,01
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				3,01
Sonstiges Umlaufvermögen				6,32
Gesamtvermögen			100,00	

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	135.000	99.430	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	2.445
Kanadischer Dollar	US-Dollar	161.000	120.751	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	744
Kanadischer Dollar	US-Dollar	77.000	56.791	19. Jan. 24	Barclays Bank PLC	1.315
Tschechische Krone	US-Dollar	137.000	6.079	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	57
Euro	Pfund Sterling	165.880	143.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.609
Euro	US-Dollar	221.000	238.703	19. Jan. 24	Morgan Stanley	6.278
Euro	US-Dollar	453.000	488.435	19. Jan. 24	Morgan Stanley	13.722
Euro	US-Dollar	882.000	963.633	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	14.077
Ungarischer Forint	US-Dollar	278.000	786	19. Jan. 24	BNP Paribas	17
Japanischer Yen	US-Dollar	258.417.000	1.766.840	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	63.951
Mexikanischer Peso	US-Dollar	10.361.000	603.600	19. Jan. 24	Morgan Stanley	6.006
Mexikanischer Peso	US-Dollar	436.000	24.953	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	700
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	27.365.000	1.470.318	19. Jan. 24	Morgan Stanley	9.860
Pfund Sterling	Euro	143.000	164.265	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	181
Pfund Sterling	Euro	70.000	80.410	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	89
Pfund Sterling	US-Dollar	32.000	40.504	19. Jan. 24	Morgan Stanley	284
Pfund Sterling	US-Dollar	54.500	68.289	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	1.178
Pfund Sterling	US-Dollar	10.000	12.672	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	74
US-Dollar	Euro	27.813	25.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	101
US-Dollar	Pfund Sterling	94.333	74.000	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	10
USD						122.698
Euro	Australischer Dollar	126.830	208.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(943)
US-Dollar	Australischer Dollar	127.674	190.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(1.614)
US-Dollar	Australischer Dollar	68.251	104.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(2.518)
US-Dollar	Australischer Dollar	5.483.560	8.325.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(181.287)
US-Dollar	Euro	369.487	336.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(2.974)
US-Dollar	Euro	13.902.152	12.852.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(344.477)
US-Dollar	Euro	13.901.314	12.852.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(345.315)
US-Dollar	Euro	295.131	274.000	19. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(8.602)
US-Dollar	Euro	103.689	96.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(2.728)
US-Dollar	Euro	5.249.399	4.803.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(74.796)
US-Dollar	Euro	262.088	240.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(3.956)
US-Dollar	Euro	129.207	118.000	19. Jan. 24	HSBC Bank plc	(1.598)
US-Dollar	Euro	186.614	170.000	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	(1.834)
US-Dollar	Euro	146.435	133.000	19. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(997)
US-Dollar	Euro	13.903.599	12.852.000	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	(343.030)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	34.838	610.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(1.052)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	577.843	10.039.000	19. Jan. 24	RBC Europe Limited	(12.817)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.416.350	26.879.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(37.541)
US-Dollar	Pfund Sterling	141.864	113.000	19. Jan. 24	BNP Paribas	(2.170)
US-Dollar	Pfund Sterling	130.413	104.000	19. Jan. 24	Lloyds Bank plc	(2.148)
US-Dollar	Pfund Sterling	168.518	133.000	19. Jan. 24	Royal Bank of Scotland	(1.008)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.151.367	7.259.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(101.172)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.630.005	1.286.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(8.169)
US-Dollar	Schwedische Krone	477	5.000	19. Jan. 24	Morgan Stanley	(23)
US-Dollar	Schweizer Franken	128.778	112.000	19. Jan. 24	Goldman Sachs International	(5.374)
USD						(1.489.143)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	461.466	587.983	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	190
Pfund Sterling	US-Dollar	424.360	539.465	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.415
Pfund Sterling	US-Dollar	72.604.945	91.130.793	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.409.783
USD						1.411.388
GBP						1.107.405

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	394.615	503.909	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(942)
USD						(942)
GBP						(739)

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Bermudas - 7.548.826			
(31. Dezember 2022: 4.948.994)		7.548.826	1,81
3.042	Everest Re Group Ltd	1.075.606	0,26
33.014	RenaissanceRe Holdings Ltd	6.473.220	1,55
Frankreich - 8.517.185			
(31. Dezember 2022: 12.310.360)		8.517.185	2,04
171.303	Sanofi ADR	8.517.185	2,04
Irland - 30.863.587			
(31. Dezember 2022: 9.195.800)		30.863.587	7,41
192.476	CRH Plc	13.307.791	3,20
213.017	Medtronic Plc	17.555.796	4,21
Vereinigtes Königreich - 12.316.595			
(31. Dezember 2022: 5.214.059)		12.316.595	2,96
95.984	Shell Plc ADR	6.315.267	1,52
24.877	Willis Towers Watson Plc	6.001.328	1,44
Vereinigte Staaten von Amerika - 342.997.688			
(31. Dezember 2022: 285.601.828)		342.997.688	82,33
104.586	AbbVie Inc	16.211.353	3,89
61.520	Allstate Corp/The	8.615.876	2,07
134.221	American International Group Inc	9.092.802	2,18
35.151	Applied Materials Inc	5.697.098	1,37
50.113	Assurant Inc	8.444.542	2,03
795.424	AT&T Inc	13.367.100	3,21
155.335	Bank of America Corp	5.230.129	1,26
51.543	Becton Dickinson & Co	12.570.822	3,02
37.346	Bunge Global SA	3.769.705	0,90
52.918	CF Industries Holdings Inc	4.207.246	1,01
195.797	Cisco Systems Inc	9.892.643	2,37
47.734	CME Group Inc	10.055.406	2,41
84.889	Comcast Corp	3.724.505	0,89
62.161	ConocoPhillips	7.214.716	1,73
44.353	Constellation Energy Corp	5.184.866	1,24
37.260	Danaher Corp	8.622.896	2,07
28.900	Diamondback Energy Inc	4.482.535	1,08
88.576	Dominion Energy Inc	4.163.072	1,00
17.314	Eaton Corp Plc	4.172.241	1,00
107.555	EQT Corp	4.158.614	1,00
61.418	Exxon Mobil Corp	6.140.879	1,47
30.272	FedEx Corp	7.658.665	1,84
135.492	First Horizon Corp	1.919.244	0,46
167.389	Freeport-McMoRan Inc	7.121.565	1,71
88.725	General Motors Co	3.186.558	0,76
24.289	Goldman Sachs Group Inc/The	9.370.210	2,25
197.188	Intel Corp	9.909.683	2,38
34.252	International Business Machines Corp	5.603.113	1,35
392.757	International Game Technology Plc	10.763.506	2,58
193.445	Interpublic Group of Cos Inc/The	6.313.078	1,52
108.227	JPMorgan Chase & Co	18.426.188	4,42
546.145	Kenvue Inc	11.755.771	2,82
35.171	L3Harris Technologies Inc	7.409.650	1,78
150.395	Las Vegas Sands Corp	7.400.186	1,78
19.658	Marathon Petroleum Corp	2.915.969	0,70
44.079	Mondelez International Inc	3.192.862	0,77
79.043	Morgan Stanley	7.373.526	1,77
174.057	Newmont Corp	7.203.349	1,73
23.072	Northrop Grumman Corp	10.810.732	2,59
111.134	Occidental Petroleum Corp	6.635.255	1,59
72.724	Omnicom Group Inc	6.292.444	1,51
31.533	Phillips 66	4.197.831	1,01
19.861	Progressive Corp/The	3.164.950	0,76
84.229	Truist Financial Corp	3.110.577	0,75
18.470	UnitedHealth Group Inc	9.728.888	2,34
239.637	US Bancorp	10.372.688	2,49

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
84.191	Voya Financial Inc	6.142.154	1,47
Gesamtanlagen in Aktien		402.243.881	96,55
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 433.056 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 12.209)		433.056	0,10
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		402.676.937	96,65
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (7.227) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (326.608))		(7.227)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(7.227)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		13.966.646	3,35
Summe Nettovermögen		416.636.356	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,30	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,10	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,60	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	10.014	10.992	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	67
Euro	US-Dollar	6.251	6.835	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	69
Euro	US-Dollar	13.741	15.123	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	53
Euro	US-Dollar	8.822	9.517	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	226
Euro	US-Dollar	1.056.872	1.137.021	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	30.216
USD						30.631
EUR						27.747
Euro	US-Dollar	8.163	9.068	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(52)
Euro	US-Dollar	8.378	9.254	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	18.453	16.774	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Euro	81.710	74.359	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(414)
US-Dollar	Euro	80.604	73.745	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(842)
US-Dollar	Euro	6.447	5.893	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(62)
US-Dollar	Euro	27.467	25.213	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(379)
USD						(1.823)
EUR						(1.651)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	106	117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	117	128	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	68	75	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	146	161	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	95	102	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	11.205	12.055	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	320
USD						325
EUR						294
Euro	US-Dollar	105	117	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	232	211	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	70	64	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(3)
EUR						(3)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	78.521	99.982	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	111
Pfund Sterling	US-Dollar	87.155	110.516	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	583
Pfund Sterling	US-Dollar	35.405	44.783	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	349
Pfund Sterling	US-Dollar	51.306	65.245	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	156
Pfund Sterling	US-Dollar	34.190	42.986	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	597
Pfund Sterling	US-Dollar	68.698	86.077	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.495
Pfund Sterling	US-Dollar	8.218.702	10.319.832	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	156.769

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	5.531	6.943	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	108
USD						160.168
GBP						125.656
Pfund Sterling	US-Dollar	80.312	102.592	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(216)
Pfund Sterling	US-Dollar	109.797	140.009	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(48)
US-Dollar	Pfund Sterling	197.494	155.885	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.217)
US-Dollar	Pfund Sterling	59.043	46.611	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(372)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.559	2.037	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(38)
USD						(1.891)
GBP						(1.484)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	17.428	22.140	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	75
Pfund Sterling	US-Dollar	1.462	1.861	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Pfund Sterling	US-Dollar	513	644	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Pfund Sterling	US-Dollar	15.805	20.079	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	68
Pfund Sterling	US-Dollar	9.820	12.477	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	41
Pfund Sterling	US-Dollar	117.562	149.693	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	166
Pfund Sterling	US-Dollar	7.501	9.517	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	44
Pfund Sterling	US-Dollar	444	560	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5
Pfund Sterling	US-Dollar	130.429	165.388	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	873
Pfund Sterling	US-Dollar	71	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	77.387	98.413	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	235
Pfund Sterling	US-Dollar	19.560	24.707	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	227
Pfund Sterling	US-Dollar	37.854	47.548	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	706
Pfund Sterling	US-Dollar	103.547	129.742	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.253
Pfund Sterling	US-Dollar	12.432.843	15.611.329	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	237.152
US-Dollar	Pfund Sterling	34.887	27.310	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	74
USD						241.932
GBP						189.803
US-Dollar	Pfund Sterling	20.078	15.805	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(68)
Pfund Sterling	US-Dollar	119.809	153.045	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(322)
Pfund Sterling	US-Dollar	165.443	210.968	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Pfund Sterling	562	448	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.904	3.108	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(58)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.862	1.462	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	19.121	15.208	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(265)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.307	1.827	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Pfund Sterling	89.115	70.350	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(562)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.935	1.526	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.935	1.521	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Pfund Sterling	14.762	11.690	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(139)
US-Dollar	Pfund Sterling	296.347	233.912	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.827)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	3.001	2.365	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.041	3.968	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.141	17.428	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(75)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.601	4.428	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(44)
USD						(3.510)
GBP						(2.754)

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen			
Fördermittel - 34.435.604			
(31. Dezember 2022: 40.106.405)			
7.240.000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031	6.457.501	0,80
5.000.000	Michigan State Building Authority 2.705% 15-Oct-2040	3.815.350	0,47
2.500.000	New Hampshire Business Finance Authority 5.250% 01-Jun-2051	2.772.887	0,35
2.110.000	New Jersey Economic Development Authority 3.620% 15-Jun-2028	2.041.077	0,25
1.000.000	New Jersey Economic Development Authority 4.927% 01-Mar-2026	1.001.835	0,12
1.500.000	New Jersey Economic Development Authority 4.934% 01-Mar-2025	1.495.875	0,19
2.000.000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 6.000% 30-Jun-2061	2.222.580	0,28
8.500.000	State Public School Building Authority 5.426% 15-Sep-2026	8.653.680	1,08
6.480.000	Tennessee State School Bond Authority 1.515% 15-Sep-2026	5.974.819	0,74
Anleihebank - 6.481.380			
(31. Dezember 2022: 21.230.984)			
1.955.000	Iowa Finance Authority 5.000% 01-Dec-2050	2.047.980	0,26
4.500.000	Michigan Finance Authority 2.988% 01-Sep-2049	4.433.400	0,55
Dedicated Tax - 92.344.240			
(31. Dezember 2022: 141.392.306)			
1.330.000	Brentwood Infrastructure Financing Authority 3.478% 02-Sep-2025	1.297.508	0,16
6.750.000	California Community Choice Financing Authority 4.000% 01-Feb-2052	6.800.153	0,84
4.000.000	California Community Choice Financing Authority 5.250% 01-Jan-2054	4.233.689	0,53
2.740.000	District of Columbia Income Tax Revenue 4.996% 01-Dec-2026	2.790.279	0,35
1.000.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.021% 01-Dec-2029	953.110	0,12
1.250.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.121% 01-Dec-2030	1.185.225	0,15
1.840.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.171% 01-Dec-2031	1.729.904	0,21
750.000	Maryland Economic Development Corp 4.580% 01-Jun-2033	686.632	0,08
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 4.790% 01-Jun-2038	865.275	0,11
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 5.050% 01-Jun-2043	838.975	0,10
5.040.000	Maryland Economic Development Corp 5.250% 30-Jun-2055	5.195.081	0,65
1.000.000	Metropolitan Transportation Authority 5.989% 15-Nov-2030	1.065.165	0,13
2.000.000	Nassau County Interim Finance Authority 1.459% 15-Nov-2029	1.701.370	0,21
1.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.080% 01-Feb-2026	971.975	0,12
5.000.000	New York State Urban Development Corp 2.970% 15-Mar-2034	4.278.000	0,53
3.510.000	New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046	3.536.641	0,44
2.685.000	Pomona Redevelopment Agency Successor Agency 4.506% 01-Feb-2041	2.497.345	0,31
9.700.000	Public Finance Authority 6.145% 01-Aug-2028	9.636.465	1,20
1.365.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.000% 01-Oct-2025	1.319.771	0,16
1.445.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.125% 01-Oct-2026	1.384.281	0,17
1.500.000	Riverside County Transportation Commission 4.000% 01-Jun-2038	1.535.693	0,19
2.000.000	Sales Tax Securitization Corp 2.225% 01-Jan-2024	2.000.000	0,25
5.500.000	Sales Tax Securitization Corp 4.631% 01-Jan-2028	5.514.547	0,69
5.000.000	Sales Tax Securitization Corp 4.736% 01-Jan-2030	5.019.450	0,62
3.500.000	Sales Tax Securitization Corp 4.787% 01-Jan-2048	3.321.587	0,41
4.900.000	San Diego County Regional Transportation Commission 2.063% 01-Apr-2032	4.079.495	0,51
2.450.000	San Diego Redevelopment Agency Successor Agency 3.750% 01-Sep-2031	2.285.348	0,28

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Dedicated Tax Forts.			
1.000.000	San Francisco City & County Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029	936.540	0,12
3.750.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029	3.512.025	0,44
1.000.000	State of Connecticut Special Tax Revenue 5.459% 01-Nov-2030	1.025.400	0,13
5.000.000	State of Illinois Sales Tax Revenue 3.750% 15-Jun-2032	4.548.725	0,57
5.675.000	Village Center Community Development District 4.756% 01-Nov-2029	5.598.586	0,70
Bildung - 118.361.068			
(31. Dezember 2022: 102.472.333)			
1.370.000	California Educational Facilities Authority 3.414% 01-Apr-2031	1.264.901	0,16
1.635.000	California Educational Facilities Authority 3.431% 01-Apr-2030	1.493.090	0,19
11.750.000	California State University 5.183% 01-Nov-2053	11.933.946	1,48
1.000.000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 4.000% 01-Jul-2055	971.310	0,12
2.500.000	Delaware County Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.546.938	0,32
2.500.000	Florida Higher Educational Facilities Financial Authority 5.000% 01-Mar-2037	2.565.625	0,32
3.000.000	Harris County Cultural Education Facilities Finance Corp 3.344% 15-Nov-2037	2.481.660	0,31
8.500.000	Illinois Finance Authority 4.000% 01-Apr-2050	8.189.070	1,02
1.000.000	Illinois Finance Authority 5.450% 01-Aug-2038	925.910	0,11
2.000.000	Iowa Student Loan Liquidity Corp 4.349% 01-Dec-2027	1.978.920	0,25
1.400.000	Iowa Student Loan Liquidity Corp 5.080% 01-Dec-2039	1.361.619	0,17
1.000.000	Kent State University 2.797% 01-May-2032	868.685	0,11
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.860% 01-Jun-2025	988.415	0,12
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.942% 01-Jun-2026	986.630	0,12
3.350.000	Massachusetts Educational Financing Authority 2.305% 01-Jul-2029	2.939.407	0,36
2.730.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3.455% 01-Jul-2028	2.591.289	0,32
2.110.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3.505% 01-Jul-2029	1.972.164	0,24
4.000.000	Massachusetts Educational Financing Authority 4.429% 01-Jul-2029	3.914.980	0,49
4.700.000	Massachusetts Educational Financing Authority 4.595% 01-Jul-2031	4.552.420	0,57
1.250.000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 4.400% 01-Oct-2034	1.100.431	0,14
5.000.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3.613% 01-Jul-2050	3.745.350	0,47
5.500.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3.736% 01-Sep-2030	5.136.945	0,64
2.385.000	New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Feb-2038	2.492.432	0,31
10.000.000	New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Mar-2044	10.068.200	1,25
3.370.000	New York State Dormitory Authority 4.850% 01-Jul-2048	3.231.931	0,40
775.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2037	794.747	0,10
1.250.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2039	1.263.175	0,16
6.000.000	Pennsylvania State University/The 2.790% 01-Sep-2043	4.538.670	0,56
2.000.000	Red River Education Finance Corp 2.802% 15-Mar-2033	1.717.090	0,21
1.775.000	Red River Education Finance Corp 2.892% 15-Mar-2034	1.507.605	0,19
5.405.000	University of California 1.614% 15-May-2030	4.574.522	0,57
10.000.000	University of California 1.997% 15-May-2031	8.454.100	1,05
1.100.000	University of California 3.063% 01-Jul-2025	1.073.699	0,13
5.500.000	University of California 3.349% 01-Jul-2029	5.234.900	0,65
5.000.000	University of Michigan 3.504% 01-Apr-2052	4.133.975	0,51
1.000.000	University of Oklahoma/The 3.466% 01-Jul-2028	963.750	0,12
2.515.000	University of Pittsburgh-of the Commonwealth System of Higher Education 3.646% 15-Sep-2036	2.244.990	0,28

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Bildung Forts.		
2.500.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	1.557.577	0,19
	Gesundheitswesen - 77.795.508		
	(31. Dezember 2022: 89.796.439)	77.795.508	9,67
2.750.000	Adventist Health System/West 2.433% 01-Sep-2024	2.688.303	0,34
4.500.000	Adventist Health System/West 2.952% 01-Mar-2029	4.074.769	0,51
1.500.000	Advocate Health & Hospitals Corp 3.829% 15-Aug-2028	1.460.441	0,18
7.600.000	Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039	5.971.582	0,74
5.000.000	Baylor Scott & White Holdings 1.777% 15-Nov-2030	4.169.366	0,52
4.000.000	Bon Secours Mercy Health Inc 4.302% 01-Jul-2028	3.951.414	0,49
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 1.979% 01-Jun-2030	4.289.250	0,53
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031	4.449.050	0,55
5.000.000	City of Chillicothe OH 5.000% 01-Dec-2047	5.071.350	0,63
2.270.000	Development Authority for Fulton County 5.000% 01-Apr-2047	2.323.379	0,29
3.000.000	Geisinger Authority 5.000% 01-Apr-2043	3.132.594	0,39
2.000.000	Illinois Finance Authority 5.000% 15-Nov-2045	2.027.540	0,25
4.740.000	Massachusetts Development Finance Agency 4.740% 01-Jul-2038	4.381.941	0,55
2.000.000	Monroe County Hospital Authority/PA 5.000% 01-Jul-2041	2.031.930	0,25
1.185.000	Montana Facility Finance Authority 4.368% 15-Aug-2038	1.095.479	0,14
2.500.000	Montefiore Obligated Group 4.287% 01-Sep-2050	1.547.753	0,19
915.000	New Hampshire Health and Education Facilities Authority Act 5.000% 01-Jul-2044	895.282	0,11
2.500.000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 4.000% 01-Jul-2051	2.456.550	0,31
5.925.000	Oklahoma Development Finance Authority 5.450% 15-Aug-2028	5.324.412	0,66
2.000.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.532% 01-Oct-2029	1.753.751	0,22
6.360.000	SSM Health Care Corp 3.823% 01-Jun-2027	6.185.192	0,77
5.000.000	Sutter Health 2.294% 15-Aug-2030	4.294.239	0,53
3.000.000	Trinity Health Corp 2.632% 01-Dec-2040	2.181.871	0,27
2.000.000	Washington Health Care Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.038.070	0,25
	Wohnungsbau - 20.138.264		
	(31. Dezember 2022: 19.121.632)	20.138.264	2,50
1.063.548	Arizona Industrial Development Authority '2019-2 A' FRN 3.625% 20-May-2033	1.007.451	0,13
1.400.000	California Statewide Communities Development Authority 1.877% 01-Feb-2031	1.174.929	0,15
1.000.000	California Statewide Communities Development Authority 2.177% 01-Feb-2033	816.045	0,10
8.500.000	California Statewide Communities Development Authority 7.140% 15-Aug-2047	9.275.072	1,15
4.000.000	Chicago Housing Authority 4.322% 01-Jan-2033	3.711.200	0,46
3.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.016% 15-Apr-2027	3.009.273	0,37
1.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.216% 15-Apr-2028	1.144.294	0,14
	Wohnungsbaufinanzierung - 1.942.920		
	(31. Dezember 2022: 4.554.454)	1.942.920	0,24
2.000.000	Minnesota Housing Finance Agency 4.337% 01-Jan-2047	1.942.920	0,24
	Leasing - 6.583.393		
	(31. Dezember 2022: 9.270.078)	6.583.393	0,82
5.000.000	Commonwealth Financing Authority 4.014% 01-Jun-2033	4.702.775	0,59
1.840.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15-Dec-2028	1.880.618	0,23
	Kommunalverwaltung - 174.557.027		
	(31. Dezember 2022: 103.358.605)	174.557.027	21,70
8.490.000	Battery Park City Authority 4.800% 01-Nov-2028	8.701.444	1,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Kommunalverwaltung Forts.		
9.530.000	Chicago Park District 2.925% 01-Jan-2038	7.426.824	0,92
3.645.000	City & County of San Francisco CA 4.750% 15-Jun-2040	3.445.655	0,43
2.615.000	City of Glendale AZ 2.062% 01-Jul-2029	2.305.972	0,29
3.000.000	City of New Haven CT 4.834% 01-Aug-2033	2.947.965	0,37
2.380.000	City of New York NY 3.450% 01-Dec-2027	2.299.021	0,29
1.665.000	City of New York NY 3.750% 01-Jun-2028	1.621.310	0,20
1.000.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2038	1.044.900	0,13
2.225.000	City of New York NY 5.517% 01-Oct-2037	2.313.833	0,29
2.500.000	City of Philadelphia PA 2.864% 15-Jul-2031	2.208.988	0,27
6.500.000	Clackamas County School District No 12 North Clackamas 0.000% 15-Jun-2039	3.280.810	0,41
12.235.000	Commonwealth of Massachusetts 3.680% 15-Jul-2026	12.031.532	1,50
2.260.152	Commonwealth of Massachusetts 4.110% 15-Jul-2031	2.242.907	0,28
5.450.000	Contra Costa Community College District 2.926% 01-Aug-2038	4.458.536	0,55
2.350.000	County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033	2.641.471	0,33
6.325.000	County of Cook IL 5.790% 15-Nov-2029	6.411.747	0,80
10.120.000	County of Franklin OH 3.382% 01-Nov-2050	7.772.261	0,97
5.000.000	County of Miami-Dade Seaport Department 6.224% 01-Nov-2055	5.309.100	0,66
5.125.000	County of New Castle DE 1.810% 15-Jul-2030	4.410.165	0,55
2.500.000	County of Tulare CA 3.859% 01-Jun-2026	2.434.150	0,30
10.400.000	Detroit City School District 6.645% 01-May-2029	11.310.832	1,41
3.000.000	El Paso Independent School District 1.872% 15-Aug-2031	2.523.165	0,31
5.000.000	Los Angeles Community College District/CA 1.606% 01-Aug-2028	4.488.225	0,56
5.000.000	Los Angeles Community College District/CA 5.500% 01-Aug-2024	5.005.950	0,62
2.110.000	Massachusetts Development Finance Agency 4.000% 01-Oct-2046	2.138.897	0,27
5.000.000	Massachusetts Educational Financing Authority 5.950% 01-Jul-2044	5.137.125	0,64
10.000.000	Massachusetts School Building Authority 2.436% 15-Oct-2027	9.352.150	1,16
15.525.000	Metropolitan Transportation Authority 5.175% 15-Nov-2049	15.199.130	1,89
7.225.000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 3.720% 01-Sep-2026	6.981.626	0,87
6.145.000	Palomar Community College District 1.986% 01-Aug-2030	5.314.288	0,66
6.630.000	San Juan Unified School District 1.666% 01-Aug-2028	5.899.639	0,73
1.750.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	1.780.371	0,22
5.435.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	5.577.859	0,69
800.000	Southwestern Community College District 2.294% 01-Aug-2032	669.732	0,08
1.000.000	Southwestern Community College District 2.394% 01-Aug-2033	826.325	0,10
1.000.000	Southwestern Community College District 2.494% 01-Aug-2034	815.835	0,10
4.075.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 3.922% 31-Dec-2049	3.312.832	0,41
3.000.000	Town of Hamden CT 3.881% 15-Aug-2026	2.914.455	0,36
	Energie - 6.935.112		
	(31. Dezember 2022: 56.898.781)	6.935.112	0,86
1.500.000	American Municipal Power Inc 6.973% 15-Feb-2024	1.502.392	0,19
1.100.000	American Municipal Power Inc 7.334% 15-Feb-2028	1.168.689	0,14
1.500.000	City of Lubbock TX Electric Light & Power System Revenue 4.000% 15-Apr-2034	1.572.788	0,20
2.685.000	San Francisco City & County Public Utilities Commission Power Revenue 4.000% 01-Nov-2051	2.691.243	0,33
	Pre-Refunded - 4.760.514		
	(31. Dezember 2022: 7.947.120)	4.760.514	0,59
5.485.000	City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029	4.760.514	0,59

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Renten - 5.766.889		
	(31. Dezember 2022: 7.660.574)	5.766.889	0,72
255.000	Berks County Industrial Development Authority 3.950% 15-May-2024	253.234	0,03
2.260.000	Colorado Health Facilities Authority 5.000% 01-Dec-2043	2.298.307	0,29
1.000.000	Montgomery County Industrial Development Authority/PA 5.000% 15-Nov-2036	1.026.510	0,13
2.500.000	St Louis County Industrial Development Authority 5.000% 01-Sep-2048	2.188.838	0,27
Regierung Bundesstaaten - 13.865.445			
	(31. Dezember 2022: 9.981.737)	13.865.445	1,72
2.000.000	State of California 4.500% 01-Apr-2033	1.971.900	0,24
6.000.000	State of Connecticut 2.420% 01-Jul-2027	5.641.320	0,70
7.500.000	State of New York 3.170% 15-Feb-2038	6.252.225	0,78
Telekommunikation - 1.168.335			
	(31. Dezember 2022: 1.118.690)	1.168.335	0,14
1.000.000	Utah Telecommunication Open Infrastructure Agency 5.250% 01-Jun-2037	1.168.335	0,14
Transport - 177.225.138			
	(31. Dezember 2022: 192.147.488)	177.225.138	22,03
2.000.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.174% 01-Jan-2029	1.772.620	0,22
2.250.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.274% 01-Jan-2030	1.953.664	0,24
2.750.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.354% 01-Jan-2031	2.339.136	0,29
4.000.000	Central Texas Turnpike System 3.029% 15-Aug-2041	3.010.980	0,37
1.250.000	Chicago Midway International Airport 3.655% 01-Jan-2025	1.229.887	0,15
1.500.000	Chicago Midway International Airport 3.697% 01-Jan-2026	1.464.405	0,18
1.200.000	Chicago Midway International Airport 3.747% 01-Jan-2027	1.165.008	0,14
900.000	Chicago Midway International Airport 3.797% 01-Jan-2028	870.493	0,11
5.000.000	Chicago O'Hare International Airport 4.472% 01-Jan-2049	4.761.175	0,59
5.850.000	Chicago O'Hare International Airport 5.000% 01-Jan-2033	5.900.807	0,73
8.250.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028	7.379.130	0,92
1.500.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 5.000% 01-Dec-2036	1.728.472	0,21
2.000.000	City of Atlanta GA Department of Aviation 5.000% 01-Jul-2028	2.164.930	0,27
2.150.000	City of Houston TX Airport System Revenue 1.716% 01-Jul-2026	2.009.412	0,25
5.000.000	City of Houston TX Airport System Revenue 4.000% 01-Jul-2047	4.837.300	0,60
4.000.000	City of Houston TX Airport System Revenue 4.250% 01-Jul-2053	4.070.640	0,51
1.500.000	City of Phoenix Civic Improvement Corp 5.000% 01-Jul-2029	1.650.825	0,21
4.075.000	Colorado Bridge Enterprise 2.543% 31-Dec-2032	3.602.972	0,45
2.000.000	Colorado High Performance Transportation Enterprise 5.000% 31-Dec-2047	2.005.370	0,25
1.000.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 01-Oct-2029	937.065	0,12
4.400.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.505% 01-Oct-2025	4.298.734	0,53
3.000.000	Dallas Area Rapid Transit 2.078% 01-Dec-2031	2.515.575	0,31
2.500.000	Dallas Fort Worth International Airport 4.000% 01-Nov-2034	2.656.113	0,33
1.500.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 2.962% 15-Jan-2046	1.084.470	0,13
3.000.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2039	3.526.251	0,44
1.260.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2040	1.401.284	0,17
2.500.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045	2.738.650	0,34
1.750.000	Maryland Economic Development Corp 4.750% 01-Jun-2042	1.447.443	0,18

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
	Transport Forts.		
5.000.000	Massachusetts Port Authority 1.879% 01-Jul-2033	3.936.725	0,49
3.350.000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.411% 01-Jul-2033	2.782.125	0,35
2.000.000	Metropolitan Nashville Airport Authority/The 5.000% 01-Jul-2049	2.073.220	0,26
5.000.000	Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044	5.256.225	0,65
3.500.000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4.000% 01-Oct-2049	3.312.855	0,41
5.000.000	New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028	4.454.475	0,55
5.150.000	New Jersey Turnpike Authority 1.813% 01-Jan-2030	4.405.259	0,55
1.000.000	New Jersey Turnpike Authority 7.414% 01-Jan-2040	1.248.350	0,16
3.000.000	New York State Thruway Authority 2.900% 01-Jan-2035	2.615.655	0,33
5.000.000	New York State Thruway Authority 4.000% 01-Jan-2045	5.001.575	0,62
5.000.000	New York Transportation Development Corp 3.573% 01-Jul-2029	4.736.875	0,59
7.500.000	New York Transportation Development Corp 4.375% 01-Oct-2045	7.160.025	0,89
2.000.000	New York Transportation Development Corp 5.000% 01-Dec-2040	2.138.120	0,27
2.500.000	New York Transportation Development Corp 5.000% 01-Jul-2046	2.497.875	0,31
10.000.000	New York Transportation Development Corp 6.971% 30-Jun-2051	10.021.250	1,25
1.000.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 1.882% 01-Mar-2028	899.765	0,11
1.150.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.210% 01-Mar-2029	1.025.921	0,13
1.375.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.310% 01-Mar-2030	1.204.782	0,15
3.260.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216% 15-Feb-2048	2.459.719	0,31
4.500.000	Pennsylvania Turnpike Commission 2.890% 01-Dec-2035	3.760.965	0,47
8.245.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.043% 01-Dec-2033	7.178.757	0,89
3.350.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.416% 01-Dec-2041	2.722.897	0,34
1.500.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.823% 01-Jun-2045	1.391.677	0,17
3.000.000	Port Authority of New York & New Jersey 5.000% 15-Jan-2052	3.168.330	0,39
1.295.000	Port Authority of New York & New Jersey 5.310% 01-Aug-2046	1.271.599	0,16
500.000	Port of Oakland 2.099% 01-May-2030	432.635	0,05
2.975.000	San Francisco Municipal Transportation Agency 1.537% 01-Mar-2029	2.564.182	0,32
7.500.000	San Joaquin Hills Transportation Corridor Agency 3.492% 15-Jan-2050	5.767.612	0,72
1.250.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.174% 01-Jul-2026	1.195.481	0,15
750.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.431% 01-Jul-2028	702.300	0,09
2.290.000	State of Ohio 5.000% 31-Dec-2039	2.302.721	0,29
3.000.000	Virginia Small Business Financing Authority 5.000% 31-Dec-2052	3.012.375	0,37
Wasser - 39.818.938			
	(31. Dezember 2022: 36.891.911)	39.818.938	4,95
750.000	City of Chicago IL Wastewater Transmission Revenue 5.000% 01-Jan-2039	750.428	0,09
1.500.000	City of Cincinnati OH Water System Revenue 2.726% 01-Dec-2046	1.101.832	0,14
3.135.000	City of Dallas TX Waterworks & Sewer System Revenue 3.648% 01-Oct-2030	3.006.528	0,37
4.300.000	City of New Orleans LA Water System Revenue 2.889% 01-Dec-2041	3.148.417	0,39
2.905.000	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 2.825% 01-Nov-2041	2.255.979	0,28
3.690.000	County of Fairfax VA Sewer Revenue 3.000% 15-Jul-2037	3.575.186	0,45
5.000.000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 2.911% 01-Oct-2032	4.396.725	0,55

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Wasser Forts.			
3.000.000	Florida Water Pollution Control Financing Corp 2.550% 15-Jan-2029	2.764.185	0,34
3.000.000	Irvine Ranch Water District Water Service Corp 6.622% 01-May-2040	3.433.020	0,43
5.000.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 2.534% 01-Dec-2032	4.218.750	0,52
1.810.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 5.720% 01-Dec-2038	1.934.410	0,24
2.250.000	Ohio Water Development Authority 4.817% 01-Dec-2030	2.281.320	0,28
2.870.000	Rancho Water District Financing Authority 2.700% 01-Aug-2046	1.983.887	0,25
330.000	State of California Department of Water Resources 3.127% 01-Dec-2029	307.930	0,04
5.860.000	Water Works Board of the City of Birmingham/The 2.388% 01-Jan-2035	4.660.341	0,58
Gesamtanlagen in Anleihen		782.179.775	97,22
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 16.790.816 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 4.916.513)		16.790.816	2,08
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		798.970.591	99,30
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (102.853) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (104.789))		(102.853)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(102.853)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		5.652.167	0,71
Summe Nettovermögen		804.519.905	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,56	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		2,07	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,37	
Gesamtvermögen		100,00	

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	14.110	16.305	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	490
Schweizer Franken	US-Dollar	18.530	21.455	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	602
Schweizer Franken	US-Dollar	1.862.323	2.124.683	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	92.059
USD						93.151
CHF						78.345
Schweizer Franken	US-Dollar	14.705	17.625	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(122)
US-Dollar	Schweizer Franken	60.385	52.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.646)
USD						(2.768)
CHF						(2.328)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	638	737	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22
Schweizer Franken	US-Dollar	833	964	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	27
Schweizer Franken	US-Dollar	82.036	93.593	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.055
USD						4.104
CHF						3.452
Schweizer Franken	US-Dollar	646	775	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5)
USD						(5)
CHF						(4)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	263.145	304.084	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9.140
Schweizer Franken	US-Dollar	345.467	399.994	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11.219
Schweizer Franken	US-Dollar	33.756.115	38.511.604	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.668.653
USD						1.689.012
CHF						1.420.544
Schweizer Franken	US-Dollar	273.136	327.375	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.258)
USD						(2.258)
CHF						(1.899)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	55.787	64.466	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.938
Schweizer Franken	US-Dollar	73.239	84.799	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.378
Schweizer Franken	US-Dollar	7.156.342	8.164.513	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	353.757
USD						358.073
CHF						301.157

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	US-Dollar	57.905	69.404	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(479)
USD						(479)
CHF						(403)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF Z (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	2.233	2.645	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Schweizer Franken	US-Dollar	89.724	104.886	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.808
Schweizer Franken	US-Dollar	2.262	2.681	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Schweizer Franken	US-Dollar	1.257	1.471	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25
Schweizer Franken	US-Dollar	4.064	4.753	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	84
Schweizer Franken	US-Dollar	23.807	27.610	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	727
Schweizer Franken	US-Dollar	15.120	17.606	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	392
Schweizer Franken	US-Dollar	1.129	1.304	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	39
Schweizer Franken	US-Dollar	27.592	31.770	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.073
Schweizer Franken	US-Dollar	560.504	647.705	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19.469
Schweizer Franken	US-Dollar	16.013	18.424	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	636
Schweizer Franken	US-Dollar	737.105	853.447	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	23.937
Schweizer Franken	US-Dollar	3.103	3.539	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	155
Schweizer Franken	US-Dollar	72.217.733	82.391.613	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3.569.912
USD						3.618.278
CHF						3.043.153
US-Dollar	Schweizer Franken	2.679	2.262	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.470	1.257	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(25)
Schweizer Franken	US-Dollar	579.763	694.890	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4.792)
US-Dollar	Schweizer Franken	2.648	2.233	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Schweizer Franken	104.981	89.724	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.819)
US-Dollar	Schweizer Franken	33.126	28.296	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(555)
US-Dollar	Schweizer Franken	86.868	74.272	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.539)
US-Dollar	Schweizer Franken	13.397	11.552	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(353)
US-Dollar	Schweizer Franken	68.342	58.694	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.522)
US-Dollar	Schweizer Franken	172.479	149.250	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.174)
US-Dollar	Schweizer Franken	64.408	55.937	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.175)
US-Dollar	Schweizer Franken	114.047	98.607	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.326)
US-Dollar	Schweizer Franken	120.514	104.738	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(4.157)
US-Dollar	Schweizer Franken	129.411	112.935	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(5.017)
US-Dollar	Schweizer Franken	80.512	70.487	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.389)
US-Dollar	Schweizer Franken	61.812	54.205	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.709)
USD						(36.573)
CHF						(30.760)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	90.025	98.436	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	990
Euro	US-Dollar	115.726	127.363	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	448

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	11.239.712	12.092.087	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	321.344
USD						322.782
EUR						292.388
Euro	US-Dollar	99.205	110.199	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(634)
USD						(634)
EUR						(574)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	55.728	61.371	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	150
Euro	US-Dollar	24.988	27.528	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	69
Euro	US-Dollar	2.000	2.202	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	1.500	1.648	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	150.711	165.649	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	801
Euro	US-Dollar	1.000	1.093	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	2.494	2.744	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	118.136	129.173	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.299
Euro	US-Dollar	150.802	165.966	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	583
Euro	US-Dollar	9.000	9.701	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	239
Euro	US-Dollar	14.775.503	15.896.019	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	422.432
US-Dollar	Euro	34	31	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
USD						425.609
EUR						385.533
US-Dollar	Euro	27.517	24.988	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(67)
Euro	US-Dollar	127.374	141.490	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(815)
US-Dollar	Euro	61.394	55.728	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(154)
US-Dollar	Euro	4.622	4.197	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	14.138	12.922	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(133)
US-Dollar	Euro	279	254	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	4.652	4.256	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(49)
US-Dollar	Euro	4.939	4.528	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(62)
US-Dollar	Euro	7.885	7.165	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(29)
USD						(1.325)
EUR						(1.200)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.100	1.212	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	2.500	2.735	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	26
Euro	US-Dollar	254	279	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	4.533	4.957	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	50
Euro	US-Dollar	5.787	6.369	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	22

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	567.355	610.380	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	16.221
USD						16.324
EUR						14.787
US-Dollar	Euro	1.211	1.100	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
Euro	US-Dollar	3.459	3.842	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Euro	165.639	150.711	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(811)
USD						(836)
EUR						(757)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.745	1.908	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	2.239	2.464	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	218.045	234.581	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.234
USD						6.262
EUR						5.672
Euro	US-Dollar	1.909	2.120	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(12)
USD						(12)
EUR						(11)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	131.543	144.862	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	355
US-Dollar	Euro	27.983	25.291	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	62
Euro	US-Dollar	26.703	28.783	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	709
Euro	US-Dollar	37.510	40.553	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	875
Euro	US-Dollar	33.195	36.162	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	499
Euro	US-Dollar	2170.374	2.388.622	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	8.396
Euro	US-Dollar	1.688.600	1.846.361	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	18.573
Euro	US-Dollar	64.892	70.774	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	895
Euro	US-Dollar	36.891	40.322	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	421
Euro	US-Dollar	37.234	40.915	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	207
Euro	US-Dollar	3.343	3.658	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	35
Euro	US-Dollar	15.813	17.413	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	52
Euro	US-Dollar	18.063	19.904	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	46
Euro	US-Dollar	115.912	127.697	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	319
Euro	US-Dollar	24.334	26.229	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	646
Euro	US-Dollar	211.212.944	227.230.491	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6.038.589
US-Dollar	Euro	987.719	892.378	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2.153
USD						6.072.832
EUR						5.501.002
US-Dollar	Euro	127.648	115.912	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(313)
Euro	US-Dollar	892.378	987.371	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(2.188)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	25.291	27.993	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(61)
Euro	US-Dollar	1.842.695	2.046.906	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(11.785)
US-Dollar	Euro	146.633	135.632	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.162)
US-Dollar	Euro	32.789	30.420	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(808)
US-Dollar	Euro	68.235	63.306	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.681)
US-Dollar	Euro	144.917	131.543	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(363)
US-Dollar	Euro	692.952	628.874	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.592)
US-Dollar	Euro	37.839	34.363	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(113)
US-Dollar	Euro	1.872.278	1.711.253	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(17.674)
US-Dollar	Euro	23.307	21.210	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(118)
US-Dollar	Euro	66.879	61.188	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(698)
US-Dollar	Euro	97.054	88.989	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1.227)
US-Dollar	Euro	1.951	1.773	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	223.745	205.387	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.090)
USD						(44.880)
EUR						(40.654)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	67.167	60.705	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	149
Euro	US-Dollar	45.768	49.332	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.215
Euro	US-Dollar	1.059	1.145	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	25
Euro	US-Dollar	80.737	87.954	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1.215
Euro	US-Dollar	1.491.939	1.641.965	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	5.771
Euro	US-Dollar	1.162.261	1.270.848	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	12.784
Euro	US-Dollar	36.506	40.173	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	145
Euro	US-Dollar	16.818	18.128	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	447
Euro	US-Dollar	23.032	25.119	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	318
Euro	US-Dollar	25.866	28.423	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	144
Euro	US-Dollar	42.670	46.685	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	441
Euro	US-Dollar	55.649	61.277	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	182
Euro	US-Dollar	41.970	46.246	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	106
Euro	US-Dollar	20.949	23.079	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	58
Euro	US-Dollar	1.809	1.977	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	21
Euro	US-Dollar	145.027.673	156.025.994	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.146.349
US-Dollar	Euro	3.360	3.035	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	7
USD						4.169.377
EUR						3.776.780
US-Dollar	Euro	23.071	20.949	2. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(57)
Euro	US-Dollar	3.035	3.358	3. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(7)
Euro	US-Dollar	60.705	67.191	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(146)
Euro	US-Dollar	1.274.346	1.415.571	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(8.150)
US-Dollar	Euro	8.305	7.537	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Euro	4.773	4.363	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(45)
US-Dollar	Euro	338.247	309.463	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3.532)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	14.944	13.702	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(189)
US-Dollar	Euro	17.255	15.680	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(62)
US-Dollar	Euro	16.029	14.714	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(221)
USD						(12.428)
EUR						(11.258)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	557	615	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.166	1.275	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	1.498	1.649	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	145.597	156.639	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4.163
USD						4.182
EUR						3.788
Euro	US-Dollar	482	535	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	67.217	61.436	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(635)
USD						(638)
EUR						(578)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	4.599	5.848	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	14
Pfund Sterling	US-Dollar	567.021	711.981	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	10.816
USD						10.830
GBP						8.496
Pfund Sterling	US-Dollar	5.222	6.670	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(14)
Pfund Sterling	US-Dollar	5.880	7.498	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(3)
USD						(17)
GBP						(13)

RESPONSIBLE HORIZONS EM DEBT IMPACT FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen			
Benin - 701.223		701.223	1,16
800.000	Benin Government International Bond 'REGS' 4.950% 22-Jan-2035	701.223	1,16
Brasilien - 3.259.189		3.259.189	5,37
300.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' 4.875% 11-Jan-2029	294.483	0,49
200.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' 4.875% 11-Jan-2029	196.322	0,32
400.000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 'REGS' 4.750% 09-May-2024	397.758	0,66
300.000	Brazilian Government International Bond 6.250% 18-Mar-2031	311.730	0,52
300.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN 3.875% 15-Apr-2031	287.186	0,47
300.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 4.875% 19-Sep-2027	293.199	0,48
200.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 7.000% 03-Apr-2049	202.271	0,33
800.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 5.250% 10-Jan-2028	771.446	1,27
500.000	Suzano Austria GmbH 'REGS' 5.750% 14-Jul-2026	504.794	0,83
Chile - 5.350.914		5.350.914	8,82
500.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 4.250% 30-Apr-2029	464.212	0,76
300.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 5.150% 29-Jan-2050	248.016	0,41
400.000	Chile Government International Bond 0.555% 21-Jan-2029	385.814	0,64
1.700.000	Chile Government International Bond 1.250% 22-Jan-2051	1.059.709	1,75
700.000	Chile Government International Bond 3.500% 25-Jan-2050	535.253	0,88
300.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	259.837	0,43
600.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	479.403	0,79
500.000	Inversiones CMPC SA 'REGS' 6.125% 23-Jun-2033	521.497	0,86
1.100.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	972.573	1,60
400.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 6.500% 07-Nov-2033	424.600	0,70
China - 4.488.122		4.488.122	7,40
400.000	Baidu Inc 1.625% 23-Feb-2027	362.946	0,60
400.000	Baidu Inc 2.375% 23-Aug-2031	331.513	0,55
1.100.000	China Construction Bank Corp/Hong Kong 'EMTN' 1.250% 04-Aug-2025	1.037.971	1,71
749.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London 'GMTN' 1.625% 28-Dec-2025	880.095	1,45
800.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/ Luxembourg 'GMTN' 0.125% 28-Oct-2024	857.825	1,41
500.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/ Singapore 'GMTN' 1.000% 28-Oct-2024	483.028	0,80
500.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 6.536% 27-Jul-2032	534.744	0,88
Kolumbien - 675.066		675.066	1,11
300.000	Colombia Government International Bond 8.000% 14-Nov-2035	328.557	0,54
300.000	Colombia Government International Bond 8.750% 14-Nov-2053	346.509	0,57
Costa Rica - 665.397		665.397	1,10
650.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 'REGS' 10.875% 15-Jan-2031	665.397	1,10
Georgien - 831.330		831.330	1,37
900.000	Georgian Railway JSC 'REGS' 4.000% 17-Jun-2028	831.330	1,37
Guatemala - 1.683.743		1.683.743	2,78
900.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	788.091	1,30
500.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029	467.970	0,77
450.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	427.682	0,71

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Nettowert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen Forts.			
Ungarn - 1.018.085		1.018.085	1,68
1.200.000	Hungary Government International Bond 1.750% 05-Jun-2035	1.018.085	1,68
Indien - 2.607.574		2.607.574	4,30
600.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS' 3.250% 03-Jun-2031	530.721	0,88
500.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	517.990	0,85
1.080.000	Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	977.163	1,61
600.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS' 5.950% 29-Jul-2026	581.700	0,96
Indonesien - 2.335.333		2.335.333	3,85
400.000	Pertamina Geothermal Energy PT 'REGS' 5.150% 27-Apr-2028	401.095	0,66
500.000	PT Tower Bersama Infrastructure Tbk 2.750% 20-Jan-2026	470.000	0,78
800.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS' 4.850% 14-Oct-2038	734.237	1,21
729.720	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 'REGS' 6.750% 24-Apr-2033	730.001	1,20
Israel - 1.182.624		1.182.624	1,95
1.200.000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 7.129% 18-Jul-2033	1.182.624	1,95
Luxemburg - 1.666.369		1.666.369	2,75
800.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	688.990	1,14
1.000.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	977.379	1,61
Malaysia - 217.279		217.279	0,36
250.000	Malaysia Wakala Sukuk Bhd 'REGS' 2.070% 28-Apr-2031	217.279	0,36
Mauritius - 652.750		652.750	1,08
700.000	Axian Telecom 'REGS' 7.375% 16-Feb-2027	652.750	1,08
Mexiko - 2.764.310		2.764.310	4,56
900.000	America Movil SAB de CV 3.625% 22-Apr-2029	850.813	1,40
2.200.000	Mexico Government International Bond 2.250% 12-Aug-2036	1.913.497	3,16
Nigeria - 895.800		895.800	1,48
1.000.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	895.800	1,48
Panama - 1.264.012		1.264.012	2,08
800.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	743.377	1,22
600.000	Telecomunicaciones Digitales SA 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030	520.635	0,86
Peru - 1.932.150		1.932.150	3,19
800.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	753.675	1,25
900.000	Peruvian Government International Bond 1.950% 17-Nov-2036	753.196	1,24
600.000	Peruvian Government International Bond 3.600% 15-Jan-2072	425.279	0,70
Philippinen - 1.075.754		1.075.754	1,77
1.200.000	Philippine Government International Bond 4.200% 29-Mar-2047	1.075.754	1,77
Polen - 2.377.938		2.377.938	3,92
800.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	935.120	1,54
700.000	ORLEN SA 'EMTN' 1.125% 27-May-2028	700.842	1,16
500.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 1.000% 07-Mar-2029	510.921	0,84
300.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 2.000% 08-Mar-2049	231.055	0,38

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Katar - 1.031.046			
1.100.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025	1.031.046	1,70
Republik Korea - 6.339.860			
700.000	Export-Import Bank of Korea 5.125% 11-Jan-2033	728.115	1,20
200.000	Hana Bank 'REGS' 1.250% 16-Dec-2026	180.275	0,30
400.000	Hana Bank 'REGS' 5.750% 24-Oct-2028	420.148	0,69
300.000	Industrial Bank of Korea 'REGS' 5.375% 04-Oct-2028	309.953	0,51
500.000	Kookmin Bank 'REGS' 1.375% 06-May-2026	458.136	0,76
900.000	LG Chem Ltd 'REGS' 2.375% 07-Jul-2031	746.521	1,23
200.000	LG Energy Solution Ltd 'REGS' 5.750% 25-Sep-2028	206.295	0,34
500.000	Shinhan Bank Co Ltd 'GMTN' 0.250% 16-Oct-2024	537.284	0,89
400.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.000% 23-Apr-2029	373.756	0,62
400.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' 1.350% 10-Jan-2026	371.546	0,61
300.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	292.465	0,48
1.000.000	SK Hynix Inc 'REGS' 2.375% 19-Jan-2031	813.170	1,34
500.000	Woori Bank 'GMTN' FRN 6.399% 21-May-2024	500.320	0,82
400.000	Woori Bank 'REGS' 4.875% 26-Jan-2028	401.876	0,66
Rumänien - 2.240.273			
1.000.000	Banca Comerciala Romana SA 'EMTN' FRN 7.625% 19-May-2027	1.167.842	1,92
1.200.000	NE Property BV 'EMTN' 2.000% 20-Jan-2030	1.072.431	1,77
Südafrika - 297.431			
500.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS' 5.500% 04-Sep-2026	297.431	0,49
Spanien - 747.741			
700.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	747.741	1,23
Supranational - 2.074.878			
800.000	African Development Bank 0.250% 21-Nov-2024	861.640	1,42
1.200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2.750% 22-Jan-2033	1.013.227	1,67
200.000	Central American Bank for Economic Integration 'REGS' 5.000% 09-Feb-2026	200.011	0,33
Tansania - 788.945			
800.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	788.945	1,30
Türkei - 2.813.750			
800.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	731.680	1,21
300.000	Türkcell İletişim Hizmetleri AS 'REGS' 5.750% 15-Oct-2025	295.317	0,49
200.000	Türkcell İletişim Hizmetleri AS 'REGS' 5.800% 11-Apr-2028	189.860	0,31
500.000	Türkiye Sinai Kalkınma Bankası AS 'REGS' 9.375% 19-Oct-2028	538.930	0,89
300.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO 'REGS' 9.000% 12-Oct-2028	315.045	0,52
700.000	Yapi ve Kredi Bankası AS 'REGS' 9.250% 16-Oct-2028	742.918	1,22
Vereinigtes Königreich - 2.041.033			
1.200.000	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 1.000% 02-Nov-2033	1.026.479	1,69
500.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 0.900% 02-Jul-2027	517.954	0,85
500.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN 1.214% 23-Mar-2025	496.600	0,82
Gesamtanlagen in Anleihen		56.019.919	92,36

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 371.569				
9	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2024	1.189.437	16.640	0,03
35	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024	4.133.828	138.212	0,23
17	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2024	2.280.125	216.717	0,35
Offene Terminkontrakte insgesamt			371.569	0,61
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 19.803 (siehe unten)			19.803	0,03
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			56.411.291	93,00
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (297.759)				
(30)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(4.565.939)	(109.776)	(0,18)
(6)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(942.963)	(73.414)	(0,12)
(27)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.048.047)	(96.445)	(0,16)
(8)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(869.500)	(18.124)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(297.759)	(0,49)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (704.216) (siehe unten)			(704.216)	(1,16)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.001.975)	(1,65)
Nettoumlaufvermögen			5.244.089	8,65
Summe Nettovermögen			60.653.405	100,00
*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss. 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			90,77	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente			0,60	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,03	
Sonstiges Umlaufvermögen			8,60	
Gesamtvermögen			100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund						
Euro	US-Dollar	482.000	517.558	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	18.060
USD						18.060
US-Dollar	Euro	222.262	206.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(6.131)
US-Dollar	Euro	14.550.047	13.708.000	23. Jan. 24	HSBC Bank plc	(648.098)
US-Dollar	Euro	199.869	183.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(3.488)
US-Dollar	Euro	12.010	11.000	20. Mrz. 24	BNP Paribas	(213)
US-Dollar	Euro	1.955.093	1.781.000	20. Mrz. 24	BNP Paribas	(24.025)
US-Dollar	Pfund Sterling	492.733	403.000	20. Mrz. 24	HSBC Bank plc	(21.091)
US-Dollar	Pfund Sterling	355.829	280.000	20. Mrz. 24	BNP Paribas	(1.170)
USD						(704.216)
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	102	118	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	4
Schweizer Franken	US-Dollar	80	93	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	3
Schweizer Franken	US-Dollar	10.168	11.597	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	572
USD						579
CHF						484
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	58	64	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	102	111	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	82	91	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	10.088	10.858	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	321
USD						324
EUR						292
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	57	63	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	102	111	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	82	90	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	10.071	10.840	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	321
USD						324
EUR						292
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	81	89	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	9.932	10.690	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	316
Euro	US-Dollar	56	62	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	100	109	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
USD						318
EUR						287
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	63	80	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	103	130	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	85	108	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	-

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	10.198	12.800	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	198
USD						198
GBP						155

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Australien - 11.600.477			
(31. Dezember 2022: 8.997.812)			
4.687.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	5.071.967	0,45
4.255.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028	4.010.616	0,36
2.530.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 2.750% 23-Apr-2024	2.517.894	0,23
Österreich - 20.220.198			
(31. Dezember 2022: 19.125.422)			
3.000.000	Erste Group Bank AG 'EMTN' FRN 1.000% 10-Jun-2030	2.833.934	0,25
4.900.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0.375% 25-Sep-2026	4.486.914	0,40
6.300.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	6.331.500	0,57
2.000.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	1.809.100	0,16
4.500.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	4.758.750	0,43
Belgien - 13.349.120			
(31. Dezember 2022: 22.410.917)			
2.300.000	Belfius Bank SA 'EMTN' 0.000% 28-Aug-2026	2.108.889	0,19
1.800.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 0.875% 28-Apr-2030	1.574.752	0,14
2.200.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 3.625% 18-Jan-2033	2.288.847	0,21
2.800.000	Groupe Bruxelles Lambert NV 0.125% 28-Jan-2031	2.261.654	0,20
2.100.000	Groupe Bruxelles Lambert NV 1.875% 19-Jun-2025	2.054.521	0,18
2.900.000	KBC Group NV 'EMTN' 4.375% 06-Dec-2031	3.060.457	0,28
Bermudas - 2.684.716			
(31. Dezember 2022: -)			
2.591.000	Athora Holding Ltd 6.625% 16-Jun-2028	2.684.716	0,24
Dänemark - 10.339.830			
(31. Dezember 2022: 4.839.670)			
2.646.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 4.500% 09-Nov-2028	2.735.302	0,25
5.397.000	Orsted AS 'EMTN' 3.750% 01-Mar-2030	5.545.283	0,50
2.049.000	Orsted AS FRN 5.250% 08-Dec-3022	2.059.245	0,18
Finnland - 4.344.649			
(31. Dezember 2022: 8.243.507)			
2.161.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.375% 26-Feb-2024	2.149.309	0,19
2.414.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.625% 27-Jul-2027	2.195.340	0,20
Frankreich - 220.724.011			
(31. Dezember 2022: 201.986.500)			
1.500.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	1.534.432	0,14
4.300.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	4.395.266	0,39
5.100.000	ALD SA 'EMTN' 4.875% 06-Oct-2028	5.401.333	0,48
3.100.000	APRR SA 'EMTN' 1.250% 18-Jan-2028	2.920.588	0,26
4.100.000	APRR SA 'EMTN' 3.125% 24-Jan-2030	4.147.683	0,37
1.200.000	Arkema SA 'EMTN' 0.125% 14-Oct-2026	1.111.074	0,10
5.300.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 0.875% 17-Feb-2025	5.121.443	0,46
5.700.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	5.767.288	0,52
1.800.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.625% 02-Dec-2024	1.807.758	0,16
1.339.000	AXA SA 'EMTN' FRN 3.250% 28-May-2049	1.288.580	0,12
1.740.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.941% 07-Nov-2024	1.718.386	0,15
1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.250% 03-Jun-2030	867.557	0,08
3.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.100% 08-Oct-2027	2.688.885	0,24
900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.750% 01-Feb-2033	920.020	0,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Frankreich Forts.			
6.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.000% 21-Nov-2029	6.342.536	0,57
4.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.750% 10-Nov-2031	4.354.241	0,39
2.400.000	Banque Stellantis France SACA 'EMTN' 3.875% 19-Jan-2026	2.417.628	0,22
6.400.000	Banque Stellantis France SACA 'EMTN' 4.000% 21-Jan-2027	6.509.312	0,58
2.600.000	BNP Paribas Cardif SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2024	2.514.346	0,23
100.000	BNP Paribas Cardif SA FRN (Perpetual) 4.032% 25-Nov-2025	98.772	0,01
1.200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.500% 19-Feb-2028	1.093.090	0,10
3.600.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.125% 23-Jan-2027	3.499.872	0,31
4.500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	4.388.355	0,39
6.900.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.125% 26-Sep-2032	7.279.396	0,65
5.100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.250% 13-Apr-2031	5.309.814	0,48
5.600.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.375% 13-Jan-2029	5.816.188	0,52
1.700.000	Bouygues SA 3.875% 17-Jul-2031	1.772.403	0,16
1.600.000	Bouygues SA 5.375% 30-Jun-2042	1.904.536	0,17
8.000.000	BPCE SA 'EMTN' 0.375% 02-Feb-2026	7.541.360	0,68
1.500.000	BPCE SA 'EMTN' 1.375% 23-Mar-2026	1.440.520	0,13
1.200.000	BPCE SA 'EMTN' 4.000% 29-Nov-2032	1.255.062	0,11
3.400.000	BPCE SA 'EMTN' 4.125% 10-Jul-2028	3.528.962	0,32
3.600.000	BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042	3.273.336	0,29
600.000	Carrefour SA 'EMTN' 2.625% 15-Dec-2027	589.124	0,05
3.900.000	Credit Agricole Assurances SA 2.000% 17-Jul-2030	3.432.694	0,31
1.000.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.125% 07-Mar-2030	1.046.695	0,09
3.700.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.375% 27-Nov-2033	3.893.325	0,35
4.300.000	Credit Agricole SA 'EMTN' FRN 5.500% 28-Aug-2033	4.520.586	0,41
700.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.750% 05-Mar-2029	647.919	0,06
1.300.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.875% 20-Dec-2026	1.252.752	0,11
3.100.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 3.375% 19-Sep-2027	3.112.741	0,28
1.800.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 4.250% 01-Dec-2032	1.903.230	0,17
2.000.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN 1.875% 25-Oct-2029	1.947.470	0,17
2.900.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	3.136.596	0,28
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	108.159	0,01
1.200.000	Engie SA 'EMTN' 0.500% 24-Oct-2030	1.005.311	0,09
800.000	Engie SA 'EMTN' 2.125% 30-Mar-2032	737.270	0,07
2.500.000	Engie SA 'EMTN' 4.000% 11-Jan-2035	2.603.213	0,23
2.100.000	Engie SA 'EMTN' 4.500% 06-Sep-2042	2.265.732	0,20
3.300.000	Kering SA 'EMTN' 3.625% 05-Sep-2031	3.417.612	0,31
3.000.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.625% 01-Jul-2030	2.507.573	0,23
2.200.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.625% 01-Jul-2030	1.838.887	0,17
3.800.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031	3.553.019	0,32
3.000.000	MMS USA Holdings Inc 0.625% 13-Jun-2025	2.874.555	0,26
2.900.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2.125% 21-Jun-2052	2.249.139	0,20
3.300.000	Orange SA 1.200% 11-Jul-2034	2.734.760	0,25
1.800.000	Orange SA 'EMTN' 2.375% 18-May-2032	1.736.604	0,16
200.000	Orange SA 'EMTN' 2.375% 18-May-2032	192.362	0,02
4.400.000	Orange SA 'EMTN' 3.875% 11-Sep-2035	4.722.498	0,42
500.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 15-Jul-2028	444.449	0,04
1.100.000	RCI Banque SA 'EMTN' 1.625% 11-Apr-2025	1.073.374	0,10
1.583.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 14-Jun-2028	1.669.012	0,15
8.466.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 02-Oct-2029	8.917.449	0,80
3.100.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 3.500% 07-Dec-2031	3.216.498	0,29
1.100.000	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.500% 29-May-2025	1.070.988	0,10
2.000.000	Societe Generale SA 'EMTN' 2.625% 30-May-2029	1.947.917	0,18
400.000	Societe Generale SA 'EMTN' 5.625% 02-Jun-2033	428.902	0,04
1.800.000	Societe Generale SA 'EMTN' 5.625% 02-Jun-2033	1.927.037	0,17

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Frankreich Forts.				
1.200.000	Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027	1.101.588	0,10	
600.000	Sogecap SA FRN (Perpetual) 4.125% 18-Feb-2026	592.565	0,05	
1.600.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	1.496.904	0,13	
2.800.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	3.009.902	0,27	
2.100.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	2.327.419	0,21	
500.000	TDF Infrastructure SASU 2.500% 07-Apr-2026	488.314	0,04	
3.872.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2024	3.841.024	0,34	
3.322.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1.625% 25-Oct-2027	2.983.156	0,27	
1.783.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 17-Jan-2027	1.648.829	0,15	
1.694.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030	1.435.665	0,13	
3.600.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	3.301.974	0,30	
1.900.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	1.611.561	0,14	
886.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.500% 22-Feb-2028	832.184	0,07	
4.600.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 4.125% 11-Dec-2030	4.740.714	0,43	
2.700.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	2.556.738	0,23	
Deutschland - 108.680.592				
(31. Dezember 2022: 102.695.552)		108.680.592	9,76	
1.200.000	adidas AG 0.000% 05-Oct-2028	1.061.473	0,10	
2.800.000	Allianz SE 'EMTN' FRN 4.252% 05-Jul-2052	2.790.480	0,25	
5.600.000	Allianz SE FRN (Perpetual) 3.375% 18-Sep-2024	5.554.360	0,50	
3.400.000	Amprion GmbH 3.971% 22-Sep-2032	3.566.073	0,32	
5.300.000	Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	5.592.825	0,50	
2.000.000	BASF SE 'EMTN' 3.750% 29-Jun-2032	2.082.740	0,19	
2.226.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.000% 22-May-2028	2.069.523	0,19	
700.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	672.289	0,06	
3.000.000	Commerzbank AG FRN 3.000% 14-Sep-2027	2.941.950	0,26	
1.600.000	Commerzbank AG FRN 5.250% 25-Mar-2029	1.688.000	0,15	
1.483.000	Continental AG 4.000% 01-Jun-2028 'EMTN' 4.000% 01-Jun-2028	1.531.880	0,14	
1.121.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 0.625% 08-Dec-2050	621.979	0,06	
961.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 4.000% 23-Nov-2043	1.049.647	0,09	
764.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	741.063	0,07	
2.300.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 4.000% 24-Jun-2032	2.216.980	0,20	
1.000.000	Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032	827.050	0,07	
6.800.000	Deutsche Boerse AG 3.875% 28-Sep-2033	7.280.012	0,65	
1.500.000	Deutsche Boerse AG FRN 1.250% 16-Jun-2047	1.360.860	0,12	
967.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	876.005	0,08	
2.442.000	E.ON SE 'EMTN' 3.875% 12-Jan-2035	2.546.493	0,23	
3.100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	2.615.489	0,23	
8.200.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3.279% 05-Sep-2031	8.210.537	0,74	
7.500.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	7.257.112	0,65	
3.597.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 5.125% 05-Oct-2030	3.878.034	0,35	
5.000.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029	4.655.625	0,42	
800.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032	732.624	0,07	
1.200.000	LEG Immobilien SE 1.000% 19-Nov-2032	935.856	0,08	
3.200.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.375% 17-Jan-2026	2.994.960	0,27	
1.700.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.750% 30-Jun-2031	1.353.829	0,12	
1.000.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.875% 17-Jan-2029	873.640	0,08	
6.200.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.700% 30-May-2031	6.487.711	0,58	
700.000	Merck KGaA FRN 1.625% 25-Jun-2079	682.808	0,06	
2.000.000	Robert Bosch GmbH 'EMTN' 4.375% 02-Jun-2043	2.173.210	0,19	
2.000.000	SAP SE 1.250% 10-Mar-2028	1.898.101	0,17	
2.200.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	2.306.227	0,21	
700.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	730.548	0,07	
3.000.000	Sartorius Finance BV 4.875% 14-Sep-2035	3.174.493	0,28	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Deutschland Forts.				
2.100.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	2.184.399	0,20	
4.400.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	3.661.133	0,33	
2.000.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Oct-2039	1.391.720	0,12	
1.800.000	Vonovia SE 1.000% 16-Jun-2033	1.374.980	0,12	
1.800.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	1.188.810	0,11	
800.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	847.064	0,08	
Griechenland - 2.540.797				
(31. Dezember 2022: -)		2.540.797	0,23	
2.419.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 6.750% 05-Dec-2029	2.540.797	0,23	
Hongkong - 1.357.403				
(31. Dezember 2022: 1.234.145)		1.357.403	0,12	
1.589.000	ALA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	1.357.403	0,12	
Irland - 28.502.047				
(31. Dezember 2022: 24.118.331)		28.502.047	2,56	
1.330.000	AlB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031	1.277.292	0,12	
4.152.000	AlB Group Plc FRN 3.625% 04-Jul-2026	4.154.637	0,37	
2.583.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 5.000% 04-Jul-2031	2.768.356	0,25	
3.600.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	3.334.986	0,30	
2.246.000	ESB Finance DAC 'EMTN' 4.250% 03-Mar-2036	2.425.107	0,22	
3.192.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	3.026.878	0,27	
2.040.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	2.158.952	0,19	
3.763.000	Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 30-Jun-2029	4.048.536	0,36	
3.143.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029	2.703.656	0,24	
2.000.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.000% 22-Sep-2033	1.606.440	0,15	
1.060.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.500% 15-Sep-2027	997.207	0,09	
Italien - 63.955.993				
(31. Dezember 2022: 55.137.800)		63.955.993	5,74	
1.000.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.124% 01-Oct-2030	880.900	0,08	
2.307.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 4.750% 24-Jan-2031	2.383.616	0,21	
4.317.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 5.125% 14-Jun-2033	4.559.189	0,41	
2.007.000	CA Auto Bank SPA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024	1.984.662	0,18	
7.492.000	Enel Finance International NV 0.250% 17-Nov-2025	7.096.348	0,64	
2.445.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.375% 08-Jun-2027	2.140.986	0,19	
4.096.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.875% 08-Jun-2030	3.250.954	0,29	
3.311.000	Hera SpA 'EMTN' 4.250% 20-Apr-2033	3.445.741	0,31	
1.451.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 8.248% 21-Nov-2033	1.425.402	0,13	
1.120.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024	1.090.285	0,10	
3.075.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	2.769.053	0,25	
2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 04-Jul-2024	2.166.670	0,20	
1.071.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 5.125% 29-Aug-2031	1.143.373	0,10	
2.015.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030	1.607.849	0,14	
1.315.000	Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024	1.286.129	0,12	
4.232.000	Leasys SpA 4.375% 07-Dec-2024	4.239.808	0,38	
3.093.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.500% 26-Jul-2026	3.150.607	0,28	
4.229.000	Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	4.340.392	0,39	
2.602.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Nov-2028	2.335.854	0,21	
1.368.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026	1.306.414	0,12	
1.500.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.375% 26-Jul-2027	1.415.885	0,13	
4.014.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 3.875% 24-Jul-2033	4.149.412	0,37	
3.155.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	2.809.748	0,25	
2.070.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025	2.041.248	0,18	
957.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2.000% 23-Sep-2029	935.468	0,08	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Japan - 6.523.591			
(31. Dezember 2022: 7.432.981)		6.523.591	0,58
1.715.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	1.677.150	0,15
4.904.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	4.846.441	0,43
Luxemburg - 19.820.045			
(31. Dezember 2022: 16.997.050)		19.820.045	1,78
3.280.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 3.625% 29-Oct-2029	3.022.717	0,27
4.739.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	3.673.193	0,33
1.984.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	1.859.067	0,17
4.122.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 15-Jul-2027	3.790.406	0,34
5.287.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	4.664.984	0,42
3.000.000	SELP Finance Sarl 1.500% 20-Dec-2026	2.809.678	0,25
Niederlande - 68.260.369			
(31. Dezember 2022: 90.148.162)		68.260.369	6,12
1.200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.250% 28-May-2025	1.163.852	0,10
1.200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	1.238.700	0,11
2.847.000	ASML Holding NV 2.250% 17-May-2032	2.759.426	0,25
2.314.000	ASR Nederland NV 3.625% 12-Dec-2028	2.352.628	0,21
3.605.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	3.225.574	0,29
3.100.000	de Volksbank NV 4.875% 07-Mar-2030	3.240.136	0,29
1.700.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024	1.655.724	0,15
1.600.000	de Volksbank NV FRN 2.375% 04-May-2027	1.546.400	0,14
2.251.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.375% 14-Apr-2033	1.806.337	0,16
3.406.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 3.625% 12-Jun-2034	3.601.538	0,32
1.701.000	Euronext NV 1.000% 18-Apr-2025	1.644.125	0,15
3.900.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 1.625% 26-Sep-2029	3.806.400	0,34
800.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 26-May-2031	764.050	0,07
1.800.000	ING Groep NV FRN 0.375% 29-Sep-2028	1.602.450	0,14
4.400.000	ING Groep NV FRN 1.000% 13-Nov-2030	4.129.198	0,37
3.000.000	ING Groep NV FRN 4.500% 23-May-2029	3.096.394	0,28
5.736.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	5.146.769	0,46
5.103.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 4.500% 23-Jan-2034	5.372.260	0,48
2.034.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.500% 04-Apr-2028	2.082.013	0,19
3.323.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	3.098.498	0,28
933.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	928.652	0,08
2.800.000	Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 0.375% 26-Feb-2025	2.698.678	0,24
284.000	NN Group NV 'EMTN' 1.625% 01-Jun-2027	273.631	0,02
1.245.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	1.173.786	0,11
2.231.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.750% 28-Oct-2042	2.629.256	0,24
1.400.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 2.000% 10-Jul-2026	1.348.052	0,12
6.590.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	5.875.842	0,53
Norwegen - 13.507.473			
(31. Dezember 2022: 3.661.350)		13.507.473	1,21
4.200.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Jan-2028	3.859.800	0,34
4.823.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.500% 19-Jul-2028	4.994.217	0,45
4.613.000	Statkraft AS 'EMTN' 3.125% 13-Dec-2031	4.653.456	0,42
Polen - 4.643.100			
(31. Dezember 2022: 1.009.099)		4.643.100	0,42
4.400.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	4.643.100	0,42
Portugal - 7.709.292			
(31. Dezember 2022: 5.046.863)		7.709.292	0,69
3.300.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN' 3.875% 26-Jun-2028	3.399.759	0,30
3.177.000	EDP Servicios Financieros Espana SA 'EMTN' 4.125% 04-Apr-2029	3.310.164	0,30
900.000	Novo Banco SA FRN 9.875% 01-Dec-2033	999.369	0,09
Republik Korea - 2.653.884			
(31. Dezember 2022: 778.182)		2.653.884	0,24
2.850.000	LG Energy Solution Ltd 'REGS' 5.750% 25-Sep-2028	2.653.884	0,24

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Rumänien - 296.096			
(31. Dezember 2022: -)		296.096	0,03
367.000	NE Property BV 'EMTN' 2.000% 20-Jan-2030	296.096	0,03
Spanien - 105.707.463			
(31. Dezember 2022: 89.653.759)		105.707.463	9,49
1.400.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	1.454.091	0,13
4.700.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.875% 02-Apr-2030	5.024.394	0,45
1.800.000	Aena SME SA 'EMTN' 4.250% 13-Oct-2030	1.921.941	0,17
2.300.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	2.217.987	0,20
1.500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 1.000% 16-Jan-2030	1.443.502	0,13
4.200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	4.412.184	0,40
3.300.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 8.000% 22-Sep-2026	3.441.372	0,31
1.800.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.625% 07-Mar-2024	1.791.612	0,16
2.600.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	2.353.559	0,21
2.100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	2.060.793	0,19
3.000.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	3.163.830	0,28
1.100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.250% 07-Feb-2029	1.142.075	0,10
1.500.000	Banco Santander SA 'EMTN' 0.300% 04-Oct-2026	1.393.972	0,13
3.300.000	Banco Santander SA 'EMTN' 4.875% 18-Oct-2031	3.518.196	0,32
4.200.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.100% 26-Jan-2025	4.189.584	0,38
2.900.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 5.750% 23-Aug-2033	3.059.123	0,27
1.900.000	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	1.732.366	0,16
6.200.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	5.984.364	0,54
900.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1.000% 25-Jun-2024	887.152	0,08
5.200.000	CaixaBank SA 'EMTN' 4.250% 06-Sep-2030	5.421.416	0,49
3.500.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Nov-2026	3.295.495	0,30
3.400.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031	3.168.698	0,28
500.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.000% 19-Jul-2029	524.895	0,05
2.000.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.125% 19-Jul-2034	2.155.420	0,19
2.900.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.000% 15-Sep-2027	2.655.327	0,24
4.500.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	3.958.178	0,36
4.000.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.875% 25-Apr-2028	4.044.000	0,36
3.400.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Aug-2027	3.037.798	0,27
500.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 3.250% 12-Nov-2024	495.125	0,04
400.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025	387.020	0,03
2.600.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	2.374.476	0,21
3.700.000	Kutxabank SA FRN 4.750% 15-Jun-2027	3.775.739	0,34
700.000	Merlin Properties Socimi SA 1.875% 04-Dec-2034	556.146	0,05
1.300.000	Merlin Properties Socimi SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	1.108.503	0,10
2.200.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	1.920.050	0,17
2.700.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	2.689.686	0,24
1.100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 6.135% 03-Feb-2030	1.139.875	0,10
3.000.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	3.004.290	0,27
8.300.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 7.250% 15-Nov-2027	8.803.229	0,79
Schweden - 10.918.313			
(31. Dezember 2022: 6.965.086)		10.918.313	0,98
3.266.000	Assa Abloy AB 'EMTN' 3.875% 13-Sep-2030	3.433.676	0,31
460.000	Investor AB 2.750% 10-Jun-2032	449.220	0,04
3.933.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN' 3.750% 05-May-2026	3.984.503	0,36
1.102.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.625% 22-Feb-2032	1.143.536	0,10

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Schweden Forts.				
1.973.000	Volvo Treasury AB 'EMTN' 2.000% 19-Aug-2027	1.907.378	0,17	
Schweiz - 32.877.595				
(31. Dezember 2022: 36.613.019)				
3.100.000	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 17-Sep-2025	2.991.644	0,27	
4.016.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.250% 05-Jan-2026	3.771.887	0,34	
900.000	Givaudan Finance Europe BV 1.000% 22-Apr-2027	853.749	0,08	
1.033.000	Swisscom Finance BV 0.375% 14-Nov-2028	922.412	0,08	
3.115.000	UBS Group AG 'EMTN' 0.625% 18-Jan-2033	2.359.132	0,21	
1.980.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	1.814.967	0,16	
4.205.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 1.000% 21-Mar-2025	4.175.397	0,37	
6.803.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	6.744.776	0,61	
973.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 4.750% 17-Mar-2032	1.032.013	0,09	
620.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 4.750% 17-Mar-2032	654.967	0,06	
3.461.000	UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	3.254.205	0,29	
3.722.000	UBS Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	4.302.446	0,39	
Vereinigtes Königreich - 146.410.417				
(31. Dezember 2022: 115.492.592)				
3.735.000	AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	3.950.846	0,35	
3.145.000	AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	3.312.283	0,30	
3.125.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.875% 03-Jul-2044	3.116.063	0,28	
4.827.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 1.125% 22-Mar-2031	4.454.901	0,40	
2.930.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 4.918% 08-Aug-2030	3.066.992	0,28	
1.218.000	Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029	1.052.005	0,09	
4.480.000	BP Capital Markets BV 1.467% 21-Sep-2041	3.179.882	0,29	
1.260.000	BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029	1.181.597	0,11	
2.900.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2025	2.763.366	0,25	
1.720.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.000% 21-Nov-2024	1.671.717	0,15	
4.381.000	CCEP Finance Ireland DAC 0.875% 06-May-2033	3.545.039	0,32	
2.299.000	CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024	2.275.125	0,20	
4.984.000	CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.625% 03-Jul-2029	4.545.807	0,41	
2.862.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.750% 27-Mar-2026	2.785.508	0,25	
2.796.000	DS Smith Plc 'EMTN' 4.500% 27-Jul-2030	2.923.134	0,26	
4.170.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.250% 21-May-2026	4.016.934	0,36	
2.852.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.750% 21-May-2030	2.677.358	0,24	
4.733.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	4.345.616	0,39	
4.404.000	Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025	4.264.503	0,38	
3.070.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 14-Mar-2034	2.599.708	0,23	
1.988.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	2.110.431	0,19	
900.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.309% 13-Nov-2026	848.610	0,08	
3.848.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.019% 15-Jun-2027	3.799.958	0,34	
3.148.000	IHG Finance LLC 'EMTN' 4.375% 28-Nov-2029	3.275.305	0,29	
6.211.000	International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	6.456.893	0,58	
1.439.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 3.250% 02-Feb-2026	1.446.411	0,13	
4.535.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 3.500% 17-Jul-2031	4.651.413	0,42	
893.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	921.013	0,08	
1.256.000	National Grid Electricity Transmission Plc 0.190% 20-Jan-2025	1.212.248	0,11	
2.306.000	National Grid Plc 'EMTN' 3.875% 16-Jan-2029	2.376.921	0,21	
754.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 1.043% 14-Sep-2032	666.238	0,06	
3.906.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 4.699% 14-Mar-2028	4.029.840	0,36	
3.289.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 0.125% 12-Nov-2025	3.098.041	0,28	
4.358.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 'EMTN' 3.875% 14-Sep-2033	4.621.681	0,42	
2.361.000	RELX Finance BV 0.000% 18-Mar-2024	2.340.152	0,21	
1.433.000	RELX Finance BV 0.500% 10-Mar-2028	1.301.755	0,12	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigtes Königreich Forts.				
2.925.000	RELX Finance BV 3.750% 12-Jun-2031	3.055.879	0,27	
1.500.000	Segro Capital Sarl 'EMTN' 1.250% 23-Mar-2026	1.434.348	0,13	
4.844.000	SSE Plc 'EMTN' 4.000% 05-Sep-2031	5.092.643	0,46	
5.279.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	4.785.097	0,43	
2.505.000	Standard Chartered Plc FRN 2.500% 09-Sep-2030	2.426.453	0,22	
2.496.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	2.122.611	0,19	
1.720.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 4.250% 27-Feb-2031	1.791.199	0,16	
1.020.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 1.250% 31-Jan-2032	772.936	0,07	
1.535.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	1.457.713	0,13	
390.000	Unilever Finance Netherlands BV 1.750% 25-Mar-2030	367.017	0,03	
1.775.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 2.250% 16-May-2034	1.668.727	0,15	
1.165.000	Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	1.159.466	0,10	
4.917.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 4.625% 29-Oct-2028	4.909.993	0,44	
1.580.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	1.569.120	0,14	
956.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 2.500% 24-May-2039	838.976	0,08	
7.803.000	WPP Finance SA 'EMTN' 4.125% 30-May-2028	8.072.945	0,72	
Vereinigte Staaten von Amerika - 155.114.286				
(31. Dezember 2022: 143.493.959)				
1.002.000	AbbVie Inc 0.750% 18-Nov-2027	925.868	0,08	
1.259.000	American International Group Inc 1.875% 21-Jun-2027	1.205.972	0,11	
2.123.000	AT&T Inc 0.250% 04-Mar-2026	1.994.601	0,18	
5.415.000	AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036	5.066.272	0,45	
951.000	AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032	957.129	0,09	
1.386.000	AT&T Inc 4.300% 18-Nov-2034	1.475.570	0,13	
1.000.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.381% 09-May-2030	895.812	0,08	
3.199.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	3.011.606	0,27	
2.749.000	Booking Holdings Inc 4.125% 12-May-2033	2.953.484	0,27	
1.400.000	Booking Holdings Inc 4.500% 15-Nov-2031	1.524.719	0,14	
1.580.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029	1.400.465	0,13	
1.247.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0.500% 08-Oct-2027	1.152.970	0,10	
3.150.000	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	3.200.463	0,29	
6.034.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	5.566.365	0,50	
3.000.000	Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	2.718.201	0,24	
3.496.000	CRH SMW Finance DAC 'EMTN' 4.250% 11-Jul-2035	3.705.970	0,33	
1.793.000	Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030	1.748.381	0,16	
1.200.000	DH Europe Finance II Sarl 0.750% 18-Sep-2031	1.013.991	0,09	
4.237.000	Digital Dutch Finco BV 1.000% 15-Jan-2032	3.390.100	0,30	
1.888.000	Ecolab Inc 1.000% 15-Jan-2024	1.885.649	0,17	
736.000	Fidelity National Information Services Inc 1.000% 03-Dec-2028	665.393	0,06	
4.401.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	4.171.700	0,37	
8.835.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.867% 03-Aug-2027	9.085.030	0,82	
4.011.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 5.125% 20-Feb-2029	4.211.470	0,38	
2.000.000	Haleon Netherlands Capital BV 'EMTN' 1.750% 29-Mar-2030	1.847.590	0,17	
1.225.000	Haleon Netherlands Capital BV 'EMTN' 2.125% 29-Mar-2034	1.088.970	0,10	
290.000	Haleon Netherlands Capital BV 'EMTN' 2.125% 29-Mar-2034	258.664	0,02	
1.221.000	International Flavors & Fragrances Inc 1.800% 25-Sep-2026	1.161.834	0,10	
2.083.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.000% 15-Sep-2028	2.080.105	0,19	
2.070.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' 1.500% 27-Jan-2025	2.020.707	0,18	
3.503.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.389% 24-Feb-2028	3.195.551	0,29	
1.990.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.090% 11-Mar-2027	1.892.256	0,17	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
5.928.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 4.457% 13-Nov-2031	6.285.340	0,56
1.300.000	McDonald's Corp 1.600% 15-Mar-2031	1.172.295	0,11
6.590.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 15-Oct-2040	4.854.076	0,44
3.020.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039	2.314.412	0,21
5.362.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.950% 07-May-2032	5.097.493	0,46
2.682.000	Nasdaq Inc 4.500% 15-Feb-2032	2.883.217	0,26
1.925.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.500% 29-Mar-2035	1.672.297	0,15
2.700.000	Netflix Inc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2029	2.806.461	0,25
2.718.000	PepsiCo Inc 'EMTN' 0.500% 06-May-2028	2.477.268	0,22
1.243.000	Prologis Euro Finance LLC 1.000% 06-Feb-2035	931.583	0,08
3.197.000	Prologis Euro Finance LLC 4.625% 23-May-2033	3.420.406	0,31
1.476.000	Prologis Euro Finance LLC 'EMTN' 1.000% 08-Feb-2029	1.311.500	0,12
1.493.000	Prologis Euro Finance LLC 'EMTN' 4.250% 31-Jan-2043	1.516.410	0,14
2.700.000	Sanofi SA 1.250% 06-Apr-2029	2.519.221	0,23
8.700.000	Schneider Electric SE 'EMTN' 3.500% 12-Jun-2033	9.079.886	0,81
1.100.000	Stellantis NV 2.750% 15-May-2026	1.088.825	0,10
2.170.000	Stellantis NV 3.875% 05-Jan-2026	2.191.089	0,20
781.000	Stellantis NV 'EMTN' 0.625% 30-Mar-2027	720.469	0,06
2.076.000	Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033	1.682.972	0,15
6.892.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.250% 16-Jun-2031	7.160.788	0,64
3.595.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	3.803.870	0,34
5.068.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041	3.835.488	0,34
500.000	Thermo Fisher Scientific Inc 'EMTN' 1.875% 01-Oct-2049	359.925	0,03
3.531.000	Veralto Corp 'REGS' 4.150% 19-Sep-2031	3.691.643	0,33
3.862.000	Verizon Communications Inc 1.850% 18-May-2040	3.045.588	0,27
1.855.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	1.718.906	0,15
Gesamtanlagen in Anleihen		1.062.741.757	95,38
Total Return Swaps			
Europa - 1.759.489 (31. Dezember 2022: -)		1.759.489	0,16
90.000.000	iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index 20-Mar-2024	1.759.489	0,16
Total Return Swaps insgesamt		1.759.489	0,16
Credit Default Swaps - 2.030.204 (31. Dezember 2022: 678.462)			
(52.250.000)	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	1.015.102	0,09
(52.250.000)	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	1.015.102	0,09
Credit Default Swaps insgesamt		2.030.204	0,18
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert mögen EUR %
Offene Terminkontrakte - 42.156 (31. Dezember 2022: 3.176.525)			
212	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2024	25.293.720	42.156 0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			42.156 0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 381.116 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 508.510)			381.116 0,03
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			1.066.954.722 95,75

		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Bestände	Beschreibung		
Credit Default Swaps - (4.750.096)			
(31. Dezember 2022: -)			
22.750.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(441.982)	(0,04)
70.000.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(1.359.946)	(0,12)
10.450.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(203.020)	(0,02)
70.000.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(1.359.946)	(0,12)
17.800.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(345.815)	(0,03)
17.800.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(345.815)	(0,03)
35.700.000	iTraxx Europe Index Series 40 Version 1 1.000% 20-Dec-2028	(693.572)	(0,07)
Credit Default Swaps insgesamt		(4.750.096)	(0,43)

		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Bestände	Beschreibung			
Offene Terminkontrakte - (3.150.027)				
(31. Dezember 2022: (2.446.524))				
(522)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(71.722.800)	(2.029.049)	(0,18)
(77)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(10.924.760)	(850.453)	(0,08)
(432)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(46.031.760)	(53.018)	(0,00)
(30)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.198.774)	(144.770)	(0,01)
(33)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024	(3.237.959)	(72.737)	(0,01)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(3.150.027)	(0,28)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (26.854) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (68.756))			(26.854)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(7.926.977)	(0,71)
Nettoumlaufvermögen			55.232.287	4,96
Summe Nettovermögen			1.114.260.032	100,00
Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Goldman Sachs und Morgan Stanley. Der Kontrahent für Total Return Swaps ist Goldman Sachs. 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				94,29
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				0,00
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				0,37
Sonstiges Umlaufvermögen				5,34
Gesamtvermögen			100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund						
Euro	US-Dollar	3.539.751	3.772.000	10. Jan. 24	Morgan Stanley	135.674
Euro	US-Dollar	3.502.309	3.708.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	157.146
Euro	US-Dollar	2.077.797	2.231.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	66.775
Euro	US-Dollar	1.596.070	1.748.000	22. Feb. 24	Morgan Stanley	21.307
EUR						380.902
US-Dollar	Euro	2.958.000	2.694.786	10. Jan. 24	Barclays Bank PLC	(25.311)
Euro	Pfund Sterling	1.157.528	1.009.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(1.543)
EUR						(26.854)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	55	59	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Schweizer Franken	Euro	66	70	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	71	75	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	Euro	10.445	11.070	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	211
EUR						214
CHF						198

RESPONSIBLE HORIZONS EURO IMPACT BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Australien - 108.214			
(31. Dezember 2022: –)			
100.000	NBN Co Ltd 'GMTN' 4.375% 15-Mar-2033	108.214	0,31
Österreich - 501.471			
(31. Dezember 2022: 446.927)			
100.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	100.500	0,29
400.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 1.375% 17-Jun-2033	328.900	0,94
100.000	Verbund AG 0.900% 01-Apr-2041	72.071	0,20
Belgien - 676.365			
(31. Dezember 2022: 601.026)			
200.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 3.625% 18-Jan-2033	208.077	0,59
100.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 0.250% 02-Dec-2030	82.983	0,24
100.000	KBC Group NV 'EMTN' 4.375% 06-Dec-2031	105.533	0,30
300.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0.375% 16-Jun-2027	279.772	0,80
Dänemark - 622.544			
(31. Dezember 2022: 214.477)			
505.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 4.500% 09-Nov-2028	522.044	1,49
100.000	Orsted AS FRN 5.250% 08-Dec-3022	100.500	0,28
Finnland - 90.942			
(31. Dezember 2022: 85.208)			
100.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.625% 27-Jul-2027	90.942	0,26
Frankreich - 7.840.989			
(31. Dezember 2022: 5.182.022)			
200.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	204.591	0,58
100.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	102.215	0,29
200.000	AXA SA 'EMTN' FRN 1.375% 07-Oct-2041	166.077	0,47
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.000% 21-Nov-2029	311.928	0,89
400.000	Banque Stellantis France SACA 'EMTN' 3.875% 19-Jan-2026	402.938	1,15
700.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.375% 13-Jan-2029	727.024	2,07
300.000	BNP Paribas SA FRN 0.500% 04-Jun-2026	287.035	0,82
100.000	BPCE SA 'EMTN' FRN 5.750% 01-Jun-2033	106.350	0,30
200.000	CNP Assurances SACA FRN 2.000% 27-Jul-2050	174.040	0,50
400.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.125% 09-Dec-2027	355.204	1,01
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 4.375% 27-Nov-2033	105.225	0,30
100.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 4.250% 01-Dec-2032	105.735	0,30
200.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN 1.250% 11-Jun-2029	182.037	0,52
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	108.158	0,31
100.000	Engie SA 'EMTN' 3.500% 27-Sep-2029	101.928	0,29
100.000	Engie SA 'EMTN' 4.000% 11-Jan-2035	104.129	0,30
100.000	Engie SA 'EMTN' 4.500% 06-Sep-2042	107.892	0,31
600.000	Engie SA FRN (Perpetual) 1.500% 30-May-2028	529.324	1,51
150.000	Forvia SE 2.375% 15-Jun-2029	136.816	0,39
200.000	Gecina SA 2.000% 30-Jun-2032	186.806	0,53
200.000	Gecina SA 'EMTN' 0.875% 25-Jan-2033	166.513	0,47
200.000	ICADE 1.000% 19-Jan-2030	171.300	0,49
200.000	Klepierre SA 'EMTN' 0.625% 01-Jul-2030	167.171	0,48
100.000	La Banque Postale SA 'EMTN' 0.750% 23-Jun-2031	82.042	0,23
200.000	Orange SA 'EMTN' 2.375% 18-May-2032	192.956	0,55
100.000	Paprec Holding SA 'REGS' 6.500% 17-Nov-2027	107.296	0,31
419.000	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 14-Jun-2028	441.766	1,26
100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 3.500% 07-Dec-2031	103.758	0,30
100.000	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.500% 05-Jun-2027	95.974	0,27
200.000	Societe Generale SA 'EMTN' 4.125% 21-Nov-2028	207.177	0,59
200.000	Societe Generale SA FRN 0.875% 22-Sep-2028	181.996	0,52
100.000	Societe Generale SA FRN 4.750% 28-Sep-2029	104.642	0,30

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Frankreich Forts.			
200.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	187.113	0,53
100.000	Suez SACA 'EMTN' 4.500% 13-Nov-2033	107.496	0,31
400.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	443.318	1,26
300.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	275.164	0,78
200.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 4.125% 11-Dec-2030	206.118	0,59
100.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 1.940% 07-Jan-2030	93.737	0,27
Deutschland - 4.873.049			
(31. Dezember 2022: 2.790.347)			
100.000	Amprion GmbH 3.971% 22-Sep-2032	104.884	0,30
200.000	Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	211.050	0,60
800.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	693.451	1,98
200.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	192.083	0,55
100.000	Commerzbank AG FRN 3.000% 14-Sep-2027	98.065	0,28
200.000	Commerzbank AG FRN 5.250% 25-Mar-2029	211.000	0,60
500.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	470.788	1,34
27.000	E.ON SE 'EMTN' 0.875% 18-Oct-2034	21.830	0,06
100.000	E.ON SE 'EMTN' 0.875% 18-Oct-2034	80.852	0,23
207.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	187.521	0,53
196.000	E.ON SE 'EMTN' 3.875% 12-Jan-2035	204.387	0,58
300.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	253.112	0,72
200.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3.279% 05-Sep-2031	200.257	0,57
300.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	290.284	0,83
101.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 5.125% 05-Oct-2030	108.891	0,31
200.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.750% 30-Jun-2031	159.274	0,45
300.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.500% 30-May-2026	303.515	0,87
200.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.700% 30-May-2031	209.281	0,60
100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 1.250% 26-May-2041	83.580	0,24
100.000	Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	104.829	0,30
100.000	Sartorius Finance BV 4.875% 14-Sep-2035	105.816	0,30
600.000	Vonovia SE 'EMTN' 0.625% 24-Mar-2031	474.486	1,35
100.000	Vonovia SE 'EMTN' 4.750% 23-May-2027	103.813	0,30
Irland - 1.377.921			
(31. Dezember 2022: 1.131.241)			
250.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 0.500% 17-Nov-2027	229.535	0,66
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 5.250% 23-Oct-2031	108.130	0,31
450.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	418.728	1,19
185.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 5.000% 04-Jul-2031	198.276	0,57
250.000	ESB Finance DAC 'EMTN' 1.125% 11-Jun-2030	222.447	0,63
250.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.000% 22-Sep-2033	200.805	0,57
Italien - 1.977.485			
(31. Dezember 2022: 1.662.980)			
300.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.429% 14-Jul-2031	261.267	0,75
800.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 1.125% 16-Sep-2026	761.382	2,17
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	270.151	0,77
300.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' 1.000% 08-Sep-2027	276.672	0,79
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.750% 24-Jul-2032	81.997	0,23
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 3.875% 24-Jul-2033	103.374	0,30
250.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	222.642	0,63
Japan - 98.826			
(31. Dezember 2022: –)			
100.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	98.826	0,28

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände		Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Beschreibung			
Anleihen Forts.			
Luxemburg - 176.470			
(31. Dezember 2022: 110.440)		176.470	0,50
200.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	176.470	0,50
Niederlande - 3.206.272			
(31. Dezember 2022: 2.727.318)		3.206.272	9,14
400.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	340.904	0,97
150.000	Alliander NV 'EMTN' 0.375% 10-Jun-2030	129.249	0,37
119.000	ASML Holding NV 2.250% 17-May-2032	115.340	0,33
100.000	ASR Nederland NV 3.625% 12-Dec-2028	101.669	0,29
100.000	de Volksbank NV 4.875% 07-Mar-2030	104.520	0,30
100.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.375% 03-Mar-2028	87.157	0,25
100.000	de Volksbank NV FRN 2.375% 04-May-2027	96.650	0,27
400.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 0.875% 09-Jun-2032	360.400	1,03
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 23-May-2026	97.950	0,28
100.000	ING Groep NV FRN 4.125% 24-Aug-2033	100.750	0,29
100.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.500% 04-Apr-2028	102.361	0,29
100.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.500% 04-Apr-2028	102.221	0,29
200.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 07-Sep-2026	183.983	0,52
250.000	NN Group NV 'EMTN' FRN 5.250% 01-Mar-2043	256.875	0,73
125.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.750% 28-Oct-2042	147.314	0,42
600.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 1.500% 24-May-2027	566.859	1,62
350.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	312.070	0,89
Norwegen - 834.725			
(31. Dezember 2022: 261.525)		834.725	2,38
200.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Jan-2028	183.800	0,52
100.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.000% 14-Mar-2029	103.425	0,30
100.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.500% 19-Jul-2028	103.491	0,30
150.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.500% 19-Jul-2028	155.325	0,44
134.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.625% 01-Nov-2029	141.404	0,40
146.000	Statkraft AS 'EMTN' 3.125% 13-Dec-2031	147.280	0,42
Polen - 211.050			
(31. Dezember 2022: -)		211.050	0,60
200.000	mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	211.050	0,60
Portugal - 502.533			
(31. Dezember 2022: 363.209)		502.533	1,43
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN' 3.875% 26-Jun-2028	103.023	0,29
100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 1.875% 21-Sep-2029	93.570	0,27
100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 3.875% 11-Mar-2030	103.808	0,29
194.000	EDP Servicios Financieros Espana SA 'EMTN' 4.125% 04-Apr-2029	202.132	0,58
Republik Korea - 186.237			
(31. Dezember 2022: -)		186.237	0,53
200.000	LG Energy Solution Ltd 'REGS' 5.750% 25-Sep-2028	186.237	0,53
Rumänien - 269.641			
(31. Dezember 2022: -)		269.641	0,77
200.000	NE Property BV 3.375% 14-Jul-2027	188.961	0,54
100.000	NE Property BV 'EMTN' 2.000% 20-Jan-2030	80.680	0,23
Spanien - 4.792.454			
(31. Dezember 2022: 3.935.703)		4.792.454	13,66
100.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	91.534	0,26
300.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	311.466	0,89
300.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.000% 21-Jun-2026	285.236	0,81
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	192.868	0,55
200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	210.104	0,60
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 8.000% 22-Sep-2026	104.284	0,30
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	98.133	0,28
Spanien Forts.			
200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	210.922	0,60
300.000	Banco de Sabadell SA FRN 1.125% 11-Mar-2027	285.096	0,81
300.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	266.244	0,76
200.000	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	182.354	0,52
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.500% 09-Feb-2029	176.882	0,50
400.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.625% 21-Jan-2028	369.304	1,05
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031	186.394	0,53
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.375% 14-Nov-2030	217.202	0,62
200.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.875% 25-Apr-2028	202.200	0,58
300.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Aug-2027	268.041	0,76
400.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.825% 09-Aug-2029	341.225	0,97
200.000	Kutxabank SA FRN 4.750% 15-Jun-2027	204.094	0,58
200.000	Merlin Properties Socimi SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	170.539	0,49
100.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	100.143	0,29
300.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 7.250% 15-Nov-2027	318.189	0,91
Schweden - 497.645			
(31. Dezember 2022: 280.349)		497.645	1,42
100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.000% 09-Nov-2026	101.793	0,29
200.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'EMTN' 4.375% 06-Nov-2028	207.809	0,59
200.000	Vattenfall AB 'EMTN' 0.500% 24-Jun-2026	188.043	0,54
Schweiz - 852.713			
(31. Dezember 2022: 443.568)		852.713	2,43
500.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.450% 19-May-2025	481.975	1,37
400.000	UBS AG/London 'EMTN' 0.010% 29-Jun-2026	370.738	1,06
Vereinigtes Königreich - 2.419.729			
(31. Dezember 2022: 1.273.403)		2.419.729	6,90
100.000	AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	105.319	0,30
143.000	DS Smith Plc 'EMTN' 4.500% 27-Jul-2030	149.502	0,43
100.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 3.500% 17-Jul-2031	102.567	0,29
100.000	National Grid Plc 'EMTN' 3.875% 16-Jan-2029	103.076	0,29
256.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 4.699% 14-Mar-2028	264.116	0,75
200.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 4.699% 14-Mar-2028	206.122	0,59
300.000	Segro Capital Sarl 'EMTN' 1.250% 23-Mar-2026	286.729	0,82
200.000	Segro Capital Sarl 'EMTN' 1.250% 23-Mar-2026	191.246	0,55
300.000	SSE Plc 'EMTN' 1.375% 04-Sep-2027	283.919	0,81
100.000	SSE Plc 'EMTN' 2.875% 01-Aug-2029	99.087	0,28
138.000	SSE Plc 'EMTN' 4.000% 05-Sep-2031	145.084	0,41
400.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	379.860	1,08
100.000	Yorkshire Building Society FRN 3.511% 11-Oct-2030	103.102	0,30
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.225.706			
(31. Dezember 2022: 2.440.408)		2.225.706	6,34
337.000	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	342.399	0,98
200.000	Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.300% 10-Nov-2029	175.075	0,50
100.000	Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	90.607	0,26
500.000	Digital Intrepid Holding BV 1.375% 18-Jul-2032	408.980	1,16
100.000	Ford Motor Co 6.100% 19-Aug-2032	91.342	0,26
400.000	JPMorgan Chase & Co FRN 0.768% 09-Aug-2025	350.107	1,00
164.000	JPMorgan Chase & Co FRN 6.070% 22-Oct-2027	152.339	0,43
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 15-Oct-2028	88.911	0,25
100.000	Roche Finance Europe BV 3.204% 27-Aug-2029	102.706	0,29

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Bestände		Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Anleihen Forts.					
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.					
400.000	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030		423.240	1,21	
Gesamtanlagen in Anleihen			34.342.981	97,89	
Bestände		Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 16.433 (31. Dezember 2022: 98.735)					
10	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2024		1.065.550	6.592	0,02
2	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2024		213.252	9.841	0,03
Offene Terminkontrakte insgesamt			16.433	0,05	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 37.745 (siehe unten) (31. Dezember 2022: 54.623)				37.745	0,11
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			34.397.159	98,05	
Bestände		Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (76.772) (31. Dezember 2022: (37.543))					
(12)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2024		(1.431.720)	(16.383)	(0,05)
(7)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2024		(961.800)	(26.695)	(0,07)
(1)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2024		(141.880)	(11.041)	(0,03)
(6)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024		(611.487)	(20.449)	(0,06)
(1)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2024		(98.120)	(2.204)	(0,01)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(76.772)	(0,22)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (2.165) (siehe unten) (31. Dezember 2022: (1.276))				(2.165)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(78.937)	(0,23)	
Nettoumlaufvermögen			954.600	2,71	
Summe Nettovermögen			35.272.822	100,00	
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				97,08	
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente				0,05	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)				0,11	
Sonstiges Umlaufvermögen				2,76	
Gesamtvermögen			100,00		

Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Kontrahent		
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund						
Euro	US-Dollar	281.561	300.000	10. Jan. 24	Morgan Stanley	10.823
Euro	US-Dollar	284.355	301.000	18. Jan. 24	Citigroup Global Markets Limited	12.808
Euro	US-Dollar	30.206	32.000	18. Jan. 24	Morgan Stanley	1.338
Euro	US-Dollar	270.165	290.000	7. Feb. 24	Morgan Stanley	8.760
Euro	US-Dollar	226.356	248.000	22. Feb. 24	Barclays Bank PLC	2.935
EUR						36.664
US-Dollar	Euro	97.000	88.291	18. Jan. 24	Morgan Stanley	(783)
Euro	Pfund Sterling	94.071	82.000	16. Feb. 24	Morgan Stanley	(125)
EUR						(908)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	Euro	64	67	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	Euro	88	93	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Schweizer Franken	Euro	10.424	11.047	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	211
EUR						214
CHF						198
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Euro	666	59	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Norwegische Krone	Euro	881	77	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Norwegische Krone	Euro	104.593	8.871	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	431
EUR						433
NOK						4.868
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse NOK X (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Euro	673	60	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
Norwegische Krone	Euro	885	77	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	2
Norwegische Krone	Euro	104.658	8.877	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	432
EUR						434
NOK						4.879
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	62	72	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
EUR						–
GBP						–
Pfund Sterling	Euro	85	98	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	9.455	11.034	12. Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(158)
EUR						(159)
GBP						(138)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2023

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	62	72	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
					EUR	–
					GBP	–
Pfund Sterling	Euro	84	98	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	9.442	11.018	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(158)
					EUR	(159)
					GBP	(138)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	Euro	63	72	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
					EUR	–
					GBP	–
Pfund Sterling	Euro	85	98	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	9.476	11.058	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(159)
					EUR	(160)
					GBP	(139)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	64	58	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	88	80	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	9.576	8.899	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(258)
					EUR	(260)
					USD	(288)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	88	80	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
					EUR	–
					USD	–
US-Dollar	Euro	64	58	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	9.564	8.888	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(258)
					EUR	(259)
					USD	(287)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD X (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	88	80	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	–
					EUR	–
					USD	–
US-Dollar	Euro	64	59	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(1)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD X (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	9.598	8.920	12.Jan. 24	The Bank of New York Mellon	(259)
					EUR	(260)
					USD	(288)

GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*
	Erläuterungen	EUR	EUR	GBP
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		172.880	9	882.549
Dividendenerträge		–	–	3.371.075
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	58.914	–	5.931
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		19.945.726	15.019	(14.208.770)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		12.639.346	86.640	11.038.023
Gesamtertrag		32.816.866	101.668	1.088.808
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	634.314	6.170	845.445
Performancegebühr	3	68.790	–	–
Verwahrstellengebühr	5	190.406	5.031	58.371
Betriebliche Aufwendungen	7	206.971	1.724	135.908
Dividendenaufwand		–	–	3.134.070
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	736.850
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	(4.904)	(1.206)
Gesamtaufwendungen		1.100.481	8.021	4.909.438
Nettoerträge/(-aufwendungen)		31.716.385	93.647	(3.820.630)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		6.967	–	26.696
Ausschüttungen		5.932.705	–	69.498
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		25.776.713	93.647	(3.916.824)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(72.632)	(3.518)	(164.994)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		25.704.081	90.129	(4.081.818)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Außer bei den im Geschäftsjahr geschlossenen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund
EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
19.696	16	59.084	30.730	12.210	71.401	430.137	43.402	12.896
974.321	1.076.793	577.666	1.029.432	1.711.641	–	6.585.751	–	–
3.938	267	1.030	–	–	–	10.286	19.642	1.152
(334.271)	(18.320)	(4.980.801)	(2.525.061)	(5.647.612)	2.887.154	81.878.044	7.355.663	1.874.635
5.193.387	2.033.824	5.699.647	11.576.963	12.688.134	278.016	14.219.943	24.419.827	5.558.668
5.857.071	3.092.580	1.356.626	10.112.064	8.764.373	3.236.571	103.124.161	31.838.534	7.447.351
217.097	202.787	724.520	608.664	569.887	139.816	1.705.170	240.334	26.534
–	–	–	–	–	–	–	–	–
25.562	49.742	53.921	8.293	75.690	27.426	143.957	79.613	85.559
49.551	39.530	74.356	60.728	30.660	37.607	525.597	240.229	58.774
779.676	–	–	–	–	–	–	–	–
2.324.119	–	–	–	–	438.661	–	–	–
(1.811)	(67.454)	–	(15.661)	–	(40.753)	(254.682)	(129.733)	(103.586)
3.394.194	224.605	852.797	662.024	676.237	602.757	2.120.042	430.443	67.281
2.462.877	2.867.975	503.829	9.450.040	8.088.136	2.633.814	101.004.119	31.408.091	7.380.070
2.174	524	63	–	4.822	1.277	2.962	628	58
–	942.945	–	130.538	713.469	423.349	3.953.750	13.191.897	2.625.494
2.460.703	1.924.506	503.766	9.319.502	7.369.845	2.209.188	97.047.407	18.215.566	4.754.518
(8.263)	(134.643)	(395.085)	(204.707)	(355.321)	–	(1.725.401)	(6.998)	(4.869)
2.452.440	1.789.863	108.681	9.114.795	7.014.524	2.209.188	95.322.006	18.208.568	4.749.649

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (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
	Erläuterungen	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		208.069	215.334	139.673
Dividendenerträge		–	–	382.731
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	255.739	144.033
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(6.247.926)	71.078.355	(12.348.868)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		119.580.527	106.504.079	42.961.076
Gesamtertrag		113.540.670	178.053.507	31.278.645
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	966.954	1.799.774	1.648.909
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	121.534	204.611	89.891
Betriebliche Aufwendungen	7	899.761	1.467.730	296.601
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(318.289)	(882.847)	–
Gesamtaufwendungen		1.669.960	2.589.268	2.035.401
Nettoerträge/(-aufwendungen)		111.870.710	175.464.239	29.243.244
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		64	963	12.432
Ausschüttungen		67.974.760	99.550.423	11.614.987
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		43.895.886	75.912.853	17.615.825
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		187.670	(55.929)	13.469
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		44.083.556	75.856.924	17.629.294

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (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 Floating Rate Credit Fund*	BNY Mellon Food Innovation Fund*	BNY Mellon Future Earth Fund*
USD	USD	USD	USD	EUR	EUR	EUR	USD	USD
16.679	13.771	8.653	24.589	16.914	5.308	2.508	2.940	1.750
–	–	–	77.306	143.692	–	–	31.416	26.798
5.556	3.526	6.410	8.313	29.204	11.000	–	–	–
(1.310.492)	(1.265.338)	(150.145)	(1.775.734)	(3.657.313)	(495.110)	1.161.716	(396.292)	(481.295)
3.939.652	5.367.858	3.405.799	7.377.975	18.997.442	5.660.708	665.400	159.883	237.170
2.651.395	4.119.817	3.270.717	5.712.449	15.529.939	5.181.906	1.829.624	(202.053)	(215.577)
257.915	357.971	3.533	143.167	1.296.373	28.698	77.459	11.413	11.277
–	–	–	–	–	–	–	–	–
14.765	39.531	48.358	31.361	46.081	20.353	9.968	10.467	9.568
24.653	22.976	17.478	33.652	149.807	31.967	18.720	9.580	9.652
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(3.900)	–	(17.879)	–	–	(10.582)	(22.809)	(21.963)
297.333	416.578	69.369	190.301	1.492.261	81.018	95.565	8.651	8.534
2.354.062	3.703.239	3.201.348	5.522.148	14.037.678	5.100.888	1.734.059	(210.704)	(224.111)
184	3.938	512	3.534	3.452	–	35	–	22
174.056	121.599	1.549.603	2.478.755	964.335	1.040.415	496.904	13.530	8.229
2.179.822	3.577.702	1.651.233	3.039.859	13.069.891	4.060.473	1.237.120	(224.234)	(232.362)
(52)	100.535	(28.961)	(38.628)	(20.105)	(6.939)	(3.450)	(7.346)	(3.768)
2.179.770	3.678.237	1.622.272	3.001.231	13.049.786	4.053.534	1.233.670	(231.580)	(236.130)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		2.622	285.090	138.256
Dividendenerträge		25.496	–	1.507.196
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	21.779	21.952
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(42.552)	(16.190.015)	1.983.953
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(56.057)	32.227.624	63.073.360
Gesamtertrag		(70.491)	16.344.478	66.724.717
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	12.762	2.722.229	626.855
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	11.886	172.004	182.931
Betriebliche Aufwendungen	7	12.538	563.148	434.904
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(26.883)	–	(95.903)
Gesamtaufwendungen		10.303	3.457.381	1.148.787
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(80.794)	12.887.097	65.575.930
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		–	14.583	4.431
Ausschüttungen		10.607	5.518.559	11.124.783
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(91.401)	7.353.955	54.446.716
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(4.613)	(83.618)	(193.210)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(96.014)	7.270.337	54.253.506

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities 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 Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	GBP
125.797	54.398	626.265	25.589	15.877	17.517	26.360	175.598	53.063
816.944	523.813	18.917.723	93.199	7.178.931	724.277	519.674	26.358.051	758.701
32.765	430	94.043	70.079	28.785	2.588	1.448	160.897	7.632
(17.899.578)	(4.859.555)	31.599.091	2.004.536	(4.079.567)	2.154.606	500.523	(13.764.348)	673.611
20.431.035	5.783.587	8.907.817	13.171.216	9.035.772	7.969.116	4.833.239	(4.748.648)	(948.609)
3.506.963	1.502.673	60.144.939	15.364.619	12.179.798	10.868.104	5.881.244	8.181.550	544.398
1.397.929	332.787	5.975.523	831.650	876.796	475.551	541.451	12.006.090	220.282
–	–	–	–	–	–	–	–	–
120.150	40.658	158.943	39.686	31.431	16.219	18.546	491.474	75.686
307.135	63.260	517.290	109.574	145.620	73.920	45.332	1.458.734	63.383
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(32.109)	–	–	(31.859)	(5.131)	–	–	–
1.825.214	404.596	6.651.756	980.910	1.021.988	560.559	605.329	13.956.298	359.351
1.681.749	1.098.077	53.493.183	14.383.709	11.157.810	10.307.545	5.275.915	(5.774.748)	185.047
6.629	1	774	426	1.273	2	18	101.437	13.012
10.174.898	22.087	12.840.811	1.957.586	6.377.093	131.217	5	10.835.876	764.190
(8.499.778)	1.075.989	40.651.598	12.425.697	4.779.444	10.176.326	5.275.892	(16.712.061)	(592.155)
53.789	(134.884)	(3.229.689)	(30.185)	(744.074)	(150.484)	(55.634)	(1.871.728)	(57.234)
(8.445.989)	941.105	37.421.909	12.395.512	4.035.370	10.025.842	5.220.258	(18.583.789)	(649.389)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Unconstrained Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		593.889	267.927	51.430
Dividendenerträge		4.428.810	1.094.311	391.600
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	37.437	86.180	5.206
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(19.983.683)	789.213	107.436
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten		23.178.069	95.488.003	3.382.105
Gesamtertrag		8.254.522	97.725.634	3.937.777
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	2.502.979	3.436.560	49
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	171.269	133.435	11.406
Betriebliche Aufwendungen	7	309.174	737.650	23.572
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	(8.663)	(7.646)
Gesamtaufwendungen		2.983.422	4.298.982	27.381
Nettoerträge/(-aufwendungen)		5.271.100	93.426.652	3.910.396
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		10.578	7.813	–
Ausschüttungen		1.453.405	35.106.135	527.299
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		3.807.117	58.312.704	3.383.097
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(345.475)	(5.107)	(43.947)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.461.642	58.307.597	3.339.150

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*
JPY	EUR	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	USD
7.777.637	4.655	249.989	207.821	7.470	8.424	73.202	5	394.975
353.064.400	58.766	17.541.665	5.322.965	1.493.831	98.531	–	182.996	6.337.714
22.669.754	–	–	–	35.367	–	–	–	12.395
927.320.226	(70.112)	32.071.244	(49.676.670)	1.401.162	(1.065.637)	16.134.273	(41.035)	10.752.379
(1.294.768.869)	892.644	183.192.869	130.252.007	5.290.674	(128.684)	(6.713.496)	423.456	56.101.915
16.063.148	885.953	233.055.767	86.106.123	8.228.504	(1.087.366)	9.493.979	565.422	73.599.378
156.947.102	66.106	15.359.794	4.870.480	575.644	149.409	1.411.300	81.120	3.686.712
–	–	107.097	–	–	–	–	–	–
7.469.170	4.179	177.327	99.739	11.071	15.812	145.487	880	121.874
23.151.136	12.874	1.345.987	563.926	41.964	37.330	352.968	35.226	490.348
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(159.471)	(4.851)	–	(65.424)	–	(23.822)	(127.036)	(27.271)	–
187.407.937	78.308	16.990.205	5.468.721	628.679	178.729	1.782.719	89.955	4.298.934
(171.344.789)	807.645	216.065.562	80.637.402	7.599.825	(1.266.095)	7.711.260	475.467	69.300.444
1.990.281	3.981	4.012	1.767	590	4	37.529	–	1.537
69.161.704	–	1.601.881	645.555	60.789	56	13.651.985	–	2.426.442
(242.496.774)	803.664	214.459.669	79.990.080	7.538.446	(1.266.155)	(5.978.254)	475.467	66.872.465
(52.959.661)	(5.802)	(3.759.842)	(736.217)	(68.044)	(23.770)	(163.978)	(87.766)	(1.052.240)
(295.456.435)	797.862	210.699.827	79.253.863	7.470.402	(1.289.925)	(6.142.232)	387.701	65.820.225

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
	Erläuterungen	EUR	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		9.033	59.913	682.217
Dividendenerträge		909.299	547	9.026.687
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	–	30.574
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(6.418.891)	6.226.766	15.538.141
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		3.096.182	8.028.294	11.729.635
Gesamtertrag		(2.404.377)	14.315.520	37.007.254
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	494.222	558.253	2.071.004
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	104.291	89.763	78.926
Betriebliche Aufwendungen	7	77.946	99.110	392.367
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(90.284)	–	(2.779)
Gesamtaufwendungen		586.175	747.126	2.539.518
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(2.990.552)	13.568.394	34.467.736
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		4.027	3.871	1
Ausschüttungen		755.336	4.351.166	7.394.165
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(3.749.915)	9.213.357	27.073.570
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(81.261)	(20.170)	(2.208.714)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(3.831.176)	9.193.187	24.864.856

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2023 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Absolute Return Credit Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	Gesamt 31. Dezember 2023*
USD	USD	EUR	EUR	USD
233.204	23.464	117.360	4.920	7.281.014
–	–	57.823	–	127.599.280
–	–	–	–	1.403.889
4.391.744	2.392.472	(16.118.606)	(40.862)	111.485.551
74.802.400	360.160	109.027.771	2.692.315	1.301.123.677
79.427.348	2.776.096	93.084.348	2.656.373	1.548.893.411
3.612.327	176.011	3.377.026	41.051	85.292.039
–	–	–	–	190.212
107.698	21.193	147.136	(5.529)	4.443.386
1.061.780	58.315	1.037.579	29.703	15.552.846
–	–	–	–	4.740.999
–	–	–	–	3.868.478
(11.473)	(45.954)	(261.859)	(16.981)	(2.827.631)
4.770.332	209.565	4.299.882	48.244	111.260.329
74.657.016	2.566.531	88.784.466	2.608.129	1.437.633.082
740	21	2.824	–	330.665
34.444.599	1.204.936	19.110.650	545.120	402.028.648
40.211.677	1.361.574	69.670.992	2.063.009	1.035.273.769
–	(18.581)	(88.706)	(3.044)	(19.087.560)
40.211.677	1.342.993	69.582.286	2.059.965	1.016.186.209

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		17.780	11.180	8.664
Dividendenerträge		52.805	3.626.883	711.876
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	37.216	5.070	12.425
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		16.839.054	2.838.384	3.684.663
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(20.831.538)	6.261.151	(5.689.477)
Gesamtertrag		(3.884.683)	12.742.668	(1.271.849)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	876.640	1.319.661	378.825
Performancegebühr	3	17.648	4.543	–
Verwahrstellengebühr	5	222.649	41.223	31.544
Betriebliche Aufwendungen	7	233.934	164.658	81.666
Dividendenaufwand		–	3.066.666	874.161
Finanzierungskosten für Swaps		(4.908)	733.668	1.648.617
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	–
Gesamtaufwendungen		1.345.963	5.330.419	3.014.813
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(5.230.646)	7.412.249	(4.286.662)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		187.091	3.152	18.305
Ausschüttungen		2.551.348	–	–
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(7.969.085)	7.409.097	(4.304.967)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(115.658)	(156.561)	(1.482)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(8.084.743)	7.252.536	(4.306.449)

Außer bei den im Berichtszeitraum geschlossenen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 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
5.812	20.530	8.598	483	15.288	186.367	11.298	1.293	48.485
708.643	507.053	1.033.835	4.014.434	–	8.602.612	–	–	–
–	162	101.302	–	–	12.654	18.608	308	149.252
179.982	(3.570.073)	(38.533.657)	(1.714.501)	(464.012)	(20.919.700)	(14.285.516)	(1.092.786)	(141.469.209)
(2.612.263)	(9.130.851)	(6.849.584)	(1.863.131)	(756.128)	(144.185.322)	(25.475.613)	(3.989.017)	(168.127.676)
(1.717.826)	(12.173.179)	(44.239.506)	437.285	(1.204.852)	(156.303.389)	(39.731.223)	(5.080.202)	(309.399.148)
129.515	847.889	767.929	704.404	126.179	2.071.677	213.035	16.825	672.152
–	–	–	–	–	–	–	–	–
39.194	79.579	35.188	121.485	25.816	135.341	71.653	27.017	176.926
24.122	79.685	64.853	51.315	31.110	592.959	189.130	39.189	830.722
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	56.704	–	–	–	–
(48.478)	–	(27.763)	–	(33.978)	(171.999)	(95.929)	(43.205)	(167.874)
144.353	1.007.153	840.207	877.204	205.831	2.627.978	377.889	39.826	1.511.926
(1.862.179)	(13.180.332)	(45.079.713)	(439.919)	(1.410.683)	(158.931.367)	(40.109.112)	(5.120.028)	(310.911.074)
10	222	2.619	3.508	1.221	1.634	1.657	66	4
581.672	–	75.950	805.063	44.972	2.708.181	8.970.624	624.371	64.425.848
(2.443.861)	(13.180.554)	(45.158.282)	(1.248.490)	(1.456.876)	(161.641.182)	(49.081.393)	(5.744.465)	(375.336.926)
(67.234)	255.706	(231.650)	(619.696)	–	(2.397.411)	(11.109)	(4.187)	(34.346)
(2.511.095)	(12.924.848)	(45.389.932)	(1.868.186)	(1.456.876)	(164.038.593)	(49.092.502)	(5.748.652)	(375.371.272)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		38.414	30.848	3.623
Dividendenerträge		585	286.394	–
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	188.232	252.675	9.422
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		14.127	(67.255.831)	(330.702)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(113.282.976)	(22.321.787)	(5.072.893)
Gesamtertrag		(113.041.618)	(89.007.701)	(5.390.550)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	1.354.793	2.077.353	276.666
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	157.622	109.798	13.504
Betriebliche Aufwendungen	7	1.018.234	341.729	27.196
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(576.677)	–	–
Gesamtaufwendungen		1.953.972	2.528.880	317.366
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(114.995.590)	(91.536.581)	(5.707.916)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		8.773	18.714	100
Ausschüttungen		52.488.461	13.129.715	162.685
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(167.492.824)	(104.685.010)	(5.870.701)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(127.748)	22.555	3.109
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(167.620.572)	(104.662.455)	(5.867.592)

^ Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

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 Food Innovation Fund ^c	BNY Mellon Future Earth Fund	BNY Mellon Future Life Fund	BNY Mellon Global Bond Fund
USD	USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
19.302	2.715	5.848	2.993	69	719	183	487	106.946
–	–	36.815	129.841	38	45.970	29.416	34.666	–
13.389	4.978	15.938	46.593	8.746	–	–	–	24.225
(22.990.961)	(1.109.772)	(24.612.800)	(16.701.908)	(2.745.558)	(30.326)	(109.864)	14.660	(9.438.120)
8.106.535	(2.995.418)	(1.706.969)	(22.368.806)	(4.897.838)	(371.514)	(379.427)	(274.847)	(57.419.783)
(14.851.735)	(4.097.497)	(26.261.168)	(38.891.287)	(7.634.543)	(355.151)	(459.692)	(225.034)	(66.726.732)
708.048	3.380	299.308	1.578.407	30.661	15.643	13.731	14.415	2.246.996
–	–	–	–	–	–	–	–	–
124.976	38.203	85.433	72.461	15.220	9.592	11.142	10.947	132.877
90.108	17.456	68.049	179.404	26.546	19.603	18.953	14.357	416.410
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	(48.329)	–	–	(26.053)	(27.791)	(22.623)	–
923.132	59.039	404.461	1.830.272	72.427	18.785	16.035	17.096	2.796.283
(15.774.867)	(4.156.536)	(26.665.629)	(40.721.559)	(7.706.970)	(373.936)	(475.727)	(242.130)	(69.523.015)
3.676	1.227	6.988	23.471	7.132	–	17	2	2.020
422.256	1.432.316	4.673.226	604.126	488.363	12.874	10.694	12.645	1.310.184
(16.200.799)	(5.590.079)	(31.345.843)	(41.349.156)	(8.202.465)	(386.810)	(486.438)	(254.777)	(70.835.219)
149.774	(33.088)	(133.663)	(7.130)	(5.566)	(10.362)	(5.770)	(7.378)	(270)
(16.051.025)	(5.623.167)	(31.479.506)	(41.356.286)	(8.208.031)	(397.172)	(492.208)	(262.155)	(70.835.489)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		41.632	209.294	15.518
Dividendenerträge		141.741	604.970	485.948
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	67.595	50.258	194
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(53.264.738)	(2.322.401)	(5.647.314)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(26.076.810)	(34.905.070)	(7.165.699)
Gesamtertrag		(79.090.580)	(36.362.949)	(12.311.353)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	177.568	2.170.131	380.556
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	197.022	127.973	106.776
Betriebliche Aufwendungen	7	226.266	401.174	81.637
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(39.148)	–	(65.118)
Gesamtaufwendungen		561.708	2.699.278	503.851
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(79.652.288)	(39.062.227)	(12.815.204)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		17.208	144.753	164
Ausschüttungen		7.266.581	7.173.649	–
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(86.936.077)	(46.380.629)	(12.815.368)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		21.327	(1.781)	122.578
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(86.914.750)	(46.382.410)	(12.692.790)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (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 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	USD	USD	EUR	GBP	USD	USD
179.944	44.566	15.152	4.184	9.810	54.477	23.754	219.939	48.504
15.350.628	–	13.523.797	735.719	497.099	39.560.328	918.517	5.569.318	469.784
38.711	74.045	60.867	3.474	922	145.956	5.045	3.080	658.107
27.414.946	(11.607.539)	(15.836.481)	(1.324.025)	1.441.620	21.121.185	(504.658)	29.491.840	18.233.708
(49.532.296)	(10.561.057)	(30.539.445)	(14.024.929)	(9.546.537)	(358.154.624)	(4.973.903)	(69.544.393)	(89.001.608)
(6.548.067)	(22.049.985)	(32.776.110)	(14.605.577)	(7.597.086)	(297.272.678)	(4.531.245)	(34.260.216)	(69.591.505)
5.136.002	984.062	1.704.405	442.041	571.080	19.625.852	262.970	3.412.822	2.786.708
–	–	–	–	–	–	–	–	–
111.569	41.770	71.378	14.770	33.234	505.835	54.426	134.462	151.898
488.225	131.923	245.994	62.776	44.942	1.848.561	71.540	378.747	584.760
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	(33.652)	–	–	–	–	–	(20.291)
5.735.796	1.157.755	1.988.125	519.587	649.256	21.980.248	388.936	3.926.031	3.503.075
(12.283.863)	(23.207.740)	(34.764.235)	(15.125.164)	(8.246.342)	(319.252.926)	(4.920.181)	(38.186.247)	(73.094.580)
3.522	6.964	4.197	28	17	513.670	1.597	61.170	58.195
8.189.806	3.328.191	12.847.158	49.723	17	12.235.817	761.835	908.426	32.090.809
(20.477.191)	(26.542.895)	(47.615.590)	(15.174.915)	(8.246.376)	(332.002.413)	(5.683.613)	(39.155.843)	(105.243.584)
(2.975.617)	(25.880)	(1.449.323)	(129.372)	(85.363)	(3.500.955)	(88.032)	(537.474)	84.486
(23.452.808)	(26.568.775)	(49.064.913)	(15.304.287)	(8.331.739)	(335.503.368)	(5.771.645)	(39.693.317)	(105.159.098)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
	Erläuterungen	USD	JPY	EUR
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		16.616	604.624	95.077
Dividendenerträge		416.517	344.168.852	18.413.833
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	1.727	18.804.550	59.187
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(619.122)	2.807.314.650	107.438.959
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(6.450.810)	(1.524.576.860)	(332.346.437)
Gesamtertrag		(6.635.072)	1.646.315.816	(206.339.381)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	48	176.503.758	14.525.516
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	16.930	8.677.133	193.242
Betriebliche Aufwendungen	7	21.182	22.543.404	1.078.446
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(6.242)	–	–
Gesamtaufwendungen		31.918	207.724.295	15.797.204
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(6.666.990)	1.438.591.521	(222.136.585)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		3	3.400.725	7.879
Ausschüttungen		445.296	36.287.483	951.728
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(7.112.289)	1.398.903.313	(223.096.192)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(54.792)	(51.625.328)	(3.721.193)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.167.081)	1.347.277.985	(226.817.385)

↯ Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund ⁶	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	USD	USD
46.897	158	1.420	2.615	120.937	1.985	13.042	129.081	67.960
6.536.182	1.885.519	52.574	–	7.709.591	1.399.172	–	9.704.397	–
28.803	46.919	–	–	15.519	–	–	10.988	–
(32.571.142)	1.270.136	(2.107.629)	(11.765.702)	33.001.110	(4.706.225)	(5.728.379)	33.337.735	(38.079.093)
(291.510.168)	(12.852.215)	395.441	(9.378.328)	(137.799.722)	(9.043.436)	(5.148.088)	(27.866.347)	(142.648.984)
(317.469.428)	(9.649.483)	(1.658.194)	(21.141.415)	(96.952.565)	(12.348.504)	(10.863.425)	15.315.854	(180.660.117)
6.097.139	716.450	85.559	1.086.777	3.671.506	751.423	527.680	2.159.971	3.665.103
–	–	–	–	–	–	–	–	–
167.076	30.370	16.913	130.994	118.938	90.410	66.827	63.842	111.534
649.545	48.686	15.199	254.648	458.136	89.251	91.521	354.585	938.149
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(63.374)	–	(16.452)	(75.165)	–	(45.177)	–	–	–
6.850.386	795.506	101.219	1.397.254	4.248.580	885.907	686.028	2.578.398	4.714.786
(324.319.814)	(10.444.989)	(1.759.413)	(22.538.669)	(101.201.145)	(13.234.411)	(11.549.453)	12.737.456	(185.374.903)
15.543	5.496	3	128.780	1.069	25.488	11.666	7.978	7.135
137.460	151.033	–	7.248.159	1.914.041	557.952	1.246.684	6.917.008	28.760.058
(324.472.817)	(10.601.518)	(1.759.416)	(29.915.608)	(103.116.255)	(13.817.851)	(12.807.803)	5.812.470	(214.142.096)
(1.243.731)	(129.986)	(12.631)	10.991	(1.325.990)	(132.465)	(22.867)	(2.362.623)	–
(325.716.548)	(10.731.504)	(1.772.047)	(29.904.617)	(104.442.245)	(13.950.316)	(12.830.670)	3.449.847	(214.142.096)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2022^
	Erläuterungen	EUR	EUR	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		4.095	50	1.938.492
Dividendenerträge		–	–	150.860.643
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	–	–	2.338.169
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(18.123.982)	(791.704)	(250.095.106)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(118.006.535)	(3.273.647)	(2.464.570.511)
Gesamtertrag		(136.126.422)	(4.065.301)	(2.559.528.313)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	3.165.201	39.453	94.932.927
Performancegebühr	3	–	–	24.214
Verwahrstellengebühr	5	151.068	15.945	4.703.958
Betriebliche Aufwendungen	7	818.710	30.635	14.524.084
Dividendenaufwand		–	–	4.714.511
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	2.696.141
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(111.496)	(22.955)	(1.827.533)
Gesamtaufwendungen		4.023.483	63.078	119.768.302
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(140.149.905)	(4.128.379)	(2.679.296.615)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		144.116	4.310	1.546.908
Ausschüttungen		5.523.045	151.076	296.483.900
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(145.817.066)	(4.283.765)	(2.977.327.423)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(118.848)	(3.488)	(22.092.567)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(145.935.914)	(4.287.253)	(2.999.419.990)

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2022 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.

BILANZ

Zum 31. Dezember 2023

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund
	Erläuterungen	EUR	EUR	GBP	EUR
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	273.513.435	24.665.784	–	73.010.962
Barmittel und Bargegenwerte	9	16.001.080	430.639	360.415	538.131
Forderungen aus Erträgen		4.624.922	153.416	–	356.310
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	4.904	1.206	30
Margen auf Derivatkontrakte	9	26.893.536	794.992	375	727.871
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		2.390.000	–	–	1.030.000
Forderungen aus Zeichnungen		35.582	–	–	–
Sonstige Forderungen		11.168	–	–	1.815
		323.469.723	26.049.735	361.996	75.665.119
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	21.730.883	937.283	–	6.951.074
Banküberziehung	9	–	–	–	2.883
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		19.179	–	267.577	–
Zahlbare Aufwendungen		187.165	12.924	94.080	46.095
Zahlbare Performancegebühren	3	64.223	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	5.898.280	2	339	39.453
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		2.390.000	–	–	1.030.000
Auf Swaps zu zahlende Erträge		1.394.836	9.393	–	34.118
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	87.196
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		31.684.566	959.602	361.996	8.190.819
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		291.785.157	25.090.133	–	67.474.300

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied - **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied - **Claire Cawley**

23. April 2024

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 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
29.326.713	35.678.858	35.517.434	42.352.414	24.730.526	219.188.489	212.769.178	73.717.900	796.517.311
364.864	1.961.547	579.193	394.130	1.686.983	10.599.591	3.306.535	290.707	4.748.302
98.269	16.709	2.722	371.995	4.134	130.428	3.544.887	828.177	12.001.703
66.711	83.655	390.163	884.481	867.794	–	5.802	–	4.187.454
24.798	–	4.228	–	7.776	102.241	36.522	37.678	168.502
–	–	–	–	1.070.029	6.453.000	–	112.674	553.216
–	–	–	–	–	–	–	–	–
111.192	223	71.033	52.444	–	27	509.275	29.105	1.636.988
–	–	–	–	–	9.658	–	–	13.675
29.992.547	37.740.992	36.564.773	44.055.464	28.367.242	236.483.434	220.172.199	75.016.241	819.827.151
–	–	6.437	3.388	1.194.127	6	1.133.329	690.743	20.477
277	82	–	677	2.229	–	–	–	8
–	27.739	402.722	–	604.117	–	116.279	–	10.358.618
27	440.474	64.832	821.451	–	–	57.020	20.629	71.431
57.295	96.069	68.153	108.426	32.340	259.859	140.202	56.574	433.627
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	528.056	509.794	5	43.805	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	2.167	–	–	–	–
–	–	–	–	21.345	–	–	–	–
34.405	293.332	–	861.322	–	–	–	–	–
92.004	857.696	542.144	1.795.264	2.384.381	769.659	1.446.835	811.751	10.884.161
29.900.543	36.883.296	36.022.629	42.260.200	25.982.861	235.713.775	218.725.364	74.204.490	808.942.990

Zum 31. Dezember 2023 (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
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	1.434.797.642	274.276.359	23.170.967	28.228.193
Barmittel und Bargegenwerte	9	11.016.097	5.653.890	171.857	236.872
Forderungen aus Erträgen		24.673.907	3.888.847	412.223	513.951
Forderungen aus veräußerten Anlagen		46.856	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	228.472	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	1.735.194	87.039	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	80.000
Forderungen aus Zeichnungen		855.139	65.547	4.372	2.081
Sonstige Forderungen		5	10.115	151	–
		1.471.618.118	285.629.952	23.846.609	29.061.097
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	158.760	1.208.593	78.878	329.474
Banküberziehung	9	3	157	95	52
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		1.168.591	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		1.914.297	214.128	34.955	21.622
Zahlbare Aufwendungen		736.403	249.807	35.324	66.448
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	53	27.402	62.052	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	80.000
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		3.978.107	1.700.087	211.304	497.596
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		1.467.640.011	283.929.865	23.635.305	28.563.501

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2023 (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 Floating Rate Credit Fund*	BNY Mellon Food Innovation Fund*	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund
USD	USD	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
22.664.815	29.809.690	178.794.532	57.355.402	31.126.569	–	–	–	487.306.526
173.612	615.853	4.756.407	348.006	374.597	2.311	2.364	745	2.382.313
397.740	547.122	2.091.894	736.468	582.713	–	51	–	2.840.712
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	4.756	–	–	2.949	7.648	6.504	9.231	–
39.385	15.005	2.949.674	185.214	–	–	–	–	9.767.629
60.000	–	260.000	–	–	–	–	–	4.020.000
–	128	939.692	19.970	–	–	–	–	362.044
1.745	–	–	1.481	–	–	–	–	1.539
23.337.297	30.992.554	189.792.199	58.646.541	32.086.828	9.959	8.919	9.976	506.680.763
305.374	457.498	1.507.556	221.923	395.785	–	–	–	14.075.199
–	–	–	–	–	–	–	–	106
–	–	–	–	249.000	–	–	–	–
–	–	192.897	–	–	–	–	–	62.775
28.616	47.061	191.208	23.701	30.851	9.959	8.919	9.976	497.162
–	–	–	–	–	–	–	–	–
42.615	37.502	1.286.930	–	–	–	–	–	556.685
60.000	–	260.000	–	–	–	–	–	4.020.000
–	–	231.301	–	170.677	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
436.605	542.061	3.669.892	245.624	846.313	9.959	8.919	9.976	19.211.927
22.900.692	30.450.493	186.122.307	58.400.917	31.240.515	–	–	–	487.468.836

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	1.006.155.327	180.446.219	21.145.943	431.789.113
Barmittel und Bargegenwerte	9	21.656.496	1.864.236	1.196.237	12.045.996
Forderungen aus Erträgen		9.929.565	1.353.933	14.767	530.000
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	33.542	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	52.759	–	9.870	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	29.868.304	8.462.920	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		590.000	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		3.288.513	5.967	–	1.257.261
Sonstige Forderungen		22.727	2.994	–	–
		1.071.563.691	192.136.269	22.400.359	445.622.370
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	23.116.594	9.289.759	218	3.573
Banküberziehung	9	3.907	55	88	1.427
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		2.403.069	–	26.741	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		312.085	38.092	108.250	598.473
Zahlbare Aufwendungen		443.190	215.783	55.699	671.719
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	4.441.185	14.747	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		590.000	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		193.195	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	113.062	–
		31.503.225	9.558.436	304.058	1.275.192
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		1.040.060.466	182.577.833	22.096.301	444.347.178

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders 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
USD	USD	USD	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD
112.641.056	95.097.630	67.817.438	30.139.129	1.217.908.895	39.904.642	225.350.042	764.309.560	28.154.309
1.281.424	531.191	1.648.947	561.601	48.098.303	785.214	4.393.303	116.440	1.574.750
1.845.134	49.272	32.180	27.304	2.408.871	70.940	816.271	10.510.718	61.714
–	–	–	–	–	–	744.282	–	–
–	5.826	2.194	–	–	–	–	3.393	4.055
–	–	–	–	21.078.591	708.468	5.186.032	17.330.000	–
–	–	–	–	11.990.000	–	–	–	–
11.063	33.300	199.445	20.389	647.970	632	2.000	10.495.436	–
175	–	–	–	25.940	364	8.064	6.816	1.826
115.778.852	95.717.219	69.700.204	30.748.423	1.302.158.570	41.470.260	236.499.994	802.772.363	29.796.654
354.649	8.536	4.564	6	19.860.808	568.892	7.446.119	14.541.434	88.838
8.076	–	305	13.954	198.715	572	132.048	9.323	–
148.574	–	–	–	–	–	–	10.038.070	–
6.927	16.900	16.524	14.879	8.282.626	38.547	236.945	609.154	–
123.221	120.783	80.865	66.644	1.422.321	61.784	327.415	678.522	12.051
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	11.990.000	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
641.447	146.219	102.258	95.483	41.754.470	669.795	8.142.527	25.876.503	100.889
115.137.405	95.571.000	69.597.946	30.652.940	1.260.404.100	40.800.465	228.357.467	776.895.860	29.695.765

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund
	Erläuterungen	JPY	EUR	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	17.370.379.476	20.537.937	1.442.284.646	415.047.929
Barmittel und Bargegenwerte	9	621.781.707	278.123	30.943.696	6.959.084
Forderungen aus Erträgen		25.696.350	1.693	1.051.047	137.916
Forderungen aus veräußerten Anlagen		60.047.092	–	–	3.833.425
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	159.471	1.587	–	13.881
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		62.500.000	–	1.602.874	100.854
Sonstige Forderungen		3.014	–	7.555	–
		18.140.567.110	20.819.340	1.475.889.818	426.093.089
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	159.429.964	–	298.865	63.717
Banküberziehung	9	5.245	–	2.395	2.251
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		33.837.301	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		72.843.859	–	2.178.124	746.212
Zahlbare Aufwendungen		21.199.005	22.291	1.938.328	571.880
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		287.315.374	22.291	4.417.712	1.384.060
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		17.853.251.736	20.797.049	1.471.472.106	424.709.029

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
EUR	USD	EUR	USD	USD	EUR	USD	USD	USD
47.508.395	–	331.136.575	10.688.829	432.751.590	16.779.213	92.597.916	402.676.937	798.970.591
3.065.291	11.894	3.201.058	460.226	6.269.789	555.260	117.970	11.440.448	675.677
–	–	2.883.012	5.788	256.824	32.180	1.209.271	675.917	10.071.533
–	–	–	23.004	–	–	–	11.316.561	–
–	11.878	66.675	7.830	–	47.944	–	–	9.484
–	–	6.900.791	–	–	305.086	4.920.640	–	–
–	–	5.220.000	–	–	–	–	–	–
37.370	–	6.386	–	34.393	–	–	450.614	299.638
–	–	88	–	12.981	–	–	64	1
50.611.056	23.772	349.414.585	11.185.677	439.325.577	17.719.683	98.845.797	426.560.541	810.026.924
–	–	11.045.374	31	–	357.815	3.227.640	7.227	102.853
2	–	–	10.970	–	–	129.659	404	74
–	–	–	13.869	–	–	–	8.987.886	3.420.570
84.068	–	19.147	–	41.863	285.351	–	579.278	1.328.215
68.131	23.772	316.668	18.372	523.979	77.963	123.820	349.390	655.205
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	31.742	–	–	–	1.193.722	–	–
–	–	5.220.000	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	11.436	–	102
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	61.719	–	3.865	–	–	–
152.201	23.772	16.632.931	104.961	565.842	724.994	4.686.277	9.924.185	5.507.019
50.458.855	–	332.781.654	11.080.716	438.759.735	16.994.689	94.159.520	416.636.356	804.519.905

Zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

		Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	Gesamt 31. Dezember 2023*
	Erläuterungen	USD	EUR	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte					
	16	56.411.291	1.066.954.722	34.397.159	14.405.854.548
Barmittel und Bargegenwerte	9	3.531.153	30.761.650	257.806	280.517.238
Forderungen aus Erträgen		853.105	13.119.523	392.536	120.317.821
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	22.909.596
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	26.965	74.801	1.068	1.009.903
Margen auf Derivatkontrakte	9	891.751	10.411.181	139.111	165.099.033
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	3.659.672	–	31.851.614
Forderungen aus Zeichnungen		–	2.163.497	187.800	26.570.077
Sonstige Forderungen		–	–	–	146.063
		61.714.265	1.127.145.046	35.375.480	15.054.275.893
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten					
	16	1.001.975	7.926.977	78.937	159.502.170
Banküberziehung	9	–	–	–	542.194
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	38.231.709
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		–	517.220	–	22.066.473
Zahlbare Aufwendungen		58.885	713.228	18.921	14.009.236
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	70.899
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	4.800	15.474.066
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	3.659.672	–	31.851.614
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	67.917	–	2.313.504
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	117.605
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	1.368.107
		1.060.860	12.885.014	102.658	285.547.577
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen					
		60.653.405	1.114.260.032	35.272.822	14.768.728.316

* Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2023 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Absolute Return Credit Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Zum 31. Dezember 2022

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	312.759.255	141.792.173	124.400.669	18.417.522
Barmittel und Bargegenwerte	9	19.806.407	2.166.813	1.821.223	325.312
Forderungen aus Erträgen		1.933.932	134.134	790.613	62.866
Forderungen aus veräußerten Anlagen		488.750	48.333	253.787	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	–	10.658
Margen auf Derivatkontrakte	9	26.871.213	1.888.351	979.396	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		3.080.000	2.918.635	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		132.671	37.025	60.423	–
Sonstige Forderungen		10.495	128	1.313	723
		365.082.723	148.985.592	128.307.424	18.817.081
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	25.380.960	5.563.499	10.751.576	–
Banküberziehung	9	508.227	307	3.114	8.064
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	80.660	4.003.045	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		649.087	358.977	29.823	–
Zahlbare Aufwendungen		197.599	203.416	66.011	30.027
Zahlbare Performancegebühren	3	17.540	1.072	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	68.994	22.880	165.356	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		3.080.000	2.918.635	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	11.246	45.617	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	38.396	100.689	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		29.902.407	9.199.088	15.165.231	38.091
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		335.180.316	139.786.504	113.142.193	18.778.990

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Asian Opportunities Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 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	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
42.360.317	39.044.391	38.823.876	21.859.202	515.799.413	176.581.363	46.304.560	927.677.765	1.379.492.946
1.276.191	2.094.924	1.745.135	1.344.114	33.357.102	1.745.292	165.112	10.019.740	8.247.680
18.227	3.795	182.121	3.000	284.973	3.040.705	515.107	14.905.540	24.306.925
–	–	–	113.966	–	–	38.369	–	–
–	4.204	–	11.574	62.167	30.362	17.980	53.908	298.740
–	–	–	2.111.390	7.002.749	298.861	338.921	725.012	2.622.553
–	–	–	–	–	–	–	–	–
4	35.273	161.700	–	93	435.248	–	25.849.414	17.004.681
8.101	–	–	48	8.702	–	817	924.593	7.110.075
43.662.840	41.182.587	40.912.832	25.443.294	556.515.199	182.131.831	47.380.866	980.155.972	1.439.083.600
–	13.091	1.058	1.364.879	595.358	3.087.854	740.533	3.419.904	3.999.065
6.701	–	–	1.676	–	–	–	–	–
–	–	–	93.364	–	8.182	37.334	27.632.410	15.221.461
8.044	131.301	102.123	–	–	39.950	3.244	50.496	1.814.918
103.875	69.375	110.302	17.650	343.774	91.412	21.204	238.912	561.195
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	616.410	–	1.197	34.663	–	10.494
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	2.441	–	–	1.164	–	–
–	–	–	7.768	–	–	–	–	–
–	–	804.930	–	–	–	–	–	–
118.620	213.767	1.018.413	2.104.188	939.132	3.228.595	838.142	31.341.722	21.607.133
43.544.220	40.968.820	39.894.419	23.339.106	555.576.067	178.903.236	46.542.724	948.814.250	1.417.476.467

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		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
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	340.348.733	21.604.967	23.633.385	22.665.035
Barmittel und Bargegenwerte	9	7.306.736	2.284.652	1.435.740	1.437.336
Forderungen aus Erträgen		4.902.710	396.499	446.831	462.794
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	1.948.187	74.257	–	18.067
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	30.000	–
Forderungen aus Zeichnungen		476.680	48.860	–	–
Sonstige Forderungen		8.390	114	2.494	1.232
		354.991.436	24.409.349	25.548.450	24.584.464
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	1.976.103	23.015	95.817	83.638
Banküberziehung	9	32	–	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		374.475	102.822	69.039	–
Zahlbare Aufwendungen		290.284	36.614	89.955	8.876
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	104.233	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	30.000	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		2.745.127	162.451	284.811	92.514
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		352.246.309	24.246.898	25.263.639	24.491.950

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Food Innovation Fund*	BNY Mellon Future Earth Fund	BNY Mellon Future Life Fund	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund
USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD
35.507.358	169.796.757	42.616.994	1.868.610	1.649.016	2.038.664	406.964.536	377.451.862	330.888.479
2.653.157	6.174.319	1.154.877	51.315	26.412	60.454	3.878.191	2.930.230	13.575.817
697.715	1.117.889	389.942	1.647	373	408	2.206.124	3.815.016	2.482.085
–	–	300.492	–	–	–	–	–	142.888
14.802	–	–	7.716	9.152	4.256	–	17.464	–
364.635	652.798	65.082	–	–	–	3.600.625	9.374.926	6.575.294
–	320.000	–	–	–	–	6.180.000	1.280.000	–
–	228.475	–	–	–	–	98.148	–	226.435
–	–	1.455	–	–	–	1.135	17.203	1.573
39.237.667	178.290.238	44.528.842	1.929.288	1.684.953	2.103.782	422.928.759	394.886.701	353.892.571
891.639	1.070.121	114.402	–	104	–	7.424.271	7.161.044	8.388.906
–	–	–	–	–	–	150.911	950.423	6
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	109.231	535.000	–	–	–	166.222	2.633	4.462
62.064	201.665	12.733	2.304	1.426	1.716	348.469	100.042	284.587
–	–	–	–	–	–	–	–	–
30.884	148	4	–	–	–	303.373	507.229	213.548
–	320.000	–	–	–	–	6.180.000	1.280.000	–
–	5.584	2.082	–	–	–	–	136.153	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
984.587	1.706.749	664.221	2.304	1.530	1.716	14.573.246	10.137.524	8.891.509
38.253.080	176.583.489	43.864.621	1.926.984	1.683.423	2.102.066	408.355.513	384.749.177	345.001.062

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	34.357.449	523.119.354	107.065.049	121.467.336
Barmittel und Bargegenwerte	9	1.020.519	12.442.400	3.235.084	841.807
Forderungen aus Erträgen		13.890	1.521.636	1.681.377	195.938
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	34.862
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	26.129	–	–	17.119
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		–	213.958	–	1.100
Sonstige Forderungen		–	–	–	–
		35.417.987	537.297.348	111.981.510	122.558.162
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	258	5.309	565.872	55.727
Banküberziehung	9	–	5.660	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	700.883	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		3.921	812.275	715.121	83.700
Zahlbare Aufwendungen		67.814	740.414	116.391	158.209
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		71.993	1.563.658	2.098.267	297.636
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		35.345.994	535.733.690	109.883.243	122.260.526

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Global Leaders 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
USD	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD	JPY	EUR
45.854.102	26.328.032	2.011.349.889	57.376.965	332.164.516	530.353.062	24.826.004	22.930.149.463	1.131.361.934
673.800	823.586	64.974.947	2.792.729	13.357.037	2.923.857	1.064.323	654.459.875	20.805.057
18.270	26.442	4.779.433	105.450	820.650	7.502.545	76.921	48.711.460	376.864
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	4.304	–	–	–
–	–	56.009.210	1.227.269	24.222.460	23.110.000	–	–	–
–	–	16.390.000	440.000	–	70.000	–	–	–
4.388	–	1.605.096	14.412	27.962	365.489	–	–	1.246.537
–	148	15.924	435	5.581	8.346	1.396	18.380	7.829
46.550.560	27.178.208	2.155.124.499	61.957.260	370.598.206	564.337.603	25.968.644	23.633.339.178	1.153.798.221
989	307	25.537.987	1.104.910	21.200.062	28.018.215	132.984	205.976.575	163.798
–	–	3.130.555	–	–	–	–	–	53
–	–	–	–	–	–	–	–	–
163	5.085	3.000.789	13.917	2.481.664	599.277	–	46.061.021	452.202
51.971	64.602	1.882.054	49.884	378.864	368.851	6.344	22.406.460	1.357.776
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	16.390.000	440.000	–	70.000	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
53.123	69.994	49.941.385	1.608.711	24.060.590	29.056.343	139.328	274.444.056	1.973.829
46.497.437	27.108.214	2.105.183.114	60.348.549	346.537.616	535.281.260	25.829.316	23.358.895.122	1.151.824.392

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund
	Erläuterungen	USD	EUR	USD	EUR
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	449.093.609	42.809.530	22.925.745	320.462.627
Barmittel und Bargegenwerte	9	14.157.081	495.787	297.758	12.983.643
Forderungen aus Erträgen		150.366	–	714	2.485.032
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	133.834
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	24.653	–	17.829	33.067
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	272.481
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	12.830.000
Forderungen aus Zeichnungen		1.600.294	23.759	–	18.790
Sonstige Forderungen		–	–	15	3.224
		465.026.003	43.329.076	23.242.061	349.222.698
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	309.404	–	1.754	2.570.305
Banküberziehung	9	–	–	–	1
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		819.527	71.564	–	234.430
Zahlbare Aufwendungen		605.116	70.372	33.622	185.221
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	212.339
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	12.830.000
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–
		1.734.047	141.936	35.376	16.032.296
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		463.291.956	43.187.140	23.206.685	333.190.402

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

◊ Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund ^c	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*
USD	USD	EUR	USD	USD	USD	EUR	EUR
10.327.873	381.796.179	83.243.353	80.292.439	341.445.956	855.518.148	982.006.814	24.103.509
368.260	11.078.943	3.775.350	648.777	14.600.690	25.146.277	17.600.086	1.616.998
4.239	812.270	225.191	941.816	782.252	10.393.396	8.671.630	156.340
–	–	–	–	3.155.725	–	–	–
24.096	–	22.848	–	–	–	68.439	–
–	1.150.000	1.818.157	2.311.282	–	–	1.325.513	152.377
–	–	–	50.000	–	–	760.000	–
–	21.997	72.058	–	264.197	273.473	4.931.382	–
198	12.980	–	–	–	68	–	–
10.724.666	394.872.369	89.156.957	84.244.314	360.248.820	891.331.362	1.015.363.864	26.029.224
1.240	1.198.028	959.287	2.659.675	326.608	104.789	2.817.446	38.819
–	132.226	127.998	1.173.514	–	–	–	–
–	–	–	–	2.880.867	–	–	–
–	438	7.035	–	1.212	277.460	1.144.902	–
30.407	456.538	105.067	80.339	322.601	570.952	506.015	19.290
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	6	–	–	838.858	83.864
–	–	–	50.000	–	–	760.000	–
–	–	–	8.410	–	–	32.918	–
–	–	–	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	17.429
31.651	1.787.230	1.199.387	3.971.944	3.531.288	953.201	6.100.139	159.402
10.693.015	393.085.139	87.957.570	80.272.370	356.717.532	890.378.161	1.009.263.725	25.869.822

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		Gesamt 31. Dezember 2022 [*]
Erläuterungen		USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		
	16	14.651.364.763
Barmittel und Bargegenwerte	9	371.484.864
Forderungen aus Erträgen		106.740.168
Forderungen aus veräußerten Anlagen		4.804.016
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	790.228
Margen auf Derivatkontrakte	9	183.972.033
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		47.402.064
Forderungen aus Zeichnungen		56.076.862
Sonstige Forderungen		8.157.828
		15.430.792.826
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		
	16	177.773.045
Banküberziehung	9	6.465.127
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		50.957.077
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		16.144.607
Zahlbare Aufwendungen		12.272.198
Zahlbare Performancegebühren	3	20.072
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.315.747
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		47.402.064
Auf Swaps zu zahlende Erträge		254.038
Finanzierungskosten für Swaps		161.969
Zahlbare Steuern	10	804.934
Sonstige Verbindlichkeiten		18.657
		315.589.535
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		15.115.203.291

^{*} Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2022 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.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

	BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund
	EUR	EUR	GBP	EUR	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	335.180.316	–	139.786.504	113.142.193	18.778.990
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	25.704.081	90.129	(4.081.818)	2.452.440	1.789.863
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	61.828.762	25.000.004	3.847.222	44.065.914	18.306.683
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(130.928.002)	–	(139.551.908)	(92.186.247)	(8.974.993)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(69.099.240)	25.000.004	(135.704.686)	(48.120.333)	9.331.690
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	291.785.157	25.090.133	–	67.474.300	29.900.543

	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	1.417.476.467	352.246.309	24.246.898	25.263.639	24.491.950
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	75.856.924	17.629.294	2.179.770	3.678.237	1.622.272
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	599.138.964	95.664.242	4.129.696	10.391.483	3.596.470
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(624.832.344)	(181.609.980)	(6.921.059)	(10.769.858)	(6.810.000)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(25.693.380)	(85.945.738)	(2.791.363)	(378.375)	(3.213.530)
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	1.467.640.011	283.929.865	23.635.305	28.563.501	22.900.692

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN
NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Asian Opportunities Fund	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 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
43.544.220 –	40.968.820 –	39.894.419 –	23.339.106 –	555.576.067 –	178.903.236 –	46.542.724 –	948.814.250 –
108.681	9.114.795	7.014.524	2.209.188	95.322.006	18.208.568	4.749.649	44.083.556
2.319.630	7.553.163	19.123.288	434.567	115.754.499	121.369.377	54.562.140	422.697.033
(9.089.235)	(21.614.149)	(23.772.031)	–	(530.938.797)	(99.755.817)	(31.650.023)	(606.651.849)
(6.769.605)	(14.060.986)	(4.648.743)	434.567	(415.184.298)	21.613.560	22.912.117	(183.954.816)
36.883.296	36.022.629	42.260.200	25.982.861	235.713.775	218.725.364	74.204.490	808.942.990
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	BNY Mellon Food Innovation Fund*	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund
USD	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
38.253.080 –	176.583.489 –	43.864.621 –	– –	1.926.984 –	1.683.423 –	2.102.066 –	408.355.513 –
3.001.231	13.049.786	4.053.534	1.233.670	(231.580)	(236.130)	(96.014)	7.270.337
81.747	31.640.938	14.764.075	30.012.321	13.530	8.229	10.607	267.848.982
(10.885.565)	(35.151.906)	(4.281.313)	(5.476)	(1.708.934)	(1.455.522)	(2.016.659)	(196.005.996)
(10.803.818)	(3.510.968)	10.482.762	30.006.845	(1.695.404)	(1.447.293)	(2.006.052)	71.842.986
30.450.493	186.122.307	58.400.917	31.240.515	–	–	–	487.468.836

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	384.749.177	345.001.062	35.345.994	535.733.690	109.883.243
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	54.253.506	(8.445.989)	941.105	37.421.909	12.395.512
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	650.226.876	47.655.134	14.768.095	211.074.591	11.345.604
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(49.169.093)	(201.632.374)	(28.958.893)	(339.883.012)	(18.486.954)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	601.057.783	(153.977.240)	(14.190.798)	(128.808.421)	(7.141.350)
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	1.040.060.466	182.577.833	22.096.301	444.347.178	115.137.405

	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund
	JPY	EUR	EUR	USD	EUR
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	23.358.895.122	–	1.151.824.392	463.291.956	43.187.140
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(295.456.435)	797.862	210.699.827	79.253.863	7.470.402
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	5.763.254.602	39.846.822	471.057.024	48.800.202	39.635.864
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(10.973.441.553)	(19.847.635)	(362.109.137)	(166.636.992)	(39.834.551)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(5.210.186.951)	19.999.187	108.947.887	(117.836.790)	(198.687)
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	17.853.251.736	20.797.049	1.471.472.106	424.709.029	50.458.855

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN
NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders 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
USD	USD	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD
122.260.526 –	46.497.437 –	27.108.214 –	2.105.183.114 –	60.348.549 –	346.537.616 –	535.281.260 –	25.829.316 –
4.035.370	10.025.842	5.220.258	(18.583.789)	(649.389)	3.461.642	58.307.597	3.339.150
9.004.800	47.022.315	7.083.442	140.127.510	10.646.030	41.585.040	424.106.217	527.299
(39.729.696)	(33.947.648)	(8.758.974)	(966.322.735)	(29.544.725)	(163.226.831)	(240.799.214)	–
(30.724.896)	13.074.667	(1.675.532)	(826.195.225)	(18.898.695)	(121.641.791)	183.307.003	527.299
95.571.000	69.597.946	30.652.940	1.260.404.100	40.800.465	228.357.467	776.895.860	29.695.765
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
USD	EUR	USD	USD	EUR	USD	USD	USD
23.206.685 –	333.190.402 –	10.693.015 –	393.085.139 –	87.957.570 –	80.272.370 –	356.717.532 –	890.378.161 –
(1.289.925)	(6.142.232)	387.701	65.820.225	(3.831.176)	9.193.187	24.864.856	40.211.677
62.979	157.332.919	–	124.414.632	7.963.730	4.693.963	209.723.068	255.993.570
(21.979.739)	(151.599.435)	–	(144.560.261)	(75.095.435)	–	(174.669.100)	(382.063.503)
(21.916.760)	5.733.484	–	(20.145.629)	(67.131.705)	4.693.963	35.053.968	(126.069.933)
–	332.781.654	11.080.716	438.759.735	16.994.689	94.159.520	416.636.356	804.519.905

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Forts.)

	Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	Gesamt 31. Dezember 2023*
	USD	EUR	EUR	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	–	1.009.263.725	25.869.822	15.115.203.291
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	166.488.417
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	1.342.993	69.582.286	2.059.965	1.016.186.209
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	59.310.752	220.139.446	7.468.615	5.361.405.490
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(340)	(184.725.425)	(125.580)	(6.890.555.091)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	59.310.412	35.414.021	7.343.035	(1.529.149.601)
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	60.653.405	1.114.260.032	35.272.822	14.768.728.316

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2023 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Absolute Return Credit Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

	BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund
	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	420.833.229	123.705.871	95.148.164	14.979.746	58.824.565
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(8.084.743)	7.252.536	(4.306.449)	(2.511.095)	(12.924.848)
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	36.130.147	49.417.663	78.155.298	8.877.990	4.478.205
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(113.698.317)	(40.589.566)	(55.854.820)	(2.567.651)	(6.833.702)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(77.568.170)	8.828.097	22.300.478	6.310.339	(2.355.497)
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	335.180.316	139.786.504	113.142.193	18.778.990	43.544.220

	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	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	554.266.191	33.134.900	113.559.730	27.883.288	125.677.325
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(104.662.455)	(5.867.592)	(16.051.025)	(5.623.167)	(31.479.506)
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	114.870.614	1.410.218	3.461.096	4.526.812	1.743.604
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(212.228.041)	(4.430.628)	(75.706.162)	(2.294.983)	(57.688.343)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(97.357.427)	(3.020.410)	(72.245.066)	2.231.829	(55.944.739)
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	352.246.309	24.246.898	25.263.639	24.491.950	38.253.080

< Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 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	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
95.125.353 –	42.616.239 –	24.751.005 –	645.924.114 –	191.298.660 –	20.691.305 –	1.921.308.172 –	726.611.703 –
(45.389.932)	(1.868.186)	(1.456.876)	(164.038.593)	(49.092.502)	(5.748.652)	(375.371.272)	(167.620.572)
34.606.410	41.181.642	44.977	309.356.243	76.529.636	35.048.898	251.203.571	1.309.881.786
(43.373.011)	(42.035.276)	–	(235.665.697)	(39.832.558)	(3.448.827)	(848.326.221)	(451.396.450)
(8.766.601)	(853.634)	44.977	73.690.546	36.697.078	31.600.071	(597.122.650)	858.485.336
40.968.820	39.894.419	23.339.106	555.576.067	178.903.236	46.542.724	948.814.250	1.417.476.467
BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Food Innovation Fund ^c	BNY Mellon Future Earth Fund	BNY Mellon Future Life Fund	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund
EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD
275.922.173 –	40.738.209 –	2.766.825 –	2.164.937 –	2.351.576 –	434.682.361 –	442.961.954 –	432.993.493 –
(41.356.286)	(8.208.031)	(397.172)	(492.208)	(262.155)	(70.835.489)	(86.914.750)	(46.382.410)
20.311.347	22.688.502	17.846	10.694	12.645	124.122.318	129.057.442	117.686.436
(78.293.745)	(11.354.059)	(460.515)	–	–	(79.613.677)	(100.355.469)	(159.296.457)
(57.982.398)	11.334.443	(442.669)	10.694	12.645	44.508.641	28.701.973	(41.610.021)
176.583.489	43.864.621	1.926.984	1.683.423	2.102.066	408.355.513	384.749.177	345.001.062

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities 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
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	53.039.682	411.101.299	166.693.695	227.707.584	65.357.060
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(12.692.790)	(23.452.808)	(26.568.775)	(49.064.913)	(15.304.287)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	12.880.573	271.192.841	14.962.528	105.578.611	15.663.966
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(17.881.471)	(123.107.642)	(45.204.205)	(161.960.756)	(19.219.302)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(5.000.898)	148.085.199	(30.241.677)	(56.382.145)	(3.555.336)
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	35.345.994	535.733.690	109.883.243	122.260.526	46.497.437
	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund ^c
	USD	EUR	USD	EUR	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	993.610.089	81.192.875	4.976.550	328.622.843	505.772.156
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(325.716.548)	(10.731.504)	(1.772.047)	(29.904.617)	(104.442.245)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	135.766.447	12.650.466	20.005.144	76.476.638	172.174.830
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(340.368.032)	(39.924.697)	(2.962)	(42.004.462)	(180.419.602)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(204.601.585)	(27.274.231)	20.002.182	34.472.176	(8.244.772)

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^c Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^a Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2022 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.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (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
37.198.450 –	3.121.728.759 –	65.897.045 –	437.609.335 –	792.573.372 –	32.551.101 –	21.102.568.351 –	1.600.784.047 –
(8.331.739)	(335.503.368)	(5.771.645)	(39.693.317)	(105.159.098)	(7.167.081)	1.347.277.985	(226.817.385)
13.417.142	331.953.430	16.575.847	87.848.231	206.433.680	445.296	6.807.697.021	198.563.838
(15.175.639)	(1.012.995.707)	(16.352.698)	(139.226.633)	(358.566.694)	–	(5.898.648.235)	(420.706.108)
(1.758.497)	(681.042.277)	223.149	(51.378.402)	(152.133.014)	445.296	909.048.786	(222.142.270)
27.108.214	2.105.183.114	60.348.549	346.537.616	535.281.260	25.829.316	23.358.895.122	1.151.824.392
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2022*	
EUR	USD	USD	USD	EUR	EUR	USD	
78.396.803 –	91.523.113 –	297.752.469 –	1.007.082.724 –	984.235.804 –	– –	19.432.086.509 (552.918.441)	
(13.950.316)	(12.830.670)	3.449.847	(214.142.096)	(145.935.914)	(4.287.253)	(2.999.419.990)	
55.708.607	1.579.927	162.899.036	460.237.887	365.867.569	30.157.075	5.686.995.302	
(32.197.524)	–	(107.383.820)	(362.800.354)	(194.903.734)	–	(6.451.540.089)	
23.511.083	1.579.927	55.515.216	97.437.533	170.963.835	30.157.075	(764.544.787)	

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:

ENTSPRECHENERKLÄRUNG

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde gemäß 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 Abschluss 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 Abschlusses 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 die gesamten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zusammen mit Erträgen und Kosten 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 den 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 Vermögenswerten/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 – SCHÄTZUNG 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 – SCHÄTZUNG 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, den fairen oder angemessenen Wert nicht reflektiert, ist der Wert unter Einsatz anderer Methoden mit angemessener Sorgfalt und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat angemessen zu berechnen, 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 Einschätzung 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 – SCHÄTZUNG 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 abgewinkelte 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 Markit 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 Markit 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 Märkten 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 einem 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 nur, 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 2023 investieren der BBNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Absolute Return Credit Fund, der BNY Mellon Euroland Bond Fund und der BNY Mellon European Credit Fund in andere Fonds der Gesellschaft (31. Dezember 2022: BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, BNY Mellon Euroland Bond Fund und BNY Mellon European Credit Fund). Die Überkreuzinvestitionen wurden aus dem Abschluss 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. Nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Devisenkassakonten wurden in die Salden für Barmittel und Bargegenwerte bzw. Banküberziehungen einbezogen.

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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

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.

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. Als Sicherheit für die entliehenen Wertpapiere erhält die Gesellschaft 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 die 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 wird unter normalen Marktbedingungen 2 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht überschreiten; der Verwaltungsrat kann jedoch den maximalen Verwässerungsausgleich vorübergehend auf über 2 % erhöhen, wenn dies unter außergewöhnlichen Marktbedingungen als notwendig und im besten Interesse der Anleger erachtet wird. 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 Anteilskapital 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 38.092 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

Einlösbare, partizipierende Anteile verleihen den Anspruch auf einen anteilmäßigen Anteil an den Vermögenswerten der Fonds und berechtigen den Anteilsinhaber zu einer Stimme je Anteil bei einer Abstimmung. Anteile werden von den Anteilsinhabern zu Preisen eingelöst, die auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse basieren.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2023 sind wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
	Klasse C	EUR	3.099	190	(226)	3.063
	Klasse R	EUR	27.831	9.275	(8.691)	28.415
	Klasse R (Hedged)	USD	7.620	2.477	(3.731)	6.366
	Klasse R (Inc)	EUR	7.825	9.207	(5.897)	11.135
	Klasse S	EUR	28.989	2.635	(11.500)	20.124
	Klasse T (Hedged)^	CHF	133	105	(238)	–
	Klasse T (Hedged)	USD	112.526	–	(16.444)	96.082
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	67.226	2.526	(52.028)	17.724
	Klasse W (Acc)	EUR	1.392	174.310	(173.688)	2.014
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	757.471	61.929	(620.635)	198.765
	Klasse X	EUR	628.696	33.347	(221.712)	440.331
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1.049.732	178.068	(150)	1.227.650

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse G (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	24.941.245	–	24.941.245
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*						
	Klasse D (Acc) (Hedged)^	EUR	1.478.138	33.000	(1.511.138)	–
	Klasse R (Hedged)^	CHF	347.365	–	(347.365)	–
	Klasse R (Hedged)^	EUR	36.171.373	793.978	(36.965.351)	–
	Klasse R (Hedged)^	USD	2.831.281	801	(2.832.082)	–
	Klasse R (Inc) (Hedged)^	EUR	2.256.390	–	(2.256.390)	–
	Sterling R (Acc)^	GBP	673.097	115.435	(788.532)	–
	Sterling S (Acc)^	GBP	207.323	69.506	(276.829)	–
	Klasse T (Hedged)^	EUR	19.189.345	983.919	(20.173.264)	–
	Klasse T (Hedged)^	USD	588.862	–	(588.862)	–
	Klasse U (Hedged)^	EUR	64.616.478	1.117.040	(65.733.518)	–
	Klasse U (Hedged)^	USD	401.118	–	(401.118)	–
	Klasse U (Inc) (Hedged)^	EUR	19	–	(19)	–
	Sterling U (Acc)^	GBP	6.177.858	150.804	(6.328.662)	–
	Sterling X (Acc)^	GBP	9.693.951	496.638	(10.190.589)	–
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund						
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	JPY	–	39.453.254	(30.252)	39.423.002
	Klasse F (Acc)	EUR	3.658.258	200.912	(3.499.975)	359.195
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	1.136.529	–	(1.113.807)	22.722
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	43.507.457	12.977	(43.364.222)	156.212
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	17.286.683	4.973.091	(12.223.784)	10.035.990
	Klasse R (Acc)	EUR	50.000	–	–	50.000
	Klasse U (Acc)	EUR	9.982.068	–	(9.977.068)	5.000
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	11.661.093	177.361	(11.838.454)	–
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	732.049	–	(667.653)	64.396
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.458	1.950.000	(4.458)	1.950.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	18.130.830	10.439.770	(5.583.932)	22.986.668

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Asian Income Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	30.279	12.000	–	42.279
	Klasse A (Inc)	USD	101.461	–	–	101.461
	Klasse A (Inc)	EUR	293.940	258.384	(157.424)	394.900
	Klasse B (Acc)	USD	57.267	–	–	57.267
	Klasse C (Acc)	USD	4.589	9.933.440	(1.860.402)	8.077.627
	Klasse W (Acc)	EUR	13.289.539	3.466.974	(5.268.393)	11.488.120
	Klasse W (Inc)	EUR	580.919	18.900	(232.617)	367.202
	Klasse W (Inc)	USD	2.986.041	376.407	–	3.362.448
	Sterling W (Inc)	GBP	167.579	9.105	(52.671)	124.013
BNY Mellon Asian Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	3.690.727	456.546	(827.686)	3.319.587
	Klasse A	EUR	4.346.223	108.542	(1.343.577)	3.111.188
	Klasse B	USD	2.380.690	–	(123.593)	2.257.097
	Klasse B	EUR	119.301	–	(73.834)	45.467
	Klasse C	USD	190.011	–	(34.055)	155.956
	Klasse C	EUR	233.109	763	(12.458)	221.414
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	Klasse W	USD	461.842	1.590	(5.000)	458.432
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	12.623.535	1.024.741	(3.373.441)	10.274.835
	Klasse A (Acc)	EUR	488.451	106.499	(321.941)	273.009
	Klasse B (Acc)	USD	2.833	2.091	(2.833)	2.091
	Klasse B (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Acc)^	HKD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)	SGD	10.822	937	(1.083)	10.676
	Klasse C (Acc)	USD	2.099.680	2.268	(602.535)	1.499.413
	Klasse E (Acc)	USD	39.840	–	(22.240)	17.600
	Klasse E (Acc)	EUR	3.125.131	2.126	(3.069.500)	57.757
	Klasse G (Acc)	USD	331.549	14.026	(67.519)	278.056
	Klasse G (Acc)	EUR	37.070	361.760	(15.642)	383.188
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	103.040	94.566	(57.988)	139.618
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	15.592.031	1.964.865	(5.086.333)	12.470.563
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	35.436	(10.000)	35.436
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	115.001	66.565	(162.531)	19.035
	Klasse K (Acc)	USD	432.700	–	(1.200)	431.500
	Klasse K (Acc)	EUR	1.482.522	4.671	(675.265)	811.928
	Klasse W (Acc)	USD	7.642.024	1.206.269	(6.469.970)	2.378.323
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	2.948.598	4.302.560	(800.102)	6.451.056
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	5.000	(5.000)	–

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Brazil Equity Fund						
	Klasse A	USD	8.645.228	346.666	(2.220.303)	6.771.591
	Klasse A	EUR	8.795.800	6.069.689	(6.148.062)	8.717.427
	Klasse B	USD	1.224.807	–	–	1.224.807
	Klasse B	EUR	105.398	42.802	(18.178)	130.022
	Sterling B (Acc)	GBP	318.089	43.836	(239.378)	122.547
	Klasse C	USD	2.722.427	250.094	(781.988)	2.190.533
	Klasse C	EUR	176.747	13.252	(128.809)	61.190
	Sterling C (Inc)	GBP	131.690	69.774	(50.586)	150.878
	Klasse G (Acc)	EUR	1.653.156	–	(653.156)	1.000.000
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	10.000	–	(10.000)	–
	Klasse H (Hedged)	EUR	813.814	410.604	(555.887)	668.531
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	2.578.654	20.158	(373.271)	2.225.541
	Klasse W (Acc)	USD	363.560	–	–	363.560
	Klasse W (Acc)	EUR	3.631.946	111.522	(3.275.612)	467.856
	Sterling W (Acc)	GBP	3.663.698	4.828.287	(3.448.161)	5.043.824
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund						
	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)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	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
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	1.104.018	4.067.867	(5.171.386)	499
	Klasse A (Inc)	USD	303.925	21.401	(9.916)	315.410
	Klasse C (Acc)	USD	49.671.663	15.048.346	(30.097.968)	34.622.041
	Klasse G (Acc)	USD	740.116	673.133	(1.370.139)	43.110
	Klasse G (Acc)	EUR	634.330	1.646.034	(2.279.097)	1.267
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	7.358	–	(7.358)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	40.293	–	(1)	40.292
	Klasse W (Acc)	USD	72.731.174	32.089.794	(49.907.062)	54.913.906
	Klasse W (Acc)	EUR	112.895.128	11.185.698	(124.074.165)	6.661
	Klasse W (Inc)	EUR	89.786.660	3.722	(89.786.660)	3.722
	Sterling W (Acc)	GBP	1.060.552	647.106	(96.765)	1.610.893
	Klasse X (Acc)	USD	36.883.625	–	(7.795.306)	29.088.319

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	USD	5.515	1.156	(278)	6.393
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	5.515	556	(278)	5.793
	Klasse E (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	37.116.679	17.834.805	(4.934.304)	50.017.180
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	63.244.625	66.295.321	(48.543.928)	80.996.018
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	25.139.097	1.432.940	(5.604.165)	20.967.872
	Sterling E (Inc) (Hedged) (M)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	22.908	1.199	(13.348)	10.759
	Klasse W (Acc)	USD	4.611	–	–	4.611
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	22.672	–	32.672
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	10.000	–	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	36.835.867	5.087.410	(21.264.404)	20.658.873
	Klasse W (Inc)	USD	5.515	555	(278)	5.792
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	12.141	1.213	(606)	12.748
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.356.264	307.373	(326.985)	1.336.652
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	29.546.356	16.984.341	(20.576.884)	25.953.813
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	16.188.563	3.939.433	(5.202.462)	14.925.534
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	19.396	25.530.725	(3.127.980)	22.422.141

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	645.735	251.707	(297.001)	600.441
	Klasse C (Acc)	USD	2.363.640	289.669	(406.938)	2.246.371
	Klasse C (Inc)	USD	307.918	–	–	307.918
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	81.310.026	56.848.904	(89.143.520)	49.015.410
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	614.142	440.242	(195.507)	858.877
	Klasse N (Acc)	USD	20.922.851	1.551.744	(2.728.528)	19.746.067
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	301.375	5.777	(10.000)	297.152
	Klasse N (Inc) (M)	USD	256.835	540.302	(711)	796.426
	Klasse W (Acc)	USD	156.637.446	48.263.737	(44.506.530)	160.394.653
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	5.467.644	88.992.075	(8.140.224)	86.319.495
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	10.924	1.452.949	(10.000)	1.453.873
	Klasse W (Inc)	USD	5.351	9.904.332	(741.527)	9.168.156
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	15.942.739	234.329	–	16.177.068
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	4.647.147	(944.312)	3.702.835
	Klasse X (Acc)^	JPY	–	741.859	(48.123)	693.736
	Klasse X (Acc)	USD	305.489.162	4.928	(305.489.162)	4.928
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	JPY	–	10.000	–	10.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	144.657.552	18.676.315	(69.521.237)	93.812.630
	Klasse X (Inc)	USD	167.977.241	11.724.001	–	179.701.242
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	51.358.672	107.172.218	(36.277.308)	122.253.582

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Inc)	USD	208.353	41.902	–	250.255
	Klasse A (Inc)	EUR	3.314.746	1.790.386	(205.593)	4.899.539
	Klasse C (Acc)	USD	4.243	–	–	4.243
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	7.626.370	166.428	(7.486.778)	306.020
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	34.304.814	83.706.839	(21.602.363)	96.409.290
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	80.506	–	–	80.506
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.031	10.026	(10.026)	13.031
	Klasse K (Acc)	USD	68.424	4.408	(68.424)	4.408
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	11.719	–	–	11.719
	Klasse L (Acc)	USD	720.208.145	40.555.227	(281.083.646)	479.679.726
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	334.831.903	45.056.248	(162.441.516)	217.446.635
	Klasse L (Inc)	USD	815.435	216.234	(635.019)	396.650
	Klasse L (Inc) (Hedged)	EUR	10.418	2.218.964	(1.060.724)	1.168.658
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	11.041	–	–	11.041
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	190.922.699	132.992.512	(52.695.340)	271.219.871
	Klasse W (Acc)	USD	13.893.024	864.080	–	14.757.104
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Inc)	USD	5.726	937.257	(102.483)	840.500
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	3.045.933	99.024	(36.619)	3.108.338
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	10.930	7.752.182	(1.576.210)	6.186.902
	Klasse X (Acc)	USD	5.736	–	–	5.736
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	28.836.787	156.165.828	(37.691.099)	147.311.516
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
	Klasse A	USD	188.199	13.780	(17.652)	184.327
	Klasse A	EUR	75.848	4.304	(15.613)	64.539
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	238	–	(9)	229
	Klasse B	USD	1.365	516	(674)	1.207
	Klasse C	USD	69.562	8.383	(29.364)	48.581
	Klasse C	EUR	74.735	6.446	(78.995)	2.186
	Klasse G (Inc)	USD	5.882	7.652	(3.641)	9.893
	Klasse H (Hedged)	EUR	58.937	10.928	(34.151)	35.714
	Klasse I (Hedged)	EUR	87.529	20.359	(54.527)	53.361
	Klasse W	USD	119.809	18.580	(55.758)	82.631
	Klasse W	EUR	3.895	100	(650)	3.345
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	249.941	9.586	(35.714)	223.813
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1.204.727	246.024	(999.680)	451.071
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	95.000	–	–	95.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1.550	–	–	1.550
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	19.572	296	(13.327)	6.541
	Klasse X	USD	635.416	280.225	(201.221)	714.420

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund						
	Klasse A	USD	421.614	24.349	(48.198)	397.765
	Klasse A	EUR	2.888.577	103.054	(1.017.854)	1.973.777
	Klasse C	USD	4.363.879	122.994	(1.566.443)	2.920.430
	Klasse C	EUR	2.436.901	1.433.968	(446.391)	3.424.478
	Klasse C (Inc)	USD	8.649	697	(349)	8.997
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	413.956	31.799	(42.695)	403.060
	Klasse W	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	2.928.215	196.074	–	3.124.289
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
	Klasse A	USD	5.028.712	166.171	(1.299.471)	3.895.412
	Klasse A	EUR	7.846.027	581.954	(1.335.418)	7.092.563
	Klasse A (Inc)	USD	4.445	51	(546)	3.950
	Klasse A (Inc)	EUR	2.029.714	205.431	(1.301.352)	933.793
	Sterling A (Acc)	GBP	182.428	14.451	(6.370)	190.509
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	Klasse C	USD	658.109	6.341.098	(1.610.008)	5.389.199
	Klasse C	EUR	740.973	95.508	(53.159)	783.322
	Klasse C (Inc)	USD	16.000	–	–	16.000
	Klasse C (Inc)^	EUR	10.001	–	(10.001)	–
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	4.162	–	5.777
	Sterling C (Inc)	GBP	92.159	1	–	92.160
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.301.116	216.067	(1.041.849)	1.475.334
	Klasse I (Hedged)	EUR	3.012.933	6.173	(2.863.345)	155.761
	Sterling J (Inc) (Hedged)^	GBP	11.000	–	(11.000)	–
	Klasse W	USD	1.331.786	382.156	(1.086.696)	627.246
	Klasse W	EUR	1.821.226	24.818	(95.468)	1.750.576
	Klasse W (Hedged)	EUR	348.694	47.748	(315.828)	80.614
	Klasse W (Inc)	EUR	767.287	–	(35.115)	732.172
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	15.116	1.318	(659)	15.775
	Sterling W (Inc)	GBP	423.658	109.573	(167.118)	366.113
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	36.225	141.407	(59.264)	118.368
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
	Klasse A	EUR	45.932	4.667	–	50.599
	Klasse C	USD	256.500	–	–	256.500
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	31.525.732	4.683.747	(8.870.443)	27.339.036

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	45.460.546	–	(12.489.721)	32.970.825
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.965	–	–	13.965
	Klasse W (Acc)	USD	5.889	–	–	5.889
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	7.349	13.053	(7.349)	13.053
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	272.340	54.056	(221.596)	104.800
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Euroland Bond Fund						
	Klasse A	EUR	52.754.579	4.189.879	(7.338.959)	49.605.499
	Klasse A (Inc)	EUR	4.462.638	250.072	(582.066)	4.130.644
	Klasse B	EUR	4.688	–	(939)	3.749
	Klasse B (Inc)	EUR	16.640	7.595	–	24.235
	Klasse C	EUR	9.502.561	3.495.268	(2.087.899)	10.909.930
	Klasse C (Inc)	EUR	1.705.112	1.552	(970.311)	736.353
	Klasse G (Acc)	EUR	1.395.456	280.265	(1.285.686)	390.035
	Klasse H (Hedged)	CHF	1.111.778	7.700	(176.535)	942.943
	Klasse I (Hedged)	CHF	4.983.837	–	(125.000)	4.858.837
	Klasse W (Acc)	EUR	48.401.864	13.204.032	(13.035.268)	48.570.628
	Klasse Z	EUR	12.990.606	3.936.469	(3.230.601)	13.696.474
BNY Mellon European Credit Fund						
	Klasse A	EUR	6.156	7.533	(462)	13.227
	Klasse C	EUR	42.526	466	(13.439)	29.553
	Klasse W (Acc)	EUR	1.124	148	–	1.272
	Klasse X	EUR	321.154	105.399	(21.943)	404.610
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	29.933.940	(5.400)	29.928.540
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling X (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.005	(3)	10.002
BNY Mellon Food Innovation Fund*						
	Klasse E (Acc)^	EUR	4.319	–	(4.319)	–
	Klasse W (Acc)^	USD	2.000.000	–	(2.000.000)	–

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Future Earth Fund*						
	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)	–
BNY Mellon Future Life Fund*						
	Klasse E (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse W (Acc)^	USD	2.000.000	–	(2.000.000)	–
BNY Mellon Global Bond Fund						
	Klasse A	USD	35.625.636	16.290.849	(6.161.967)	45.754.518
	Klasse A	EUR	10.384.396	620.312	(1.397.123)	9.607.585
	Klasse A (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B	USD	711.615	–	(62.272)	649.343
	Klasse C	USD	51.923.175	64.996.842	(30.180.088)	86.739.929
	Klasse C	EUR	49.703.308	12.157.503	(21.980.022)	39.880.789
	Klasse C (Inc)	USD	490.922	170.910	(491.160)	170.672
	Sterling C (Inc)	GBP	2.322.827	420.535	(1.844.065)	899.297
	Klasse H (Hedged)	EUR	820.567	54.461	(113.916)	761.112
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.289.024	20.528	(1.171.657)	137.895
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	13.695	–	–	13.695
	Klasse W (Acc)	USD	32.874.527	547.548	(33.346.795)	75.280
	Klasse W (Acc)	EUR	103.872	1.168.854	(14.903)	1.257.823
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	3.300.990	688.800	(442.968)	3.546.822
	Klasse X	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Klasse Z (Acc)^	USD	–	124.558	–	124.558
	Klasse Z (Inc)^	USD	–	361.060	–	361.060
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	EUR	–	388.155	(82.085)	306.070
	Klasse Z (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	825.057	1.004.416	(556.860)	1.272.613
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	45.967.249	57.637.718	(37.837.025)	65.767.942

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Credit Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.010	4.215.235	(5.119)	4.215.126
	Klasse A (Inc) (Q)^	USD	–	5.060.480	(5.029)	5.055.451
	Klasse C (Acc)^	USD	–	690.109	–	690.109
	Klasse C (Inc)^	USD	–	1.588.831	–	1.588.831
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.482.983	1.992.749	(1.406.780)	14.068.952
	Klasse H (Inc) (Hedged) (Q)^	SGD	–	3.147.538	(10.059)	3.137.479
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse I (Inc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	59.277	(10.000)	49.277
	Klasse I (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling I (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling I (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse K (Acc)^	USD	–	81.834.050	(3.469.950)	78.364.100
	Klasse K (Acc) (Hedged)^	EUR	–	948.550	(948.550)	–
	Klasse K (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse K (Acc) (Hedged)^	AUD	–	10.000	–	10.000
	Klasse K (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse K (Inc) (M)^	USD	–	27.675.076	(49)	27.675.027
	Sterling K (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling K (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse L (Acc)^	USD	–	27.417.083	(2.972.359)	24.444.724
	Klasse L (Acc) (Hedged)^	EUR	–	12.958.411	(10.000)	12.948.411
	Klasse L (Inc)^	USD	–	6.123.663	(1.486.335)	4.637.328
	Klasse L (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling L (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)	USD	11.726.957	181.512.627	(1.582.021)	191.657.563
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	10.000	24.693.578	(11.131)	24.692.447
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	85.091.631	(428.643)	84.662.988
	Klasse W (Inc)^	USD	–	10.143.063	–	10.143.063
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	CHF	–	21.237.371	(433.521)	20.803.850
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	EUR	–	532.610	–	532.610
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	328.343	6.486.547	(221.650)	6.593.240
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	4.957.765	(7.490)	4.950.275
	Klasse X (Acc)	USD	39.259.788	–	(4.076)	39.255.712
	Klasse X (Acc)	JPY	53.642.694	50.137.205	(6.841.020)	96.938.879
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	270.562.492	12.624.206	(24.433.947)	258.752.751
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	38.887.925	10.764.844	(12.130.815)	37.521.954
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A	USD	1.680.577	95.884	(445.429)	1.331.032
	Klasse A	EUR	1.818.811	211.935	(964.313)	1.066.433
	Klasse A (Inc)	USD	189.431	2.898	–	192.329
	Klasse C	USD	100.034.845	13.772.177	(72.320.778)	41.486.244
	Klasse G (Acc)	EUR	53.189	868.359	–	921.548
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.253.737	909.095	(1.566.148)	1.596.684
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	315.615	237.261	(251.566)	301.310
	Klasse I (Hedged)	EUR	6.297.124	358.533	(5.310.458)	1.345.199
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	7.451.415	–	(1.573.977)	5.877.438
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	1.401.789	116.000	(322.930)	1.194.859
	Klasse W	USD	62.196.617	4.534.834	(57.304.984)	9.426.467
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	17.168	–	17.168
	Klasse W (Hedged)	EUR	36.517.204	1.906.478	(22.619.089)	15.804.593
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	2.612.478	3.301.724	(817.189)	5.097.013
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	6.306.175	858.469	(2.582.708)	4.581.936
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	19.574.750	9.115.055	(72.906)	28.616.899
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	88.235.063	716.032	(326.237)	88.624.858
	Sterling Z (Acc)	GBP	843.373	131.500	(104.980)	869.893
	Sterling Z (Inc)	GBP	372.679	34.864	(229.519)	178.024
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	10.639	–	–	10.639
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	11.169	622	(311)	11.480
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	169.733	505.466	(521.614)	153.585
	Klasse A	EUR	588.080	169.963	(179.523)	578.520
	Klasse A (Inc)	EUR	310.837	8.941	(11.562)	308.216
	Klasse B (Inc)	USD	171.300	135	(69.923)	101.512
	Klasse B (Inc)	EUR	87.558	10.400	(22.675)	75.283
	Klasse C	USD	45.000	–	–	45.000
	Klasse C (Acc)	USD	14.461.828	8.362.728	(13.642.254)	9.182.302
	Klasse C (Inc)	USD	63.957	66.775	(58.196)	72.536
	Klasse E (Acc)	USD	4.249.156	–	(1.971.097)	2.278.059
	Klasse E (Acc)	CHF	521.187	3.700	(222.260)	302.627
	Klasse H (Hedged)	EUR	371.394	46.905	(61.782)	356.517
	Klasse I (Hedged)	EUR	261.228	60.965	–	322.193
	Klasse W (Acc)	USD	90.579	6.095	(40.300)	56.374
	Klasse W (Acc)	EUR	3.484.582	193.267	(3.104.446)	573.403
	Klasse W (Inc)	USD	93.796	–	(3.015)	90.781
	Klasse W (Inc)	EUR	58.242	–	–	58.242

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Equity Income Fund						
	Klasse A	USD	7.964.547	6.803.125	(2.267.334)	12.500.338
	Klasse A	EUR	27.970.261	9.496.629	(12.198.704)	25.268.186
	Klasse A (Inc)	USD	1.908.381	904.741	(942.196)	1.870.926
	Klasse A (Inc)	EUR	6.722.750	3.910.081	(1.242.113)	9.390.718
	Sterling A (Acc)	GBP	166.071	46.295	(83.475)	128.891
	Klasse B	USD	3.660.074	388.745	(521.466)	3.527.353
	Klasse B	EUR	944.817	158.461	(214.118)	889.160
	Klasse B (Inc)	USD	2.470.450	70.579	(461.364)	2.079.665
	Klasse B (Inc)	EUR	1.053.272	735.395	(83.430)	1.705.237
	Sterling B (Inc)	GBP	661.435	10.341	(84.032)	587.744
	Klasse C	USD	25.495.698	2.448.544	(25.064.191)	2.880.051
	Klasse C	EUR	14.178.763	8.296.514	(3.909.103)	18.566.174
	Klasse C (Inc)	USD	1.355.853	2.498.229	(2.019.900)	1.834.182
	Klasse C (Inc)	EUR	17.406.154	–	(9.027.960)	8.378.194
	Sterling C (Inc)	GBP	470.414	12.864	(48.398)	434.880
	Klasse G (Acc)	EUR	1.682.601	3.496.999	(2.941.045)	2.238.555
	Klasse H (Hedged)	EUR	3.765.737	1.752.484	(2.400.020)	3.118.201
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	4.777.220	255.325	(722.307)	4.310.238
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.500.165	203.678	(156.678)	1.547.165
	Klasse W	USD	6.266.572	16.921.248	(18.870.311)	4.317.509
	Klasse W	EUR	43.305.001	16.003.817	(36.493.707)	22.815.111
	Klasse W (Acc)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	241.328	487.011	(98.322)	630.017
	Klasse W (Inc)	USD	12.928.258	328.265	(1.324.080)	11.932.443
	Klasse W (Inc)	EUR	11.665.929	461.379	(2.197.253)	9.930.055
	Sterling W (Acc)	GBP	860.011	801.002	(181.979)	1.479.034
	Sterling W (Inc)	GBP	13.099.983	2.873.734	(5.781.239)	10.192.478
	Klasse Z (Acc)	USD	2.175.181	–	(373.408)	1.801.773
	Klasse Z (Acc)	EUR	28.755	–	–	28.755
	Klasse Z (Inc)	USD	2.091.949	–	(147.120)	1.944.829
	Klasse Z (Inc)	EUR	354.535	11.500	(22.800)	343.235
	Sterling Z (Inc)	GBP	3.307.770	328.177	(751.589)	2.884.358
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	Klasse A	EUR	4.301.767	580.694	(1.017.295)	3.865.166
	Klasse C	USD	38.667.798	3.547.625	(7.989.700)	34.225.723
	Klasse C	EUR	9.342	–	–	9.342
	Klasse C (Inc)	USD	6.496	591	(296)	6.791
	Klasse H (Hedged)	EUR	817.508	576.093	(88.791)	1.304.810
	Klasse I (Hedged)	EUR	10.326.967	322.167	(78.921)	10.570.213
	Klasse W (Acc)	USD	1.167.196	366.830	(62.586)	1.471.440
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	806.750	157.640	(50.830)	913.560
	Klasse X (Inc)	USD	18.011.514	1.608.859	(2.647.531)	16.972.842
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	19.049.370	1.737.046	(2.099.211)	18.687.205

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	12.481	57.337	–	69.818
	Klasse A (Inc)	USD	381.654	–	(245.182)	136.472
	Klasse A (Inc)	EUR	1.178.815	95.626	(47.605)	1.226.836
	Klasse B (Acc)	SGD	896.935	16.543	(129.652)	783.826
	Klasse B (Acc)	USD	4.082.822	28.727	(1.230.573)	2.880.976
	Klasse B (Inc)	USD	20.601.410	886.123	(6.054.854)	15.432.679
	Klasse B (Inc)	SGD	3.301.302	18.235	(940.037)	2.379.500
	Klasse B (Inc) (M)	USD	5.476	23.290	(13.232)	15.534
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	5.471	555	(277)	5.749
	Klasse E (Inc)	USD	80.658.010	6.232.937	(25.812.075)	61.078.872
	Klasse E (Inc)	EUR	2.026.814	77.519	(1.939.328)	165.005
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	2.844.069	103.092	(404.678)	2.542.483
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	692.437	88.077	(60.677)	719.837
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.095.555	127.066	(31.111)	2.191.510
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1.108.960	25.899	(245.791)	889.068
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	17.474.335	1.313.665	(1.976.408)	16.811.592
	Klasse W (Acc)	USD	5.250.993	21.704	(5.182.928)	89.769
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.961	213.459	–	224.420
	Klasse W (Inc)	USD	5.875	144.598	(254)	150.219
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	12.802	1.107	(553)	13.356
BNY Mellon Global Leaders Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	386.215	31.924	(37.449)	380.690
	Klasse A (Acc)	EUR	2.292	–	–	2.292
	Klasse B (Acc)	USD	5.581.715	261.014	(5.127.322)	715.407
	Klasse C (Acc)	USD	2.735.778	15.202.234	(7.448.905)	10.489.107
	Klasse E (Acc)	USD	10.105.452	181.441	(2.928.861)	7.358.032
	Klasse E (Acc)	EUR	1.112.222	427.448	(414.788)	1.124.882
	Sterling E (Acc)	GBP	4.628.828	1.886.635	(848.422)	5.667.041
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	129.232	76.617	(18.309)	187.540
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	169.798	183.472	–	353.270
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	12.645	–	–	12.645
	Klasse W (Acc)	USD	480.133	201.036	(249.023)	432.146
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	12.751	–	–	12.751
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	12.475	–	–	12.475
	Sterling W (Acc)	GBP	1.969.232	3.207.856	(992.001)	4.185.087

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	1.637.112	1.014.787	(1.051.528)	1.600.371
	Klasse A	EUR	5.853.863	962.652	(1.272.942)	5.543.573
	Klasse B	USD	701.844	24	(32.234)	669.634
	Klasse C	USD	431.992	26.227	(141.760)	316.459
	Klasse C	EUR	48.610	15.052	(13.813)	49.849
	Klasse H (Hedged)	EUR	133.505	–	(816)	132.689
	Klasse I (Hedged)	EUR	5.923	–	–	5.923
	Klasse W (Acc)	USD	1.106	3.819	(1.106)	3.819
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A	EUR	490.810.230	21.824.054	(264.784.706)	247.849.578
	Klasse A (Inc)	EUR	15.403.277	863.547	(5.842.840)	10.423.984
	Klasse C	EUR	73.528.450	4.180.483	(41.309.042)	36.399.891
	Klasse C (Inc)	EUR	6.785.556	425.896	(5.724.362)	1.487.090
	Klasse G (Acc)	EUR	7.092.309	116.715	(5.544.248)	1.664.776
	Klasse G (Inc)	EUR	1.482.735	689	(1.187.686)	295.738
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	2.682.148	98.991	(1.587.571)	1.193.568
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	3.345.453	–	(1.735.917)	1.609.536
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1.125.034	4.687	(317.313)	812.408
	Klasse W	EUR	372.306.796	53.957.244	(133.006.434)	293.257.606
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	669.705	–	(239.277)	430.428
	Klasse W (Inc)	EUR	1.689.537	248.104	–	1.937.641
	Klasse X	EUR	463.754.981	12.815.094	(198.755.538)	277.814.537
	Klasse Z (Acc)	EUR	71.041.929	1.628.507	(56.431.870)	16.238.566
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
	Sterling B (Acc)	GBP	716.217	121.399	(422.381)	415.235
	Sterling B (Inc)	GBP	1.421.111	622.691	(313.638)	1.730.164
	Sterling C (Inc)	GBP	29.100	–	–	29.100
	Sterling W (Acc)	GBP	13.673.237	1.200.840	(7.915.564)	6.958.513
	Sterling W (Inc)	GBP	9.907.797	1.219.786	(7.589.893)	3.537.690
	Sterling X (Acc)	GBP	19.803.854	4.433.659	(7.012.033)	17.225.480
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
	Klasse A	USD	80.824.243	2.776.609	(30.249.983)	53.350.869
	Klasse C	USD	47.543.989	17.880.768	(44.721.990)	20.702.767
	Klasse C (Inc)^	USD	70.000	–	(70.000)	–
	Klasse G (Acc)	USD	335.650	–	(209.568)	126.082
	Klasse W	USD	8.151.494	591.110	(5.221.451)	3.521.153
	Klasse W (Inc)	USD	11.623.275	865.533	(4.267.500)	8.221.308
	Klasse X	USD	56.569.764	2.113.089	(14.314.671)	44.368.182

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.061.671	3.862.740	(1.927.526)	6.996.885
	Klasse A (Inc)	USD	526.976	2.975.107	(419.044)	3.083.039
	Klasse C (Acc)	USD	7.438.827	9.583.491	(1.656.792)	15.365.526
	Klasse G (Acc)	USD	415.710	7.175.801	(156.999)	7.434.512
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	57.032.855	45.756.172	(18.091.477)	84.697.550
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.302.689	5.216.702	(1.020.076)	6.499.315
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	CHF	–	1.381.400	(10.000)	1.371.400
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	13.175.037	25.409.885	(15.584.738)	23.000.184
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	5.169.256	5.353.329	(5.598.914)	4.923.671
	Klasse W (Acc)	USD	68.146.548	13.029.982	(7.027.477)	74.149.053
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1.511.521	946.215	(875.451)	1.582.285
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	134.310.866	106.536.233	(58.499.231)	182.347.868
	Klasse W (Inc)	USD	7.372.317	–	(314.769)	7.057.548
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1.442.898	30.591.674	(1.062.197)	30.972.375
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	27.465.162	50.437.998	(38.340.644)	39.562.516
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	4.189.975	7.320.744	(2.553.336)	8.957.383
	Klasse X (Acc)	USD	26.502.550	945.246	(12.834.059)	14.613.737
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	16.867.300	–	(5.263.879)	11.603.421
	Klasse Y (Acc)	USD	26.151.076	–	(5.422.420)	20.728.656
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	4.101.471	–	–	4.101.471
	Klasse Z (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	USD	731.150	–	(277.050)	454.100
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	409.394	138.888	(154.037)	394.245
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	57.815.367	12.456.406	(15.513.347)	54.758.426
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	464.525	641.309	(828.817)	277.017
	Klasse C	JPY	1.526.737	129.279	(1.171.638)	484.378
	Klasse C^	USD	25.486.694	15.039.081	(40.525.775)	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1.085.722	–	(10.200)	1.075.522
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	886.242	113.675	(995.366)	4.551
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	239.287	102.267	(81.859)	259.695
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	5.209	–	–	5.209
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	5.480	–	–	5.480
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.173.520	33.732	(340.655)	866.597
	Klasse H (Hedged)	USD	122.926	10.378	(26.216)	107.088
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.519.105	2.900.383	(4.299.012)	120.476
	Klasse I (Hedged)	USD	505.966	3.525	(505.966)	3.525
	Klasse W	JPY	28.857.278	9.365.980	(8.307.600)	29.915.658
	Klasse W (Acc)	EUR	25.226.957	–	(3.219.535)	22.007.422
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	510.498	–	(349.739)	160.759
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	5.272	–	–	5.272
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	5.526	–	–	5.526
	Sterling W (Acc)	GBP	1.569.221	418.232	(1.440.381)	547.072
	Sterling W (Inc)	GBP	4.586.990	24.207	(2.025.202)	2.585.995
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	19.951.600	(19.946.600)	5.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	22.418.930	–	22.418.930
	Klasse W (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund						
	Klasse A	EUR	74.315.353	36.655.065	(15.953.718)	95.016.700
	Klasse A	USD	25.581.285	4.413.618	(5.791.788)	24.203.115
	Klasse A (Inc)	EUR	2.096.166	376.537	(121.546)	2.351.157
	Sterling A (Acc)	GBP	1.342.363	40.582	(328.300)	1.054.645
	Klasse B	EUR	1.453.836	230.207	(430.654)	1.253.389
	Klasse B	USD	29.425.909	5.190.871	(3.723.242)	30.893.538
	Klasse B (Acc)	SGD	17.869.795	9.290.691	(2.715.535)	24.444.951
	Sterling B (Inc)	GBP	532.542	115.626	(254.582)	393.586
	Klasse C	EUR	33.109.996	18.651.852	(5.061.343)	46.700.505
	Klasse C	USD	21.461.797	24.841.446	(16.904.455)	29.398.788
	Klasse G (Acc)	EUR	2.632.848	2.823.768	(1.422.701)	4.033.915
	Klasse J (Acc) (Hedged)	JPY	1.178.838	1.647.274	–	2.826.112
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	3.772.219	783.122	(415.517)	4.139.824
	Klasse S	EUR	34.346.639	1.486.135	(13.030.341)	22.802.433
	Klasse S (Acc) 1	USD	24.404.326	108.330	(24.404.326)	108.330
	Klasse W	EUR	106.561.267	23.455.952	(23.941.025)	106.076.194
	Klasse W	USD	34.197.600	12.928.271	(11.529.537)	35.596.334
	Klasse W (Hedged)	USD	658.350	488	(216.812)	442.026
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	SEK	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	312.421	24.044.386	(1.964.534)	22.392.273
	Klasse W (Inc)	USD	12.187.778	8.577.716	(5.873.954)	14.891.540
	Sterling W (Acc)	GBP	4.971.885	886.561	(756.546)	5.101.900
	Sterling W (Inc)	GBP	529.394	2.218	(306.159)	225.453
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling X	GBP	3.647.568	–	(895.433)	2.752.135

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	23.064.756	1.467.775	(5.088.222)	19.444.309
	Klasse A (Acc)	EUR	53.523.217	3.494.764	(21.569.151)	35.448.830
	Klasse A (Inc)	USD	699.065	9.782	(29.805)	679.042
	Klasse A (Inc)	EUR	5.910.416	490.634	(1.362.662)	5.038.388
	Klasse B (Acc)	USD	20.647.981	77.910	(5.296.563)	15.429.328
	Klasse B (Acc)	SGD	648.250	33.943	(23.708)	658.485
	Klasse C (Acc)	USD	1.036.247	198.401	(328.016)	906.632
	Klasse C (Acc)	EUR	16.320.782	4.598.295	(11.137.816)	9.781.261
	Klasse C (Inc)	EUR	885.502	–	(38.000)	847.502
	Klasse E (Acc)	USD	53.210.646	1.469.517	(9.148.169)	45.531.994
	Klasse E (Acc)	CHF	13.626.756	498.516	(1.889.407)	12.235.865
	Klasse E (Acc)	EUR	5.859.056	175.235	(2.294.276)	3.740.015
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	14.538.997	1.349.873	(2.602.107)	13.286.763
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	14.210.369	1.685.248	(4.752.331)	11.143.286
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	6.900.020	231.426	(1.877.271)	5.254.175
	Klasse G (Acc)	USD	122.000	–	(7.000)	115.000
	Klasse G (Acc)	CHF	406.765	–	(52.000)	354.765
	Klasse G (Acc)	EUR	1.317.856	129.906	(1.069.011)	378.751
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	736.477	14.184	(310.571)	440.090
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	9.519	–	–	9.519
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	20.975.386	3.018.203	(5.124.415)	18.869.174
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	403.573	113.764	(104.595)	412.742
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	57.512	(57.512)	615.969
	Klasse K (Acc)	USD	14.335.215	511.935	(2.479.792)	12.367.358
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	2.697.636	80.202	(291.360)	2.486.478
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	11.753.745	225.997	(2.095.486)	9.884.256
	Klasse K (Acc) (Hedged)	SGD	1.427.155	–	(575.000)	852.155
	Klasse K (Inc)	USD	1.425.062	5.400	(659.370)	771.092
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	225.940	2.200	(65.315)	162.825
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	554.074	–	(102.571)	451.503
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	288.744	–	(1)	288.743
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	893.317	–	(34.446)	858.871
	Klasse W (Acc)	USD	25.524.921	7.057.374	(16.686.744)	15.895.551
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	626.696	–	(603.676)	23.020
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	44.779.303	6.256.322	(17.522.805)	33.512.820
	Sterling W (Acc)	GBP	1.539.060	702.438	(492.549)	1.748.949
	Klasse W (Inc)	USD	1.023.682	2.109	(123.008)	902.783
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	28.853	41	(20)	28.874
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund						
	Klasse A	EUR	2.350.657	494.767	(395.511)	2.449.913
	Klasse A	USD	127.213	68.623	(45.323)	150.513
	Klasse B	EUR	103.626	–	(19.648)	83.978
	Klasse C	EUR	3.590.168	364.435	(3.902.834)	51.769
	Klasse C^	USD	3.515	–	(3.515)	–
	Klasse W (Acc)	EUR	2.254.752	25.327.964	(4.600.517)	22.982.199

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*						
	Klasse A (Acc)^	USD	5.000	8.141	(13.141)	–
	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	102.782	85.485	(188.267)	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	SGD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse W (Acc)^	USD	31.403.221	–	(31.403.221)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	3.232.421	313.323	(1.439.520)	2.106.224
	Klasse A (Acc)	USD	195.195	–	–	195.195
	Klasse A (Inc)	EUR	1.232.000	57.829	–	1.289.829
	Klasse C (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse E (Acc)	EUR	85.221.952	–	(5.073.567)	80.148.385
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	13.672.390	579.026	(1.707.266)	12.544.150
	Klasse G (Acc)	EUR	1.245.158	109.100	(194.500)	1.159.758
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	405.656	–	(140.214)	265.442
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	10.000	–	(10.000)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)^	USD	10.000	309	(10.309)	–
	Klasse V (Acc)^	EUR	5.355	–	(5.355)	–
	Klasse W (Acc)	EUR	94.805.391	3.326.475	(37.241.869)	60.889.997
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	43.743.017	1.271.520	(10.709.398)	34.305.139
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	6.168.168	432.660	(1.147.320)	5.453.508
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	475.712	4.323	(6.680)	473.355
	Klasse W (Inc)	EUR	5.152	4.650.911	(223.857)	4.432.206
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	USD	–	146.339.806	(9.544.359)	136.795.447
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	364.488	626.618	(15.364)	975.742
	Klasse X (Acc)	EUR	92.201.686	–	(86.227.681)	5.974.005
	Klasse Z (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	EUR	5.155	262	(131)	5.286
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	727.500	11.046	(727.609)	10.937

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Acc)	EUR	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)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Sterling E (Inc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Acc)	USD	9.881.540	–	–	9.881.540
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Sterling W (Inc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*						
	Klasse A	USD	9.718.216	15.309.897	(15.607.730)	9.420.383
	Klasse A	EUR	1.465.868	8.505.276	(8.457.862)	1.513.282
	Klasse B	USD	3.341.417	–	(52.529)	3.288.888
	Klasse B	EUR	16.994	–	–	16.994
	Klasse C	USD	3.975.107	385.480	(1.187.183)	3.173.404
	Klasse I (Hedged)^	EUR	243.605	6.410	(250.015)	–
	Klasse W (Acc)	USD	20.195.045	6.419.844	(3.754.049)	22.860.840
	Klasse W (Acc)	EUR	180.538.554	22.041.263	(34.439.489)	168.140.328
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A (Acc)	EUR	31.337.358	1.861.955	(29.046.498)	4.152.815
	Klasse A (Inc)^	EUR	5.009	19	(5.028)	–
	Klasse E (Acc)	EUR	49.726.465	5.077.200	(44.077.601)	10.726.064
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1.174.769	–	(1.151.519)	23.250
	Klasse G (Acc)	EUR	5.373	164.543	(80.970)	88.946
	Klasse W (Acc)	EUR	6.061.342	151.398	(4.247.006)	1.965.734
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	321.005	38.591	(82.458)	277.138
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	214.103	22.203	(161.145)	75.161
	Klasse W (Inc)	EUR	5.078	101	(50)	5.129
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	11.660	236	(11.896)	–
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	66.656.752	265.989	–	66.922.741

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	947	(164)	5.783
	Klasse A (Acc)	EUR	4.931.148	790.138	(4.803.089)	918.197
	Klasse A (Inc)^	USD	–	6.040	(379)	5.661
	Klasse B (Inc)	USD	431.649	660.067	(891.400)	200.316
	Klasse C (Acc)	USD	49.616.806	4.655	(49.616.806)	4.655
	Klasse C (Inc)	USD	20.613.046	3.356	(20.613.046)	3.356
	Klasse E (Inc)	USD	1.956.046	110.450	(344.620)	1.721.876
	Klasse E (Inc)	EUR	114.240	53.410	(46.887)	120.763
	Sterling E (Acc)	GBP	5.384.166	1.882.971	(1.677.378)	5.589.759
	Sterling E (Inc)	GBP	79.739.701	65.471.541	(22.407.877)	122.803.365
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	2.972.560	3.367.557	(344.649)	5.995.468
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	176.756	2.688.423	(2.059.165)	806.014
	Klasse W (Acc)	USD	24.346.611	9.624.203	(1.380.367)	32.590.447
	Klasse W (Acc)	EUR	13.743.501	6.582.864	(5.260.305)	15.066.060
	Sterling W (Acc)	GBP	5.000	685.143	(149.201)	540.942
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Inc)	USD	6.000.000	7.935.612	(1.000.000)	12.935.612
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	12.266.682	4.517.855	(4.918.358)	11.866.179
	Sterling W (Inc)	GBP	4.705.019	11.619.925	(7.852.431)	8.472.513

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	781.356	2.442.975	(1.145.995)	2.078.336
	Klasse A (Inc)	USD	14.748	470.369	(289.217)	195.900
	Klasse A (Inc) (M)	USD	7.145	634.672	(303)	641.514
	Klasse C (Acc)	USD	115.216.320	9.325.616	(99.237.137)	25.304.799
	Klasse E (Acc)	USD	14.377.971	4.060.800	(1.205.000)	17.233.771
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	4.081.700	–	(2.100.000)	1.981.700
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	5.712.788	6.202.955	(524.000)	11.391.743
	Klasse G (Acc)	USD	135.460	282.395	–	417.855
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	AUD	–	10.000	(10.000)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	16.219.094	6.293.182	(6.705.813)	15.806.463
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	136.996	–	(36.607)	100.389
	Klasse H (Inc) (Hedged)^	AUD	–	10.363	(10.363)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	645.751	314.888	(402.583)	558.056
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	267.250	8.600	(24.500)	251.350
	Klasse W (Acc)	USD	265.857.664	22.751.706	(144.851.648)	143.757.722
	Klasse W (Acc)	EUR	10.673.372	6.383.070	(2.374.192)	14.682.250
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	28.195.493	10.304.792	(2.020.090)	36.480.195
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	138.442.823	132.487.637	(59.098.152)	211.832.308
	Klasse W (Inc)	USD	19.425.715	680.372	(17.302.920)	2.803.167
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	7.000.000	2.000.000	–	9.000.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	174.758.566	12.629.054	(3.617.820)	183.769.800
	Klasse W (Inc) (M)^	HKD	5.038	303	(5.341)	–
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	20.592	134.232	(24.094)	130.730
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	450.577	255.000	(57.000)	648.577
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	98.462.794	1.210.452	(13.084.117)	86.589.129
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	279.475	–	(178.464)	101.011
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*						
	Klasse E (Acc)^	USD	–	8.367.573	–	8.367.573
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse G (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Inc)^	USD	–	5.212	(106)	5.106
	Klasse W (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Inc)^	USD	–	51.043.701	–	51.043.701
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.444	(222)	10.222
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse X (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse G (Acc)	EUR	11.072.915	12.522.441	(3.760.650)	19.834.706
	Klasse W (Acc)	EUR	888.040.615	174.213.094	(185.743.912)	876.509.797
	Klasse W (Inc)	EUR	2.500.000	495.687	–	2.995.687
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.999	–	–	4.999
	Klasse Z (Acc)	EUR	270.472.003	38.918.599	(19.500.436)	289.890.166
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc)	EUR	5.000	7.709.440	(140.000)	7.574.440
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	10.000	–	–	10.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)	EUR	29.918.534	–	–	29.918.534
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	10.000	–	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000
	Klasse X (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	NOK	–	10.000	–	10.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	10.000	–	–	10.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	10.000	–	–	10.000

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Diese Anteilstklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2022 waren wie folgt:

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
	Klasse C	EUR	3.099	–	–	3.099
	Klasse R	EUR	39.203	19.480	(30.852)	27.831
	Klasse R (Hedged)	USD	8.581	14.091	(15.052)	7.620
	Klasse R (Inc)	EUR	4.969	6.485	(3.629)	7.825
	Klasse S	EUR	47.063	44.168	(62.242)	28.989
	Klasse T (Hedged)	CHF	133	–	–	133
	Klasse T (Hedged)	USD	78.701	33.825	–	112.526
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	94.740	817	(28.331)	67.226
	Klasse W (Acc)	EUR	1.238	7.054	(6.900)	1.392
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	8.302	–	(8.302)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	800.131	54.671	(97.331)	757.471
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	104	1	(105)	–
	Klasse X	EUR	1.237.435	43.785	(652.524)	628.696
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1.079.235	61.801	(91.304)	1.049.732
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	212.388	1.664.054	(398.304)	1.478.138
	Klasse R (Hedged)	CHF	17.026	330.339	–	347.365
	Klasse R (Hedged)	EUR	32.384.579	15.011.179	(11.224.385)	36.171.373
	Klasse R (Hedged)	USD	4.379.206	371.143	(1.919.068)	2.831.281
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	2.602.852	65.304	(411.766)	2.256.390
	Sterling R (Acc)	GBP	733.444	157.666	(218.013)	673.097
	Sterling S (Acc)	GBP	162.672	72.133	(27.482)	207.323
	Klasse T (Hedged)	EUR	21.435.787	9.572.490	(11.818.932)	19.189.345
	Klasse T (Hedged)	USD	588.862	–	–	588.862
	Klasse U (Hedged)	EUR	65.030.838	6.739.656	(7.154.016)	64.616.478
	Klasse U (Hedged)	USD	1.172.546	–	(771.428)	401.118
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	19	–	–	19
	Sterling U (Acc)	GBP	4.130.045	3.372.264	(1.324.451)	6.177.858
	Sterling X (Acc)	GBP	5.491.938	9.908.789	(5.706.776)	9.693.951
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund						
	Klasse F (Acc)	EUR	4.413.537	1.043.085	(1.798.364)	3.658.258
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	1.219.388	8.329.127	(8.411.986)	1.136.529
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	4.970.355	54.420.414	(15.883.312)	43.507.457
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	13.315.227	7.886.017	(3.914.561)	17.286.683
	Klasse R (Acc)	EUR	55.000	–	(5.000)	50.000
	Klasse U (Acc)	EUR	19.925.756	3.881	(9.947.569)	9.982.068
	Klasse U (Acc) (Hedged)	CHF	11.868.849	1.180.271	(1.388.027)	11.661.093
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	724.305	33.130	(25.386)	732.049
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.458	–	–	4.458
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	27.355.083	1.029.802	(10.254.055)	18.130.830

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Asian Income Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	980	29.299	–	30.279
	Klasse A (Inc)	USD	106.588	114	(5.241)	101.461
	Klasse A (Inc)	EUR	231.590	62.350	–	293.940
	Klasse B (Acc)	USD	107.267	–	(50.000)	57.267
	Klasse C (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	Klasse W (Acc)	EUR	7.880.006	7.353.880	(1.944.347)	13.289.539
	Klasse W (Inc)	EUR	635.375	21.061	(75.517)	580.919
	Klasse W (Inc)	USD	3.191.188	2.023	(207.170)	2.986.041
	Sterling W (Inc)	GBP	189.872	853	(23.146)	167.579
BNY Mellon Asian Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	3.915.250	914.375	(1.138.898)	3.690.727
	Klasse A	EUR	4.568.396	189.730	(411.903)	4.346.223
	Klasse B	USD	2.454.730	3	(74.043)	2.380.690
	Klasse B	EUR	115.437	3.864	–	119.301
	Klasse C	USD	200.511	–	(10.500)	190.011
	Klasse C	EUR	234.298	6.616	(7.805)	233.109
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	Klasse W	USD	582.842	–	(121.000)	461.842
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	11.318.042	7.135.783	(5.830.290)	12.623.535
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	533.373	(49.922)	488.451
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	14.069	(16.236)	2.833
	Klasse B (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)^	SGD	–	18.082	(7.260)	10.822
	Klasse B (Inc)^	SGD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse C (Acc)	USD	1.371.316	1.468.509	(740.145)	2.099.680
	Klasse E (Acc)	USD	430.058	214.540	(604.758)	39.840
	Klasse E (Acc)	EUR	10.206.413	7.631	(7.088.913)	3.125.131
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	914.077	12.614	(926.691)	–
	Klasse G (Acc)	USD	3.800.160	224.937	(3.693.548)	331.549
	Klasse G (Acc)	EUR	90.022	37.070	(90.022)	37.070
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	103.040	(10.000)	103.040
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	16.797.589	8.972.995	(10.178.553)	15.592.031
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	SGD	–	119.560	(4.559)	115.001
	Klasse K (Acc)	USD	727.905	–	(295.205)	432.700
	Klasse K (Acc)	EUR	1.759.212	216.910	(493.600)	1.482.522
	Klasse W (Acc)	USD	5.561.661	7.806.749	(5.726.386)	7.642.024
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	831.545	2.942.101	(825.048)	2.948.598

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Brazil Equity Fund						
	Klasse A	USD	9.066.902	2.257.204	(2.678.878)	8.645.228
	Klasse A	EUR	9.631.545	12.606.779	(13.442.524)	8.795.800
	Klasse B	USD	1.390.047	–	(165.240)	1.224.807
	Klasse B	EUR	105.398	–	–	105.398
	Sterling B (Acc)	GBP	57.255	386.355	(125.521)	318.089
	Klasse C	USD	5.540.611	479.692	(3.297.876)	2.722.427
	Klasse C	EUR	153.023	149.585	(125.861)	176.747
	Sterling C (Inc)	GBP	104.177	122.121	(94.608)	131.690
	Klasse G (Acc)	EUR	1.653.156	461.046	(461.046)	1.653.156
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.087.724	943.769	(1.217.679)	813.814
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	6.040.413	2.058.400	(5.520.159)	2.578.654
	Klasse W (Acc)	USD	635.496	93.105	(365.041)	363.560
	Klasse W (Acc)	EUR	419.856	5.074.828	(1.862.738)	3.631.946
	Sterling W (Acc)	GBP	3.285.973	4.082.151	(3.704.426)	3.663.698
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund						
	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
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	564.528	4.809.580	(4.270.090)	1.104.018
	Klasse A (Inc)	USD	262.812	57.796	(16.683)	303.925
	Klasse C (Acc)	USD	49.037.490	17.693.377	(17.059.204)	49.671.663
	Klasse G (Acc)	USD	329.575	467.446	(56.905)	740.116
	Klasse G (Acc)	EUR	293.119	1.591.089	(1.249.878)	634.330
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	7.358	–	–	7.358
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	34.666	21.163	(15.536)	40.293
	Klasse W (Acc)	USD	29.245.502	75.424.129	(31.938.457)	72.731.174
	Klasse W (Acc)	EUR	52.197.298	78.937.246	(18.239.416)	112.895.128
	Klasse W (Inc)	EUR	113.484.276	212.393	(23.910.009)	89.786.660
	Sterling W (Acc)	GBP	206.980	858.572	(5.000)	1.060.552
	Klasse X (Acc)	USD	90.043.924	–	(53.160.299)	36.883.625

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	USD	5.237	555	(277)	5.515
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	5.237	555	(277)	5.515
	Klasse E (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	54.234.902	1.541.287	(18.659.510)	37.116.679
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	31.445.702	41.435.654	(9.636.731)	63.244.625
	Klasse E (Inc)^	USD	5.237	555	(5.792)	–
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	EUR	11.516	1.250	(12.766)	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	23.542.838	3.362.165	(1.765.906)	25.139.097
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	11.517	28.408	(17.017)	22.908
	Klasse W (Acc)	USD	4.611	–	–	4.611
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	DKK	10.000	–	(10.000)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	10.000	–	–	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	10.000	–	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	30.384.953	12.620.909	(6.169.995)	36.835.867
	Klasse W (Inc)	USD	5.237	555	(277)	5.515
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	11.516	1.250	(625)	12.141
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.235.550	566.293	(445.579)	1.356.264
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	14.622.987	17.197.110	(2.273.741)	29.546.356
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	13.189	17.323.933	(1.148.559)	16.188.563
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	EUR	–	19.396	–	19.396

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	3.349.369	180.370	(2.884.004)	645.735
	Klasse C (Acc)	USD	9.220.946	1.388.714	(8.246.020)	2.363.640
	Klasse C (Inc)	USD	1.288.228	223	(980.533)	307.918
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	65.132.470	18.898.201	(2.720.645)	81.310.026
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	1.826.143	400.635	(1.612.636)	614.142
	Klasse N (Acc)	USD	5.000	21.248.579	(330.728)	20.922.851
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	10.000	291.375	–	301.375
	Klasse N (Inc) (M)	USD	5.056	257.110	(5.331)	256.835
	Klasse W (Acc)	USD	226.124.799	33.825.815	(103.313.168)	156.637.446
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	88.193	7.071.972	(1.692.521)	5.467.644
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.924	–	10.924
	Klasse W (Inc)	USD	5.097	507	(253)	5.351
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	9.456.481	6.500.614	(14.356)	15.942.739
	Klasse X (Acc)	USD	434.510.476	–	(129.021.314)	305.489.162
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	263.555.953	42.276.840	(161.175.241)	144.657.552
	Klasse X (Inc)	USD	505.106.556	17.007.171	(354.136.486)	167.977.241
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	67.945.780	27.663.518	(44.250.626)	51.358.672
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Inc)	USD	189.885	62.537	(44.069)	208.353
	Klasse A (Inc)	EUR	2.933.697	825.793	(444.744)	3.314.746
	Klasse C (Acc)	USD	52.437	4.243	(52.437)	4.243
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	35.721.661	4.405.535	(32.500.826)	7.626.370
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	73.213.511	16.226.912	(55.135.609)	34.304.814
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	96.060	8.979	(24.533)	80.506
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.031	–	–	13.031
	Klasse K (Acc)	USD	313.433	72.770	(317.779)	68.424
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	11.719	–	–	11.719
	Klasse L (Acc)	USD	218.352.549	594.649.086	(92.793.490)	720.208.145
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	41.385.713	361.954.327	(68.508.137)	334.831.903
	Klasse L (Inc)^	USD	–	888.766	(73.331)	815.435
	Klasse L (Inc) (Hedged)^	EUR	–	10.835	(417)	10.418
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	11.041	–	–	11.041
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	23.558.303	181.609.834	(14.245.438)	190.922.699
	Klasse W (Acc)	USD	13.893.024	–	–	13.893.024
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Inc)	USD	497.171	401.293	(892.738)	5.726
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	32.615.146	846.835	(30.416.048)	3.045.933
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	13.559.541	11.298	(13.559.909)	10.930
	Klasse X (Acc)	USD	75.664.822	5.736	(75.664.822)	5.736
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	45.068.678	26.076.994	(42.308.885)	28.836.787

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
	Klasse A	USD	204.621	27.672	(44.094)	188.199
	Klasse A	EUR	88.621	8.275	(21.048)	75.848
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	416	3	(181)	238
	Klasse B	USD	2.285	–	(920)	1.365
	Klasse C	USD	98.026	8.530	(36.994)	69.562
	Klasse C	EUR	81.495	49.284	(56.044)	74.735
	Klasse G (Inc)	USD	17.645	2.960	(14.723)	5.882
	Klasse H (Hedged)	EUR	80.026	12.653	(33.742)	58.937
	Klasse I (Hedged)	EUR	108.627	242.710	(263.808)	87.529
	Klasse W	USD	266.480	22.970	(169.641)	119.809
	Klasse W	EUR	7.956	6.036	(10.097)	3.895
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	369.348	27.851	(147.258)	249.941
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	870.924	489.558	(155.755)	1.204.727
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	70.000	25.000	–	95.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	211.550	–	(210.000)	1.550
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	29.408	552	(10.388)	19.572
	Klasse X	USD	1.073.480	–	(438.064)	635.416
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund						
	Klasse A	USD	452.907	24.381	(55.674)	421.614
	Klasse A	EUR	3.504.606	212.389	(828.418)	2.888.577
	Klasse C	USD	4.774.217	212.898	(623.236)	4.363.879
	Klasse C	EUR	2.771.531	27.919	(362.549)	2.436.901
	Klasse C (Inc)	USD	91.987	8.765	(92.103)	8.649
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	572.211	13.428	(171.683)	413.956
	Klasse W	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	2.759.885	168.330	–	2.928.215

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
	Klasse A	USD	5.732.435	35.710	(739.433)	5.028.712
	Klasse A	EUR	9.497.967	88.052	(1.739.992)	7.846.027
	Klasse A (Inc)	USD	19.645	41	(15.241)	4.445
	Klasse A (Inc)	EUR	2.080.900	60.522	(111.708)	2.029.714
	Sterling A (Acc)	GBP	177.050	5.378	–	182.428
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	Klasse C	USD	926.058	796.782	(1.064.731)	658.109
	Klasse C	EUR	579.900	178.392	(17.319)	740.973
	Klasse C (Inc)	USD	19.500	–	(3.500)	16.000
	Klasse C (Inc)	EUR	8.824.501	–	(8.814.500)	10.001
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	–	–	1.615
	Sterling C (Inc)	GBP	138.019	2.625	(48.485)	92.159
	Klasse H (Hedged)	EUR	4.769.813	6.434	(2.475.131)	2.301.116
	Klasse I (Hedged)	EUR	3.923.936	959.306	(1.870.309)	3.012.933
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	Klasse W	USD	86.576.634	286.115	(85.530.963)	1.331.786
	Klasse W	EUR	2.476.227	539.212	(1.194.213)	1.821.226
	Klasse W (Hedged)	EUR	781.327	24.448	(457.081)	348.694
	Klasse W (Inc)	EUR	767.287	–	–	767.287
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	14.349	1.534	(767)	15.116
	Sterling W (Inc)	GBP	645.620	428.793	(650.755)	423.658
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	37.752	24.372	(25.899)	36.225
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
	Klasse A	EUR	52.363	12.781	(19.212)	45.932
	Klasse C	USD	256.500	–	–	256.500
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	29.629.485	4.947.473	(3.051.226)	31.525.732
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	52.993.848	10.770	(7.544.072)	45.460.546
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.965	–	–	13.965
	Klasse W (Acc)	USD	59.705.044	5.889	(59.705.044)	5.889
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	7.349	–	–	7.349
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	253.038	30.268	(10.966)	272.340
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Euroland Bond Fund						
	Klasse A	EUR	64.403.443	2.170.182	(13.819.046)	52.754.579
	Klasse A (Inc)	EUR	5.714.591	451.541	(1.703.494)	4.462.638
	Klasse B	EUR	56.010	975.138	(1.026.460)	4.688
	Klasse B (Inc)	EUR	16.640	–	–	16.640
	Klasse C	EUR	18.242.106	219.806	(8.959.351)	9.502.561
	Klasse C (Inc)	EUR	1.863.524	777	(159.189)	1.705.112
	Klasse G (Acc)	EUR	1.528.070	–	(132.614)	1.395.456
	Klasse H (Hedged)	CHF	2.716.395	34.090	(1.638.707)	1.111.778
	Klasse I (Hedged)	CHF	7.488.461	546.500	(3.051.124)	4.983.837
	Klasse W (Acc)	EUR	60.917.704	8.087.798	(20.603.638)	48.401.864
	Klasse Z^	EUR	13.802.953	4.086.028	(4.898.375)	12.990.606
BNY Mellon European Credit Fund						
	Klasse A	EUR	7.901	343	(2.088)	6.156
	Klasse C	EUR	49.331	8.198	(15.003)	42.526
	Klasse W (Acc)	EUR	1.088	36	–	1.124
	Klasse X	EUR	239.891	156.450	(75.187)	321.154
BNY Mellon Food Innovation Fund^c						
	Klasse E (Acc)	EUR	400.000	4.319	(400.000)	4.319
	Klasse W (Acc)	USD	2.000.000	–	–	2.000.000
BNY Mellon Future Earth Fund						
	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
BNY Mellon Future Life Fund						
	Klasse E (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse W (Acc)	USD	2.000.000	–	–	2.000.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Bond Fund						
	Klasse A	USD	35.875.415	3.108.698	(3.358.477)	35.625.636
	Klasse A	EUR	12.387.234	721.281	(2.724.119)	10.384.396
	Klasse B	USD	713.688	41.915	(43.988)	711.615
	Klasse C	USD	45.019.962	10.390.935	(3.487.722)	51.923.175
	Klasse C	EUR	46.343.993	17.804.271	(14.444.956)	49.703.308
	Klasse C (Inc)	USD	509.422	93.500	(112.000)	490.922
	Sterling C (Inc)	GBP	2.722.146	656.284	(1.055.603)	2.322.827
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.419.123	153.635	(752.191)	820.567
	Klasse I (Hedged)	EUR	521.312	853.805	(86.093)	1.289.024
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	13.695	–	–	13.695
	Klasse W (Acc)	USD	41.728.322	13.093.872	(21.947.667)	32.874.527
	Klasse W (Acc)	EUR	5.000	110.453	(11.581)	103.872
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	3.411.614	(110.624)	3.300.990
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.063	(10.063)	–
	Klasse X	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	2.432.991	381.426	(1.989.360)	825.057
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	10.894.686	37.051.952	(1.979.389)	45.967.249
BNY Mellon Global Credit Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	110	(100)	5.010
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.427.515	1.400.366	(1.344.898)	13.482.983
	Klasse W (Acc)	USD	2.148.028	11.710.079	(2.131.150)	11.726.957
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	–	10.000	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	331.235	191.313	(194.205)	328.343
	Klasse X (Acc)	USD	37.538.763	39.259.788	(37.538.763)	39.259.788
	Klasse X (Acc)	JPY	21.508.752	50.828.237	(18.694.295)	53.642.694
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	270.562.492	–	–	270.562.492
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	65.057.007	19.339.172	(45.508.254)	38.887.925

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A	USD	2.157.242	699.683	(1.176.348)	1.680.577
	Klasse A	EUR	1.043.816	3.842.775	(3.067.780)	1.818.811
	Klasse A (Inc)	USD	178.771	10.660	–	189.431
	Klasse C	USD	129.163.919	28.645.288	(57.774.362)	100.034.845
	Klasse G (Acc)	EUR	53.189	–	–	53.189
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.795.131	211.555	(752.949)	2.253.737
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	325.912	–	(10.297)	315.615
	Klasse I (Hedged)	EUR	6.549.517	167.033	(419.426)	6.297.124
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	10.000	7.451.415	(10.000)	7.451.415
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	1.448.545	216.250	(263.006)	1.401.789
	Klasse W	USD	89.193.166	1.611.392	(28.607.941)	62.196.617
	Klasse W (Hedged)	EUR	65.376.524	325.964	(29.185.284)	36.517.204
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	10.563.900	678.855	(8.630.277)	2.612.478
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	7.687.594	967.868	(2.349.287)	6.306.175
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	19.634.887	–	(60.137)	19.574.750
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	9.911.780	78.495.446	(172.163)	88.235.063
	Sterling Z (Acc)	GBP	1.241.494	97.042	(495.163)	843.373
	Sterling Z (Inc)	GBP	68.000	304.679	–	372.679
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	10.639	–	–	10.639
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	10.909	520	(260)	11.169
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	229.548	7.363.072	(7.422.887)	169.733
	Klasse A	EUR	689.789	176.970	(278.679)	588.080
	Klasse A (Inc)	EUR	286.657	825.694	(801.514)	310.837
	Klasse B (Inc)	USD	169.254	2.046	–	171.300
	Klasse B (Inc)	EUR	103.575	285	(16.302)	87.558
	Klasse C	USD	140.597	–	(95.597)	45.000
	Klasse C (Acc)	USD	16.439.952	245.358	(2.223.482)	14.461.828
	Klasse C (Inc)	USD	64.752	706	(1.501)	63.957
	Klasse E (Acc)	USD	4.179.521	1.260.055	(1.190.420)	4.249.156
	Klasse E (Acc)	CHF	731.570	15.273	(225.656)	521.187
	Klasse H (Hedged)	EUR	423.747	11.396	(63.749)	371.394
	Klasse I (Hedged)	EUR	385.932	22.546	(147.250)	261.228
	Klasse W (Acc)	USD	79.139	43.012	(31.572)	90.579
	Klasse W (Acc)	EUR	4.547.498	545.577	(1.608.493)	3.484.582
	Klasse W (Inc)	USD	146.564	–	(52.768)	93.796
	Klasse W (Inc)	EUR	58.242	–	–	58.242

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Equity Income Fund						
	Klasse A	USD	8.632.468	5.000.847	(5.668.768)	7.964.547
	Klasse A	EUR	17.477.593	16.313.491	(5.820.823)	27.970.261
	Klasse A (Inc)	USD	2.879.440	226.909	(1.197.968)	1.908.381
	Klasse A (Inc)	EUR	4.321.833	3.003.508	(602.591)	6.722.750
	Sterling A (Acc)	GBP	127.696	44.508	(6.133)	166.071
	Klasse B	USD	4.527.348	93.694	(960.968)	3.660.074
	Klasse B	EUR	938.022	240.138	(233.343)	944.817
	Klasse B (Inc)	USD	3.174.498	138.002	(842.050)	2.470.450
	Klasse B (Inc)	EUR	1.523.654	79.611	(549.993)	1.053.272
	Sterling B (Inc)	GBP	584.261	108.528	(31.354)	661.435
	Klasse C	USD	17.562.091	12.911.356	(4.977.749)	25.495.698
	Klasse C	EUR	5.161.949	11.907.589	(2.890.775)	14.178.763
	Klasse C (Inc)	USD	7.855.910	121.355	(6.621.412)	1.355.853
	Klasse C (Inc)	EUR	16.633.132	4.924.241	(4.151.219)	17.406.154
	Sterling C (Inc)	GBP	514.521	9.554	(53.661)	470.414
	Klasse G (Acc)	EUR	113.076	2.482.357	(912.832)	1.682.601
	Klasse H (Hedged)	EUR	3.270.807	1.502.046	(1.007.116)	3.765.737
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	6.162.837	2.631.898	(4.017.515)	4.777.220
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.377.823	748.676	(626.334)	1.500.165
	Klasse W	USD	2.284.584	6.164.877	(2.182.889)	6.266.572
	Klasse W	EUR	16.024.725	30.110.039	(2.829.763)	43.305.001
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	86.976	159.007	(4.655)	241.328
	Klasse W (Inc)	USD	13.638.271	375.443	(1.085.456)	12.928.258
	Klasse W (Inc)	EUR	13.211.162	276.372	(1.821.605)	11.665.929
	Sterling W (Acc)	GBP	1.106.252	93.431	(339.672)	860.011
	Sterling W (Inc)	GBP	14.118.055	1.206.181	(2.224.253)	13.099.983
	Klasse Z (Acc)	USD	2.176.934	15.700	(17.453)	2.175.181
	Klasse Z (Acc)	EUR	37.303	–	(8.548)	28.755
	Klasse Z (Inc)	USD	2.067.949	30.000	(6.000)	2.091.949
	Klasse Z (Inc)	EUR	469.873	44.620	(159.958)	354.535
	Sterling Z (Inc)	GBP	3.203.963	690.309	(586.502)	3.307.770
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	Klasse A	EUR	4.607.908	939.753	(1.245.894)	4.301.767
	Klasse C	USD	43.045.617	1.811.641	(6.189.460)	38.667.798
	Klasse C	EUR	342.186	693	(333.537)	9.342
	Klasse C (Inc)	USD	398.288	13.179	(404.971)	6.496
	Klasse H (Hedged)	EUR	971.517	155.685	(309.694)	817.508
	Klasse I (Hedged)	EUR	8.129.555	2.200.000	(2.588)	10.326.967
	Klasse W (Acc)	USD	23.338.871	906.768	(23.078.443)	1.167.196
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	884.225	93.720	(171.195)	806.750
	Klasse X (Inc)	USD	20.557.004	1.693.735	(4.239.225)	18.011.514
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	20.197.917	2.697.438	(3.845.985)	19.049.370

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	4.952	12.481	(4.952)	12.481
	Klasse A (Inc)	USD	452.024	162.646	(233.016)	381.654
	Klasse A (Inc)	EUR	25.905	1.185.092	(32.182)	1.178.815
	Klasse B (Acc)	SGD	17.435.190	11.886.762	(28.425.017)	896.935
	Klasse B (Acc)	USD	4.962.560	850.672	(1.730.410)	4.082.822
	Klasse B (Inc)	USD	17.221.401	9.168.967	(5.788.958)	20.601.410
	Klasse B (Inc)	SGD	14.384.841	4.015.794	(15.099.333)	3.301.302
	Klasse B (Inc) (M)	USD	5.190	572	(286)	5.476
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	5.185	572	(286)	5.471
	Klasse E (Inc)	USD	52.738.071	40.152.056	(12.232.117)	80.658.010
	Klasse E (Inc)	EUR	3.971.188	156.388	(2.100.762)	2.026.814
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	53.918.434	401.358	(51.475.723)	2.844.069
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	672.520	74.216	(54.299)	692.437
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1.030.435	1.071.987	(6.867)	2.095.555
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1.180.550	614.658	(686.248)	1.108.960
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	6.999.284	12.111.087	(1.636.036)	17.474.335
	Klasse W (Acc)	USD	17.375.301	22.789.096	(34.913.404)	5.250.993
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	97.287	10.961	(97.287)	10.961
	Klasse W (Inc)	USD	6.421.308	1.798.548	(8.213.981)	5.875
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	17.900.000	13.247	(17.900.445)	12.802
BNY Mellon Global Leaders Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	1.028.852	44.780	(687.417)	386.215
	Klasse A (Acc)	EUR	6.122	1.170	(5.000)	2.292
	Klasse B (Acc)	USD	6.360.491	728.944	(1.507.720)	5.581.715
	Klasse C (Acc)	USD	2.957.410	–	(221.632)	2.735.778
	Klasse E (Acc)	USD	12.962.067	5.540.728	(8.397.343)	10.105.452
	Klasse E (Acc)	EUR	986.680	125.542	–	1.112.222
	Sterling E (Acc)	GBP	4.096.787	878.016	(345.975)	4.628.828
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	DKK	11.058	–	(11.058)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	130.114	13.867	(14.749)	129.232
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	116.063	66.660	(12.925)	169.798
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	12.645	–	–	12.645
	Klasse W (Acc)	USD	627.264	50.634	(197.765)	480.133
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	DKK	10.320	–	(10.320)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	12.751	–	–	12.751
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	12.475	–	–	12.475
	Sterling W (Acc)	GBP	1.338.995	992.325	(362.088)	1.969.232

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	1.913.919	1.510.146	(1.786.953)	1.637.112
	Klasse A	EUR	6.369.373	2.300.492	(2.816.002)	5.853.863
	Klasse B	USD	705.324	–	(3.480)	701.844
	Klasse C	USD	252.060	233.834	(53.902)	431.992
	Klasse C	EUR	54.610	3.000	(9.000)	48.610
	Klasse H (Hedged)	EUR	130.204	14.999	(11.698)	133.505
	Klasse I (Hedged)	EUR	14.931	5.923	(14.931)	5.923
	Klasse W (Acc)	USD	2.206	365	(1.465)	1.106
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A	EUR	640.480.167	99.425.926	(249.095.863)	490.810.230
	Klasse A (Inc)	EUR	20.214.902	1.504.923	(6.316.548)	15.403.277
	Klasse C	EUR	105.822.650	31.725.166	(64.019.366)	73.528.450
	Klasse C (Inc)	EUR	7.210.261	2.064.071	(2.488.776)	6.785.556
	Klasse G (Acc)	EUR	21.809.553	4.576.592	(19.293.836)	7.092.309
	Klasse G (Inc)	EUR	4.479.457	51.950	(3.048.672)	1.482.735
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	4.009.858	40.113	(1.367.823)	2.682.148
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	3.737.797	235.451	(627.795)	3.345.453
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1.313.985	62.165	(251.116)	1.125.034
	Klasse W	EUR	479.412.732	48.785.810	(155.891.746)	372.306.796
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	745.506	21.064	(96.865)	669.705
	Klasse W (Inc)	EUR	1.775.114	101.593	(187.170)	1.689.537
	Klasse X	EUR	602.270.601	15.861.304	(154.376.924)	463.754.981
	Klasse Z (Acc)	EUR	108.462.802	18.073.847	(55.494.720)	71.041.929
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
	Sterling B (Acc)	GBP	940.497	69.892	(294.172)	716.217
	Sterling B (Inc)	GBP	517.158	909.958	(6.005)	1.421.111
	Sterling C (Inc)	GBP	165.290	–	(136.190)	29.100
	Sterling W (Acc)	GBP	13.912.665	3.969.279	(4.208.707)	13.673.237
	Sterling W (Inc)	GBP	9.609.641	1.664.671	(1.366.515)	9.907.797
	Sterling X (Acc)	GBP	20.657.612	5.132.388	(5.986.146)	19.803.854
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
	Klasse A	USD	98.224.273	10.618.647	(28.018.677)	80.824.243
	Klasse C	USD	51.669.781	26.027.995	(30.153.787)	47.543.989
	Klasse C (Inc)	USD	78.993	–	(8.993)	70.000
	Klasse G (Acc)	USD	167.629	168.021	–	335.650
	Klasse W	USD	16.377.518	1.212.992	(9.439.016)	8.151.494
	Klasse W (Inc)	USD	10.597.614	2.353.944	(1.328.283)	11.623.275
	Klasse X	USD	60.789.588	9.379.956	(13.599.780)	56.569.764

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	4.444.070	1.400.816	(783.215)	5.061.671
	Klasse A (Inc)	USD	730.201	321.539	(524.764)	526.976
	Klasse C (Acc)	USD	8.093.709	992.373	(1.647.255)	7.438.827
	Klasse G (Acc)	USD	393.972	3.919.618	(3.897.880)	415.710
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	79.878.658	12.865.284	(35.711.087)	57.032.855
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.341.515	756.006	(794.832)	2.302.689
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	9.318.677	11.411.391	(7.555.031)	13.175.037
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	3.020.451	2.404.140	(255.335)	5.169.256
	Klasse W (Acc)	USD	66.055.735	19.651.131	(17.560.318)	68.146.548
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	963.907	978.279	(430.665)	1.511.521
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	97.251.137	62.320.410	(25.260.681)	134.310.866
	Klasse W (Inc)	USD	7.937.115	596.313	(1.161.111)	7.372.317
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	903.000	849.053	(309.155)	1.442.898
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	32.726.257	16.077.654	(21.338.749)	27.465.162
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	3.995.377	1.545.647	(1.351.049)	4.189.975
	Klasse X (Acc)	USD	34.086.600	–	(7.584.050)	26.502.550
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	22.597.300	–	(5.730.000)	16.867.300
	Klasse Y (Acc)	USD	142.509.006	363.653	(116.721.583)	26.151.076
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	7.388.586	–	(3.287.115)	4.101.471
	Klasse Z (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	USD	736.298	122	(5.270)	731.150
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	2.610.227	35.668	(2.236.501)	409.394
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	87.571.731	15.727.945	(45.484.309)	57.815.367
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	354.805	1.367.724	(1.258.004)	464.525
	Klasse C	JPY	1.733.759	570.984	(778.006)	1.526.737
	Klasse C	USD	5.000	30.727.596	(5.245.902)	25.486.694
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1.626.200	15.522	(556.000)	1.085.722
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1.489.027	36.807	(639.592)	886.242
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	227.083	29.652	(17.448)	239.287
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	5.209	–	–	5.209
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	5.480	–	–	5.480
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.125.319	194.098	(1.145.897)	1.173.520
	Klasse H (Hedged)	USD	225.640	160.835	(263.549)	122.926
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.265.914	76.251	(823.060)	1.519.105
	Klasse I (Hedged)	USD	9.070.070	40.357	(8.604.461)	505.966
	Klasse W	JPY	20.183.607	8.673.671	–	28.857.278
	Klasse W (Acc)	EUR	25.259.508	44.232	(76.783)	25.226.957
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	596.129	10.266	(95.897)	510.498
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	5.272	–	–	5.272
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	5.526	–	–	5.526
	Sterling W (Acc)	GBP	1.274.796	750.379	(455.954)	1.569.221
	Sterling W (Inc)	GBP	5.825.581	88.363	(1.326.954)	4.586.990
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund						
	Klasse A	EUR	82.039.409	19.937.700	(27.661.756)	74.315.353
	Klasse A	USD	28.759.128	2.246.188	(5.424.031)	25.581.285
	Klasse A (Inc)	EUR	2.078.509	273.061	(255.404)	2.096.166
	Sterling A (Acc)	GBP	1.330.125	217.302	(205.064)	1.342.363
	Klasse B	EUR	1.285.197	5.287.020	(5.118.381)	1.453.836
	Klasse B	USD	28.208.913	10.208.346	(8.991.350)	29.425.909
	Klasse B (Acc)	SGD	18.020.362	4.325.875	(4.476.442)	17.869.795
	Sterling B (Inc)	GBP	745.167	64.325	(276.950)	532.542
	Klasse C	EUR	47.159.199	1.527.493	(15.576.696)	33.109.996
	Klasse C	USD	46.979.468	366.223	(25.883.894)	21.461.797
	Klasse G (Acc)	EUR	2.032.270	880.806	(280.228)	2.632.848
	Klasse J (Acc) (Hedged)	JPY	10.000	1.178.838	(10.000)	1.178.838
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	4.250.185	802.258	(1.280.224)	3.772.219
	Klasse S	EUR	44.217.923	1.008.272	(10.879.556)	34.346.639
	Klasse S (Acc) 1	USD	28.398.255	–	(3.993.929)	24.404.326
	Klasse W	EUR	104.267.223	13.924.604	(11.630.560)	106.561.267
	Klasse W	USD	36.044.245	7.608.534	(9.455.179)	34.197.600
	Klasse W (Hedged)	USD	3.891.901	700.341	(3.933.892)	658.350
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	362.225	–	(49.804)	312.421
	Klasse W (Inc)	USD	12.732.853	178.230	(723.305)	12.187.778
	Sterling W (Acc)	GBP	6.217.177	995.678	(2.240.970)	4.971.885
	Sterling W (Inc)	GBP	5.916.905	291.083	(5.678.594)	529.394
	Klasse X (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling X	GBP	4.856.011	–	(1.208.443)	3.647.568

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	26.781.765	4.045.208	(7.762.217)	23.064.756
	Klasse A (Acc)	EUR	55.444.644	13.386.747	(15.308.174)	53.523.217
	Klasse A (Inc)	USD	712.935	92.557	(106.427)	699.065
	Klasse A (Inc)	EUR	6.597.392	1.249.692	(1.936.668)	5.910.416
	Klasse B (Acc)	USD	14.654.836	9.188.088	(3.194.943)	20.647.981
	Klasse B (Acc)	SGD	255.652	638.313	(245.715)	648.250
	Klasse C (Acc)	USD	2.785.805	306.892	(2.056.450)	1.036.247
	Klasse C (Acc)	EUR	11.339.737	8.357.437	(3.376.392)	16.320.782
	Klasse C (Inc)	EUR	997.502	–	(112.000)	885.502
	Klasse E (Acc)	USD	105.209.078	14.304.742	(66.303.174)	53.210.646
	Klasse E (Acc)	CHF	15.110.871	588.582	(2.072.697)	13.626.756
	Klasse E (Acc)	EUR	7.588.662	747.281	(2.476.887)	5.859.056
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	15.988.184	1.199.456	(2.648.643)	14.538.997
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	28.145.140	1.498.834	(15.433.605)	14.210.369
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	6.942.095	1.659.658	(1.701.733)	6.900.020
	Klasse G (Acc)	USD	140.221	7.000	(25.221)	122.000
	Klasse G (Acc)	CHF	488.275	14.890	(96.400)	406.765
	Klasse G (Acc)	EUR	203.045	1.358.754	(243.943)	1.317.856
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	411.199	360.196	(34.918)	736.477
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	109.519	–	(100.000)	9.519
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	22.861.050	3.391.613	(5.277.277)	20.975.386
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	556.433	12.900	(165.760)	403.573
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	122.196	(122.196)	615.969
	Klasse K (Acc)	USD	18.016.457	970.970	(4.652.212)	14.335.215
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	2.864.699	121.615	(288.678)	2.697.636
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	14.881.332	1.653.824	(4.781.411)	11.753.745
	Klasse K (Acc) (Hedged)	SGD	1.883.194	4.844	(460.883)	1.427.155
	Klasse K (Inc)	USD	2.016.023	–	(590.961)	1.425.062
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	257.039	9.750	(40.849)	225.940
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	660.331	36.474	(142.731)	554.074
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	357.856	–	(69.112)	288.744
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	1.317.345	17.246	(441.274)	893.317
	Klasse W (Acc)	USD	83.538.095	9.219.726	(67.232.900)	25.524.921
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	834.318	64.015	(271.637)	626.696
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	46.174.423	11.064.371	(12.459.491)	44.779.303
	Sterling W (Acc)	GBP	202.888	1.341.172	(5.000)	1.539.060
	Klasse W (Inc)	USD	714.064	309.618	–	1.023.682
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	35.301	–	(6.448)	28.853
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund						
	Klasse A	EUR	2.490.314	272.512	(412.169)	2.350.657
	Klasse A	USD	145.151	12.512	(30.450)	127.213
	Klasse B	EUR	103.741	–	(115)	103.626
	Klasse C	EUR	3.552.451	754.378	(716.661)	3.590.168
	Klasse C	USD	12.822.774	–	(12.819.259)	3.515
	Klasse W (Acc)	EUR	8.612.480	3.669.303	(10.027.031)	2.254.752

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	26	(26)	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	6.832	(4.050)	102.782
	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	27.005.131	–	31.403.221
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	6.904.121	133.922	(3.805.622)	3.232.421
	Klasse A (Acc)	USD	664.739	–	(469.544)	195.195
	Klasse A (Inc)	EUR	1.237.080	48	(5.128)	1.232.000
	Klasse C (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc)	EUR	85.228.803	–	(6.851)	85.221.952
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	13.397.745	1.308.857	(1.034.212)	13.672.390
	Klasse G (Acc)	EUR	2.531.256	259.800	(1.545.898)	1.245.158
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	730.656	–	(325.000)	405.656
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Klasse V (Acc)^	EUR	–	10.097.865	(10.092.510)	5.355
	Klasse W (Acc)	EUR	65.508.280	50.038.504	(20.741.393)	94.805.391
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	41.229.155	5.340.524	(2.826.662)	43.743.017
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	6.003.874	1.891.252	(1.726.958)	6.168.168
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	508.248	6.680	(39.216)	475.712
	Klasse W (Inc)	EUR	5.055	194	(97)	5.152
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	398.035	16.699	(50.246)	364.488
	Klasse X (Acc)	EUR	92.606.686	–	(405.000)	92.201.686
	Klasse Z (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	EUR	5.051	209	(105)	5.155
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	737.994	194	(10.688)	727.500

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	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)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling E (Inc)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)^	USD	–	9.881.540	–	9.881.540
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Sterling W (Inc)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund^c						
	Klasse A	USD	10.125.709	22.874.366	(23.281.859)	9.718.216
	Klasse A	EUR	2.532.951	13.386.312	(14.453.395)	1.465.868
	Klasse B	USD	3.359.133	–	(17.716)	3.341.417
	Klasse B	EUR	39.994	–	(23.000)	16.994
	Klasse C	USD	4.091.744	479.291	(595.928)	3.975.107
	Klasse I (Hedged)	EUR	243.605	–	–	243.605
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	14.885	9.642.667	(9.657.552)	–
	Klasse W (Acc)	USD	22.101.058	4.828.174	(6.734.187)	20.195.045
	Klasse W (Acc)	EUR	180.343.516	29.924.039	(29.729.001)	180.538.554
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A (Acc)	EUR	17.396.217	22.821.830	(8.880.689)	31.337.358
	Klasse A (Inc)	EUR	5.006	6	(3)	5.009
	Klasse E (Acc)	EUR	31.576.141	24.000.865	(5.850.541)	49.726.465
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1.333.769	1.200	(160.200)	1.174.769
	Klasse G (Acc)	EUR	5.373	–	–	5.373
	Klasse W (Acc)	EUR	17.072.030	4.914.574	(15.925.262)	6.061.342
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	105.514	231.690	(16.199)	321.005
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	270.520	47.582	(103.999)	214.103
	Klasse W (Inc)	EUR	5.037	83	(42)	5.078
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	11.568	183	(91)	11.660
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	66.384.172	272.580	–	66.656.752

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	Klasse A (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Acc)	EUR	48.010	7.284.669	(2.401.531)	4.931.148
	Klasse B (Inc)	USD	41.667	525.411	(135.429)	431.649
	Klasse C (Acc)	USD	37.005.000	21.385.317	(8.773.511)	49.616.806
	Klasse C (Inc)	USD	3.789	22.091.964	(1.482.707)	20.613.046
	Klasse E (Inc)	USD	1.333.672	1.722.519	(1.100.145)	1.956.046
	Klasse E (Inc)	EUR	106.340	64.400	(56.500)	114.240
	Sterling E (Acc)	GBP	20.397.502	4.537.715	(19.551.051)	5.384.166
	Sterling E (Inc)	GBP	73.539.402	22.807.557	(16.607.258)	79.739.701
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1.235.800	1.747.042	(10.282)	2.972.560
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	176.756	–	176.756
	Klasse W (Acc)	USD	24.689.156	663.010	(1.005.555)	24.346.611
	Klasse W (Acc)	EUR	14.803.548	4.841.004	(5.901.051)	13.743.501
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Inc)	USD	8.175.000	2.052.368	(4.227.368)	6.000.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	12.303.527	(36.845)	12.266.682
	Sterling W (Inc)	GBP	1.284.748	5.430.682	(2.010.411)	4.705.019

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	1.027.356	596.151	(842.151)	781.356
	Klasse A (Inc)	USD	5.000	17.559	(7.811)	14.748
	Klasse A (Inc) (M)	USD	5.121	3.976	(1.952)	7.145
	Klasse C (Acc)	USD	112.037.419	48.494.896	(45.315.995)	115.216.320
	Klasse E (Acc)	USD	25.042.353	2.532.046	(13.196.428)	14.377.971
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	4.509.500	350.000	(777.800)	4.081.700
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	6.516.000	1.020.000	(1.823.212)	5.712.788
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	EUR	8.370.108	11.543	(8.381.651)	–
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	135.460	(5.000)	135.460
	Sterling G (Inc) (Hedged)^	GBP	10.080	649	(10.729)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	21.696.959	7.462.612	(12.940.477)	16.219.094
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	14.672	122.324	–	136.996
	Sterling H (Acc) (Hedged)^	GBP	12.182	–	(12.182)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	579.266	1.475.522	(1.409.037)	645.751
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	267.250	–	267.250
	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	5.056	313	(5.369)	–
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	AUD	10.000	636	(10.636)	–
	Klasse P (Inc) (Hedged)^	EUR	10.000	643	(10.643)	–
	Klasse W (Acc)	USD	167.252.937	210.512.744	(111.908.017)	265.857.664
	Klasse W (Acc)	EUR	52.371.223	7.847.837	(49.545.688)	10.673.372
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	29.079.663	4.614.035	(5.498.205)	28.195.493
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	178.772.509	22.662.162	(62.991.848)	138.442.823
	Klasse W (Inc)	USD	22.346.453	1.129.785	(4.050.523)	19.425.715
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	7.000.000	–	–	7.000.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	176.455.139	6.165.145	(7.861.718)	174.758.566
	Klasse W (Inc) (M)^	HKD	–	5.076	(38)	5.038
	Klasse W (Inc) (M)^	SGD	–	20.616	(24)	20.592
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	125.000	335.577	(10.000)	450.577
	Klasse Z (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	10.000	99.410.237	(957.443)	98.462.794
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	508.025	–	(228.550)	279.475
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	10.000	–	(10.000)	–
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	Klasse G (Acc)	EUR	208.615	12.358.305	(1.494.005)	11.072.915
	Klasse W (Acc)	EUR	814.177.639	272.084.220	(198.221.244)	888.040.615
	Klasse W (Inc)	EUR	2.505.000	15	(5.015)	2.500.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.999	–	–	4.999
	Klasse Z (Acc)	EUR	171.553.701	113.209.577	(14.291.275)	270.472.003

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	Während des Geschäfts- jahres zurück- genommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*						
	Klasse A (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse G (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse W (Acc)^	EUR	–	29.918.534	–	29.918.534
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000
	Klasse X (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	USD	–	10.000	–	10.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	10.000	–	10.000

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

** Mit Wirkung vom 3. Mai 2022 wurde die Anteilsklasse Euro S des BNY Mellon Euroland Bond Fund in Anteilsklasse Euro Z umbenannt.

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 N	0,90 %
Klasse B	0,75 % - 1,50 %	Klasse P	1,10 %
Klasse C	0,20 % - 1,00 %	Klasse R	1,00 % - 1,50 %
Klasse D	1,00 %	Klasse S	0,50 % - 1,00 %
Klasse E	0,08 % - 0,85 %	Klasse T	0,50 % - 1,00 %
Klasse F	0,35 %	Klasse U	0,75 % - 0,85 %
Klasse G	0,20 % - 1,00 %	Klasse V	0,18 %
Klasse H	0,40 % - 2,00 %	Klasse W	0,15 % - 0,75 %
Klasse I	0,45 % - 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 %
Klasse L	0,14 % - 0,16 %		

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
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	3-Monats-EURIBOR / SOFR (90 Tage aufgezinst) / SONIA (90 aufgezinst) / SARON (90 Tage aufgezinst) / TONAR (90 Tage aufgezinst)	Klassen D, R, S und T – 10,00 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	1-Monats-EURIBOR / SOFR (30 Tage aufgezinst) / SONIA (30 aufgezinst) / SARON (30 Tage aufgezinst)	Klassen D, R, S, T und U – 15,00 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	1-Monats-EURIBOR / SOFR (30 Tage aufgezinst) / SONIA (30 aufgezinst) / SARON (30 Tage aufgezinst) / TONAR (30 Tage aufgezinst)	Klassen D, F, R, S, T und U – 15,00 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund^	S&P 500 Net Total Return Index in USD	Klassen D, F, S, T und U – 10,00 %
BNY Mellon Global Leaders Fund^	MSCI World Index (Nettodividende reinvestiert) in Euro/ USD	Klasse U – 20,00 %
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	MSCI World Daily (Nettodividende reinvestiert) in Euro/ USD	Klasse S – 15,00 %

^ Dieser Fonds hatte weder im laufenden noch in früheren Geschäftsjahren Anteilsklassen ausgegeben, die zu einer Performancegebühr berechtigten.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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 2023 und 31. Dezember 2022 aufgeführt, aufgeschlüsselt nach Anteilsklassen der Fonds:

Fonds	Anteilsklasse	währung	Basiswährung des Fonds	Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2023	Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			Gesamt	68.790	17.648
	Klasse D (Acc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse R	EUR	EUR	–	–
	Klasse R (Hedged)	USD	EUR	1.985	436
	Klasse R (Inc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse S	EUR	EUR	–	–
	Klasse S (Inc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse T (Hedged)	CHF	EUR	–	–
	Klasse T (Hedged)	USD	EUR	55.720	–
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	11.085	17.212
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*			Gesamt	–	4.543
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	CHF	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	USD	GBP	–	1.076
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Sterling R (Acc)	GBP	GBP	–	–
	Sterling S (Acc)	GBP	GBP	–	2
	Klasse T (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse T (Hedged)	USD	GBP	–	538
	Klasse U (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse U (Hedged)^	USD	GBP	–	2.885
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Sterling U (Acc)	GBP	GBP	–	42
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			Gesamt	–	1
	Klasse F (Acc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	EUR	–	–
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	EUR	–	–
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	–	1
	Klasse R (Acc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse U (Acc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	EUR	–	–
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	EUR	–	–
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	–	–
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund			Gesamt	107.097	–
	Klasse S	EUR	EUR	10.294	–
	Klasse S (Acc) 1	USD	EUR	96.803	–

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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. AUSGABENBEREICH

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 Anteilseignern mitgeteilt. Zum Datum dieses Abschlusses gelten die folgenden Ausgabenobergrenzen:

Fonds	Vereinbarte Grenze für die Gesamtkostenquote („TER“)
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 11. Dezember 2023)	TER-Grenze der jährlichen Verwaltungsgebühr („JVG“) plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund* (mit Höchstgrenze vom 6. Juni 2023 bis zum Schließungstermin am 9. Oktober 2023)	TER-Grenze der JVG plus 25 Basispunkte
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Asian Income Fund	TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte ⁽¹⁾
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte ⁽²⁾
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte ⁽³⁾
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte ⁽⁴⁾
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte ⁽⁵⁾
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte ⁽⁶⁾
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund (mit Höchstgrenze ab dem 1. März 2023)	TER-Grenze der JVG plus 26 Basispunkte
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte ⁽⁷⁾
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 26. Juni 2023)	TER-Grenze der JVG plus 12 Basispunkte ⁽⁸⁾
BNY Mellon Food Innovation Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 10. November 2023)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Future Earth Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 10. November 2023)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Future Life Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 10. November 2023)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Global Credit Fund ⁽⁹⁾	
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	TER-Grenze der JVG plus 30 Basispunkte
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Global Leaders Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte ⁽¹⁰⁾
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte ⁽¹¹⁾
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte

6. AUSGABENBERGRENZE Forts.

Fonds	Vereinbarte TER-Grenze
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 17. Juli 2023)	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 8. Dezember 2023)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte ⁽¹²⁾
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 23. September 2022)	TER-Grenze der JVG plus 18 Basispunkte
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 24. Januar 2023)	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte ⁽¹³⁾
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 10. Januar 2022)	TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte ⁽¹⁴⁾

- ⁽¹⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen EUR X (Acc) (Hedged), Sterling X (Acc) und USD X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 6,3 Basispunkte.
- ⁽²⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 6 Basispunkte.
- ⁽³⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 5,8 Basispunkte.
- ⁽⁴⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 8 Basispunkte. Dies führte zu einem Managementgebührenverzicht für die Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) in Höhe von 18.852 USD für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (15.024 USD für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022) führt; und der Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 5,8 Basispunkte.
- ⁽⁵⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen JPY X (Acc), JPY X (Acc) (Hedged), Sterling X (Acc) (Hedged), Sterling (Inc) (Hedged), USD X (Acc) und USD (Inc), vorbehaltlich einer TER-Grenze ohne JVG plus 5,8 Basispunkte.
- ⁽⁶⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD L (Acc), USD L (Inc), EUR L (Acc) (Hedged), EUR L (Inc) (Hedged), Sterling L (Acc) (Hedged), Sterling L (Inc) (Hedged), Sterling X (Acc) (Hedged), Sterling X (Inc) (Hedged), USD X (Acc) und USD X (Inc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 5,8 Basispunkte.
- ⁽⁷⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 13 Basispunkte.
- ⁽⁸⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen Sterling X (Acc) (Hedged) und Sterling X (Inc) Hedged mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 8 Basispunkte.
- ⁽⁹⁾ Anteilsklassen AUD K (Acc) (Hedged), EUR K (Inc) (Hedged), Sterling K (Acc) (Hedged), Sterling K (Inc) (Hedged), USD K (Acc), USD K (Inc), USD K (Inc) (M), EUR L (Acc) (Hedged), EUR L (Inc) (Hedged), Sterling L (Acc) (Hedged), Sterling L (Inc) (Hedged), USD L (Acc) und USD L (Inc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkten; Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 7 Basispunkten; Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 10 Basispunkte; und Anteilsklassen Sterling Z (Acc) (Hedged) und Sterling Z (Inc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte.
- ⁽¹⁰⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklassen Sterling Y (Acc) (Hedged) und USD Y (Acc).
- ⁽¹¹⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged).
- ⁽¹²⁾ 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.
- ⁽¹³⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 6 Basispunkte.
- ⁽¹⁴⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen EUR X (Acc), Sterling X (Acc) (Hedged) und USD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze ohne JVG plus 5,5 Basispunkte.
- * Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die Gesamtkosten für die Überschreitung der Obergrenze, die der Gesellschaft während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 in Rechnung gestellt wurden, betrugen 2.827.631 USD (31. Dezember 2022: 1.827.533 USD).

7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN

Die in der Gesamtergebnisrechnung enthaltenen betrieblichen Aufwendungen beinhalten:

	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
Aufwendungen	USD	USD
Verwaltungsgebühr	10.829.456	10.394.895
Prüfungsgebühr	858.291	705.374
Verwaltungsratshonorare	119.770	96.936
Sonstige Aufwendungen	3.745.329	3.326.878
Betriebliche Aufwendungen insgesamt	15.552.846	14.524.083

7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN Forts.

Die für das Geschäftsjahr berechneten Honorare und Auslagen für die Leistungen der Abschlussprüfer Ernst & Young stellen sich wie folgt dar:

	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	USD	USD
Abschlussprüfung des Jahresabschlusses (Irland)	605.835	516.780
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Vereinigtes Königreich)	151.722	92.775
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Österreich)	100.734	95.819
Gesamt	858.291	705.374

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 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund>	EUR	108.129	156.092
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	EUR	302	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	GBP	749.992	742.994
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund>	EUR	2.331.879	1.656.844
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	20.650	13.998
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	USD	54.289	72.000
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	13.461	41.488
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	71.628	130.397
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	37.091	37.523
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	34.863	39.252
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund>	USD	22	623
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund>	USD	1.771	3.051
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund>	USD	85	2.079
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund>	USD	k. A.	k. A.
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund>	USD	k. A.	715
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund>	USD	7.067	218
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund>	USD	4.765	244
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund>	USD	1.821	5.570
BNY Mellon Euroland Bond Fund>	EUR	k. A.	6.030
BNY Mellon European Credit Fund>	EUR	k. A.	8.386
BNY Mellon Food Innovation Fund*	USD	845	583
BNY Mellon Future Earth Fund*	USD	2.410	1.364
BNY Mellon Future Life Fund*	USD	1.272	1.498
BNY Mellon Global Bond Fund>	USD	k. A.	17.875
BNY Mellon Global Credit Fund>	USD	k. A.	6.012
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	USD	42.455	48.129
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	USD	82.195	78.429
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	578.250	504.902
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	147.278	428.544
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	37.426	21.691
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	10.310	16.829
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	78.144	1.926.676
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	GBP	8.511	46.829
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	USD	55.865	308.530
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund>	USD	k. A.	1.575
BNY Mellon Global Unconstrained Fund>	USD	5.228	6.279

8. TRANSAKTIONSKOSTEN Forts.

Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	10.962.485	10.095.068
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	EUR	38.495	k. A.
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	176.378	166.522
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	543.885	444.735
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	15.068	75.987
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	USD	27.023	19.962
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	EUR	25.190	30.185
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	USD	5.646	11.931
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	USD	314.297	312.505
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	28.663	112.625
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund>	USD	k. A.	21.655
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	203.803	308.694
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	35.499	23.043

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Die Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Anleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie können jedoch weder zweckmäßig noch zuverlässig zusammengestellt noch getrennt überprüft 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, Lloyds Bank plc, Morgan Stanley, Natixis CIB, Royal Bank of Canada, Royal Bank of Scotland, State Street Bank, Toronto Dominion und UBS AG) in Bezug auf die erforderlichen Sicherheiten und Margenanforderungen gehalten. Barguthaben umfassen täglich in kurzfristige Anlageinstrumente investierte Barmittel.

Kassakontovereinbarungen wurden für die Fonds infolge neuer Anforderungen für die Sammelkonten für Zeichnungs- und Rücknahmebeträge gemäß dem (Supervision and Enforcement) Act 2013 der (Section 48(i)) Investor Money Regulations 2015 für Fonds-Dienstleister (Fund Service Providers) („Vorschriften für Anlegergelder“ – „Investor Money Regulations“) getroffen.

Diese Kassakonten, die bei der globalen Unterdepotbank für den Einzug von Zeichnungen und Rücknahmezahlungen sowie für Ausschüttungen der Fonds gehalten werden, gelten als Vermögenswerte der Fonds. Die Guthaben auf diesen Kassakonten werden in Bezug auf den jeweiligen Fonds, dem sie zustehen, als unwesentlich betrachtet, mit Ausnahme von Barmittelguthaben in Höhe von 267.577 GBP zum 31. Dezember 2023 für den BNY Mellon Absolute Return Equity Fund (geschlossen am 9. Oktober 2023), in Höhe von 122.352 USD zum 31. Dezember 2023 für den BNY Mellon Asian Opportunities Fund, 22.608 EUR zum 31. Dezember 2023 (31. Dezember 2022: EUR 23.296) für den BNY Mellon Pan European Fund (geschlossen am 9. März 2017) und 33.925 USD zum 31. Dezember 2022 für den BNY Mellon S&P 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 Anteilsinhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen oder Übertragungen von Anteilen und das Halten von Anteilen am Ende jedes Achtjahreszeitraums ab dem Erwerb der Anteile.

10. BESTEUERUNG Forts.

Die Gesellschaft ist in Irland in Bezug auf steuerpflichtige Ereignisse, die sich auf folgende Arten von Anteilsinhabern beziehen, nicht steuerpflichtig:

- (a) Anteilsinhaber, 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, Bruttozahlungen 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 Anteilsinhabern 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 2023 wurde für den BNY Mellon Asian Income Fund eine offene Kapitalertragsteuer von 34.405 USD (31. Dezember 2022: null USD), eine offene Kapitalertragsteuer von 293.332 USD für den BNY Mellon Asian Opportunities Fund (31. Dezember 2022: 8.101 USD), eine offene Kapitalertragsteuer von 861.322 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2022: 804.930 USD), eine offene Kapitalertragsteuer von 113.062 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund (31. Dezember 2022: null USD), eine offene Kapitalertragsteuer von 61.718 USD für den BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2022: 4 USD) und von 3.865 EUR für den BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) (31. Dezember 2022: null EUR) in der Bilanz ausgewiesen.

Für das am 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr wurde ein Kapitalertragsteueraufwand von 34.405 USD für den BNY Mellon Asian Income Fund (31. Dezember 2022: null USD), ein Kapitalertragsteueraufwand von 301.433 USD für den BNY Mellon Asian Opportunities Fund (31. Dezember 2022: 319.867 USD), ein Kapitalertragsteueraufwand von 147.383 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2022: 332.193 USD), Auflösung einer Kapitalertragsteuerrückstellung von 113.062 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund (31. Dezember 2022: 185.048 USD), ein Kapitalertragsteueraufwand von 61.715 USD für den BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2022: null USD) und von 3.865 USD für den BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) (31. Dezember 2022: null USD) in der Gesamtergebnisrechnung unter „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ ausgewiesen.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Nach Ansicht des Verwaltungsrats gelten die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageverwalter (Newton Investment Management Limited*, Walter Scott & Partners Limited, Newton Investment Management North America LLC*, ARX Investimentos Ltda, Insight Investment Management (Global) Limited, BNY Mellon Asset Management Japan Limited*, Insight North America LLC und Newton Investment Management Japan Ltd*), die Unteranlageverwalter (Insight North America LLC, Newton Investment Management Limited* und Newton Investment Management North America LLC*), der delegierte Anlageverwalter (Insight North America LLC) und die Vertriebsgesellschaften als der Gesellschaft nahestehende Unternehmen.

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 „Verwahrstelligegebühren“, der Erläuterung 6 „Ausgabenobergrenze“ und der Erläuterung 7 „Betriebliche Aufwendungen“ zum Abschluss vollständig ausgewiesen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind der Gesellschaft nahestehende Personen.

Gerald Rehn*, Mark Flaherty und Sandeep Sumal* sind außerdem Verwaltungsratsmitglieder der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die Verwaltungsgesellschaft). Greg Brisk war ebenfalls als Verwaltungsratsmitglied dieser Gesellschaft tätig und trat am 2. März 2023 zurück.

Gerald Rehn* ist zudem ein Verwaltungsratsmitglied der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited. Greg Brisk war ein Verwaltungsratsmitglied der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited und trat am 1. März 2023 zurück. Caylie Stallard und Sarah Cox* sind Mitarbeiter von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Gerald Rehn*, Caylie Stallard, Mark Flaherty, Sarah Cox* und Sandeep Sumal* haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Greg Brisk hatte ebenfalls auf sein Recht verzichtet, eine Vergütung für seine Dienste als Verwaltungsratsmitglied zu beziehen. Nach seinem Ausscheiden aus der BNY Mellon Group am 8. Mai 2023 hat er ab 1. August 2023 Anspruch auf eine Vergütung für seine Dienste als externes, nicht-unabhängiges Verwaltungsratsmitglied. Die im Geschäftsjahr angefallenen Honorare der Verwaltungsratsmitglieder werden in Erläuterung 7 zum Abschluss offen gelegt.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Greg Brisk war zudem ein Verwaltungsratsmitglied bei den folgenden Anlageverwaltern der Fonds:

- Newton Investment Management Limited – zurückgetreten am 1. März 2023;
- Insight Investment Management (Global) Limited – zurückgetreten am 1. März 2023 und
- Insight North America LLC – zurückgetreten am 1. März 2023.

Greg Brisk war zudem ein Verwaltungsratsmitglied der Insight Liquidity Funds Plc, in die einige Fonds der Gesellschaft investiert haben. Er trat am 1. März 2023 von diesem Amt zurück.

BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited, ein der Gesellschaft nahestehendes Unternehmen, hielt am 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 ein erhebliches wirtschaftliches Eigentum an den Anteilsklassen der nachstehend aufgeführten Fonds.

Name des Anlegers Fonds	Basis- währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited			
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	EUR	25.090.133	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	k. A.	10.435.963
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	25.982.861	23.339.106
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	EUR	31.240.515	k. A.
BNY Mellon Food Innovation Fund*	USD	k. A.	1.926.984
BNY Mellon Future Earth Fund*	USD	k. A.	1.683.423
BNY Mellon Future Life Fund*	USD	k. A.	2.102.066
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	EUR	20.797.049	k. A.
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	USD	k. A.	23.204.920
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	USD	11.080.716	10.693.015
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	USD	51.849.324	k. A.
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	EUR	28.165.385	25.869.822

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Folgende Fonds investieren in Organismen für gemeinsame Anlagen, die von ihren eigenen Anlageverwaltern verwaltet werden, sowie in andere Fonds der Gesellschaft.

Fonds	Organismus für gemeinsame Anlagen (OGA)	währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Bond Fund	EUR	1.973.400	–
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	17.540.634	30.778.339
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*				
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	1.213.024	–
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*				
	Insight Liquidity Funds Plc – ILF GBP Liquidity Fund	GBP	–	12.958.011
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc – ILF EUR Liquidity Fund	EUR	6.126.086	9.456.426

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Fonds	Organismus für gemeinsame Anlagen (OGA)	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	4.685.000	17.750.000
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	2.554.238	3.737.054
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	EUR	2.345.587	2.165.146
BNY Mellon European Credit Fund				
	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	EUR	935.651	392.094
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	413.729	823.036
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	EUR	1.317.282	–
BNY Mellon Global Credit Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	–	8.241.218
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	5.126.696	5.104.833
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	18.330.775	21.060.000

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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, Niederlassung 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 2022: 38.092) Zeichneranteile, wie in Erläuterung 2 zum Abschluss erläutert. Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gab es keine oberste beherrschende Partei der Gesellschaft.

12. VERRECHNUNGSPROVISION (SOFT COMMISSION) UND MAKLERDIENSTLEISTUNGSVEREINBARUNGEN

Im Geschäftsjahr traf die ARX Investimentos Ltda (der „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. Der Anlageverwalter leistet für diese Dienstleistungen keine direkte Zahlung, sondern vergütet die Makler entweder über Provisionen auf Transaktionen oder sorgt 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 unternehmensspezifisches anlagebezogenes Research und die aktive Orderverwaltung. Der Anlageverwalter ist der Ansicht, dass die Anleger Vorteile aus diesen Vereinbarungen ziehen, und dass die Maklergebühren nicht die üblichen Maklergebühren für den umfassenden institutionellen Anlegerservice überschreiten.

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 2023	31. Dezember 2022
Argentinischer Peso	808,4625	176,7465

13. WECHSELKURSE Forts.

Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
Australischer Dollar	1,4675	1,4688
Brasilianischer Real	4,8576	5,2798
Kanadischer Dollar	1,3251	1,3540
Chilenischer Peso	881,0100	848,2500
Chinesischer Yuan	7,1257	6,9207
Kolumbianischer Peso	3.875,3400	4.848,0000
Tschechische Krone	22,3638	22,5989
Dänische Krone	6,7527	6,9468
Ägyptisches Pfund^	k. A.	24,7550
Euro	0,9058	0,9342
Hongkong-Dollar	7,8085	7,8055
Ungarischer Forint	346,9135	372,9975
Indische Rupie	83,2138	82,7300
Indonesische Rupiah	15.397,0000	15.567,5000
Israelischer Schekel	3,6206	3,5151
Japanischer Yen	141,0000	131,2400
Koreanischer Won	1.287,9000	1.264,5000
Malaysischer Ringgit	4,5950	4,4050
Mexikanischer Peso	16,9810	19,4865
Neuseeländischer Dollar	1,5819	1,5751
Norwegische Krone	10,1599	9,7968
Peruanischer neuer Sol	3,6993	3,7968
Philippinischer Peso	55,3750	55,7275
Polnischer Zloty	3,9348	4,3814
Rumänischer Leu	4,5059	4,6163
Russischer Rubel	89,2500	73,7500
Singapur-Dollar	1,3198	1,3394
Südafrikanischer Rand	18,2925	16,9913
Pfund Sterling	0,7845	0,8272
Schwedische Krone	10,0861	10,4349
Schweizer Franken	0,8411	0,9247
Taiwan-Dollar	30,6905	30,7355
Thailändischer Baht	34,1325	34,6350
Türkische Lira	29,4688	18,7023
Uruguayischer Peso	39,0600	39,9750

^ Die Gesellschaft war zum Jahresende keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

Bei der Erstellung der Bilanz wurden für die Konsolidierung der Abschlüsse der Fonds folgende Wechselkurse gegenüber dem US-Dollar verwendet:

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Schlusskurs	Mittelkurs	Schlusskurs	Mittelkurs
Euro	0,9058	0,9247	0,9342	0,9491
Japanischer Yen	141,0000	140,1892	131,2400	130,5648
Pfund Sterling	0,7845	0,8041	0,8272	0,8084

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.

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

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 eine Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder Einkommens ohne bzw. mit annähernd 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 81 % zu 19 % 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 vereinbarte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 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) (19 %)	Nettoertrag für die Gesellschaft (81 %)^
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	72.733	(13.819)	58.914
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	GBP	7.321	(1.390)	5.931
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	4.861	(923)	3.938
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	329	(62)	267
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	USD	1.272	(242)	1.030
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	12.699	(2.413)	10.286
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	24.249	(4.607)	19.642
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	1.423	(271)	1.152
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	315.728	(59.989)	255.739
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	177.819	(33.786)	144.033
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	6.860	(1.304)	5.556
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	4.354	(828)	3.526
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	7.913	(1.503)	6.410
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	10.264	(1.951)	8.313
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	36.055	(6.851)	29.204
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	13.580	(2.580)	11.000
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	26.888	(5.109)	21.779
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	27.101	(5.149)	21.952
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	40.450	(7.685)	32.765
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	USD	531	(101)	430
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	116.102	(22.059)	94.043
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	86.517	(16.438)	70.079
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	35.536	(6.751)	28.785
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	3.195	(607)	2.588
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	1.788	(340)	1.448
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	198.638	(37.741)	160.897
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	9.422	(1.790)	7.632
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	46.218	(8.781)	37.437
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	106.395	(20.215)	86.180

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (19 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (81%)^
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	6.428	(1.222)	5.206
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	27.987.351	(5.317.597)	22.669.754
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	43.664	(8.297)	35.367
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	USD	15.303	(2.908)	12.395
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	37.746	(7.172)	30.574

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 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) (19 %)	Nettoertrag für die Gesellschaft (81 %)^
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	45.946	(8.730)	37.216
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	6.259	(1.189)	5.070
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	15.340	(2.915)	12.425
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	USD	200	(38)	162
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	125.064	(23.762)	101.302
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	15.622	(2.968)	12.654
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	22.973	(4.365)	18.608
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	380	(72)	308
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	184.262	(35.010)	149.252
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	232.385	(44.153)	188.232
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	311.944	(59.269)	252.675
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	11.632	(2.210)	9.422
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	16.530	(3.141)	13.389
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	6.146	(1.168)	4.978
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	19.677	(3.739)	15.938
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	57.522	(10.929)	46.593
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	10.798	(2.052)	8.746
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	29.907	(5.682)	24.225
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	83.451	(15.856)	67.595
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	62.047	(11.789)	50.258
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	USD	240	(46)	194
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	47.791	(9.080)	38.711
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	91.414	(17.369)	74.045
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	75.144	(14.277)	60.867
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	4.289	(815)	3.474
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	1.138	(216)	922
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	180.193	(34.237)	145.956
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	6.228	(1.183)	5.045
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	3.802	(722)	3.080
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	812.478	(154.371)	658.107
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.132	(405)	1.727
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	23.215.494	(4.410.944)	18.804.550
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	73.070	(13.883)	59.187

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (19 %)	Nettoerträge für die Gesellschaft (81%)^
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	35.559	(6.756)	28.803
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	57.925	(11.006)	46.919
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	USD	19.159	(3.640)	15.519
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	13.565	(2.577)	10.988

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 31. Dezember 2023 wie folgt dar:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				EUR	EUR	%
	BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	8.320.282	8.740.174	105,05 %
	BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.064.631	3.130.939	102,16 %
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.937.382	4.019.874	102,10 %
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	2.971.404	3.032.522	102,06 %
	Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	1.863.754	1.957.983	105,06 %
	Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.818.586	1.909.574	105,00 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.030.302	3.091.684	102,03 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.496.439	2.546.454	102,00 %
	Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	833.043	850.173	102,06 %
	Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	426.882	449.364	105,27 %
	UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	787.983	803.775	102,00 %
	Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	490.259	500.978	102,19 %
	J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	103.746	105.839	102,02 %
				30.144.693	31.139.333	103,30 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund				EUR	EUR	%
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.952.984	5.052.214	102,00 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Forts.			EUR	EUR	%
The Bank of Nova Scotia	Kanada	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.478.694	2.602.811	105,01 %
			7.431.678	7.655.025	103,01 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund			USD	USD	%
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.781.412	2.142.398	120,26 %
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	304.692	311.165	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	225.720	247.553	109,67 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	199.124	219.046	110,00 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	103.810	109.306	105,29 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	48.063	49.066	102,09 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	40.633	44.869	110,43 %
			2.703.454	3.123.403	115,53 %
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	US-Staatsanleihen (Bilateral)	842.261	866.700	102,90 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	517.973	528.548	102,04 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	385.037	392.751	102,00 %
National Bank Financial Inc	Kanada	US-Staatsanleihen (Bilateral)	99.147	101.179	102,05 %
			1.844.418	1.889.178	102,43 %
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	US-Staatsanleihen (Bilateral)	206.553	212.547	102,90 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	102.856	105.105	102,19 %
National Bank Financial Inc	Kanada	US-Staatsanleihen (Bilateral)	99.599	101.641	102,05 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	70.224	73.766	105,04 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	10.145	10.354	102,06 %
			489.377	503.413	102,87 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	61.745.399	63.039.025	102,10 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.191.967	2.236.719	102,04 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Forts.			USD	USD	%
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.019.192	2.061.331	102,09 %
National Bank Financial Inc	Kanada	US-Staatsanleihen (Bilateral)	44.407	45.317	102,05 %
			66.000.965	67.382.392	102,09 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			USD	USD	%
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	436.444	459.736	105,34 %
			436.444	459.736	105,34 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			USD	USD	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	793.749	834.414	105,12 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	707.178	742.845	105,04 %
			1.500.927	1.577.259	105,09 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund			EUR	EUR	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.186.475	5.386.280	103,85 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	4.024.702	4.107.484	102,06 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.728.844	3.824.129	102,56 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.518.066	2.568.484	102,00 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	511.068	536.907	105,06 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.317.608	2.365.266	102,06 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	450.076	495.098	110,00 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	106.720	112.341	105,27 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.808.236	1.870.886	103,46 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.766.027	1.801.408	102,00 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.579.069	1.610.921	102,02 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	828.886	871.280	105,11 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.			EUR	EUR	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	374.457	381.947	102,00 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	319.773	326.181	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	197.117	201.063	102,00 %
			25.717.124	26.459.675	102,89 %
BNY Mellon European Credit Fund			EUR	EUR	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.240.640	1.267.765	102,19 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	767.546	783.028	102,02 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	336.271	353.636	105,16 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	622.847	635.463	102,03 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	181.788	191.566	105,38 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	154.426	157.522	102,00 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	217.491	228.614	105,11 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	106.720	112.341	105,27 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	93.667	95.593	102,06 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	196.503	200.455	102,01 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	160.909	164.130	102,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	91.741	93.577	102,00 %
			4.170.549	4.283.690	102,71 %
BNY Mellon Global Bond Fund			USD	USD	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	22.547.978	23.469.217	104,09 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	6.243.885	6.372.421	102,06 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	191.968	201.585	105,01 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.107.809	1.131.555	102,14 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.			USD	USD	%
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	740.017	755.007	102,03 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	531.749	558.567	105,04 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	501.424	511.504	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	196.159	200.192	102,06 %
			32.060.989	33.200.048	103,55 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	8.973.316	9.870.968	110,00 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	2.322.671	2.369.367	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	898.388	946.709	105,38 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.152.443	1.176.588	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	589.511	601.636	102,06 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	454.250	793.683	174,72 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	305.029	334.381	109,62 %
			14.695.608	16.093.332	109,51 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	5.209.046	5.318.181	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	1.738.419	1.774.176	102,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	109.085	111.303	102,03 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.180.798	1.215.189	102,91 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	279.249	293.454	105,09 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.384.802	1.430.336	103,29 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	474.725	485.105	102,19 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	364.241	371.843	102,09 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	292.017	297.979	102,04 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.			USD	USD	%
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	251.006	263.697	105,06 %
			11.283.388	11.561.263	102,46 %
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			USD	USD	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	2.167.522	2.384.387	110,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.524.895	1.605.619	105,29 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	116.731	122.835	105,23 %
			3.809.148	4.112.841	107,97 %
BNY Mellon Global Opportunities Fund			USD	USD	%
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	431.995	475.599	110,09 %
			431.995	475.599	110,09 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)			EUR	EUR	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	71.654.091	73.244.150	102,22 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	49.560.100	54.517.879	110,00 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	6.534.791	7.188.579	110,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.204.080	4.295.998	102,19 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	512.166	522.721	102,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	2.455.292	2.505.793	102,06 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	483.194	492.908	102,01 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	414.307	422.610	102,00 %
ING Bank NV	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	251.597	276.984	110,09 %
			136.069.618	143.467.622	105,44 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			GBP	GBP	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	2.884.071	2.942.014	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	1.896.953	1.934.992	102,01 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	209.319	230.261	110,00 %
			4.990.343	5.107.267	102,34 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	21.002.227	23.102.689	110,00 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	228.447	233.145	102,06 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.194.236	1.313.716	110,00 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	362.088	369.392	102,02 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	501.357	511.513	102,03 %
ING Bank NV	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	96.171	105.875	110,09 %
			23.384.526	25.636.330	109,63 %
BNY Mellon Global Unconstrained Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	1.136.913	1.250.645	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	611.824	673.014	110,00 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	123.247	135.687	110,09 %
			1.871.984	2.059.346	110,01 %
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			JPY	JPY	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	672.247.815	741.991.068	110,37 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	472.733.097	520.041.558	110,01 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	397.046.412	436.769.919	110,00 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	74.996.208	78.966.345	105,29 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	36.026.769	39.675.990	110,13 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	26.826.801	29.623.818	110,43 %
			1.679.877.102	1.847.068.698	109,95 %
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			EUR	EUR	%
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	1.137.522	1.256.122	110,43 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	G10-Schuldtitel (TriParty)	82.250	86.383	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.108.573	1.219.503	110,01 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	966.872	1.015.446	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	728.822	802.387	110,09 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	578.782	636.717	110,01 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	270.520	297.614	110,02 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	256.449	269.279	105,00 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	234.449	258.773	110,37 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	218.652	229.859	105,13 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023	Wert der Sicher- heiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2023
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.			EUR	EUR	%
Macquarie Bank Limited	Australien	Aktienindizes (TriParty)	224.725	252.493	112,36 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	120.004	126.266	105,22 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	116.445	122.609	105,29 %
			6.044.065	6.573.451	108,76 %
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	10.219.802	11.208.308	109,67 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	8.242.286	8.664.740	105,13 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	381.211	420.760	110,37 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	3.308.480	3.639.484	110,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	578.840	608.552	105,13 %
			22.730.619	24.541.844	107,97 %

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt dar:

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2022	Wert der Sicher- heiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			EUR	EUR	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	1.859.857	1.899.214	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.015.648	1.037.542	102,16 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	2.736.496	2.877.168	105,14 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.615.847	1.682.166	104,10 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	691.515	705.427	102,01 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	517.268	528.058	102,09 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	302.683	317.925	105,04 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	279.214	286.362	102,56 %
			9.018.528	9.333.861	103,50 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			GBP	GBP	%
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	132.268	145.610	110,09 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	23.979	26.391	110,06 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	4.418	4.641	105,06 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	2	2	100,00 %
			160.667	176.643	109,94 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund			USD	USD	%
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.085.684	4.494.776	110,01 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	2.344.224	2.663.511	113,62 %
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	787.661	803.714	102,04 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	413.573	434.876	105,15 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	65.708	67.125	102,16 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	349.242	357.779	102,44 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	66.542	73.254	110,09 %
			8.112.634	8.895.035	109,64 %
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			USD	USD	%
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.047.229	1.110.365	106,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	282.893	288.554	102,00 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	260.089	270.764	104,10 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	147.854	157.329	106,41 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	94.929	96.840	102,01 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	120.734	123.557	102,34 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	26.184	27.183	103,82 %
			1.979.912	2.074.592	104,78 %
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund			USD	USD	%
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	116.330	123.344	106,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	38.676	39.454	102,01 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Forts.			USD	USD	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.745	5.020	105,80 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	8.645	8.819	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.995	5.099	102,08 %
			173.391	181.736	104,81 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	51.503.184	52.613.434	102,16 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	5.769	6.067	105,17 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	5.352.718	5.675.428	106,03 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.303.095	3.383.837	102,44 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	534.177	554.553	103,81 %
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	533.744	544.622	102,04 %
BNP Paribas Securities Corp.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	97.973	100.263	102,34 %
			61.330.660	62.878.204	102,52 %
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.071.705	4.241.879	104,18 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.404.109	3.477.491	102,16 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.469.508	2.601.588	105,35 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	1.075.007	1.097.755	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	186.696	196.073	105,02 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	9.088.292	9.555.483	105,14 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.907.677	2.005.926	105,15 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	5.363.681	5.631.234	104,99 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	888.676	935.671	105,29 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.322.902	4.540.589	105,04 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.			USD	USD	%
Nomura Securities International Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.485.154	3.597.884	103,23 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	825.811	867.542	105,05 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	298.737	313.779	105,04 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	634.222	649.726	102,44 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	440.684	485.726	110,22 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	252.073	266.718	105,81 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	45.026	47.741	106,03 %
			38.759.960	40.512.805	104,52 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	216.288	226.776	104,85 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	173.387	182.119	105,04 %
			389.675	408.895	104,93 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.301.930	2.525.999	109,73 %
			2.301.930	2.525.999	109,73 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	271.050	297.434	109,73 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	173.387	182.119	105,04 %
			444.437	479.553	107,90 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.278.701	1.403.169	109,73 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	520.163	546.356	105,04 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	275.131	288.472	104,85 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	157.283	160.673	102,16 %
			2.231.278	2.398.670	107,50 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund			EUR	EUR	%
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	3.058.716	3.215.952	105,14 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.949.351	2.004.798	102,84 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	645.816	684.485	105,99 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.136.230	3.199.427	102,02 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	417.846	426.561	102,09 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	2.981.580	3.044.674	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	195.368	204.788	104,82 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	171.973	175.612	102,12 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.805.696	2.861.833	102,00 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	2.436.404	2.485.599	102,02 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	286.044	291.773	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.642.772	1.702.448	103,63 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	725.984	741.167	102,09 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	1.759.117	1.804.143	102,56 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	36.607	37.365	102,07 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.360.964	1.439.176	105,75 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.083.189	1.137.516	105,02 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	752.245	767.389	102,01 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	512.827	535.155	104,35 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.			EUR	EUR	%
Toronto Dominion Bank	Kanada	Euroclear Triparty - UK Gilts	303.413	318.790	105,07 %
			26.262.141	27.078.652	103,11 %
BNY Mellon European Credit Fund			EUR	EUR	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	855.316	873.204	102,09 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	171.284	182.007	106,26 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	722.863	737.941	102,09 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	682.092	711.790	104,35 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	271.354	276.813	102,01 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	170.341	173.749	102,00 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	316.036	331.887	105,02 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	305.847	313.675	102,56 %
			3.495.134	3.601.067	103,03 %
BNY Mellon Global Bond Fund			USD	USD	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.725.138	3.803.046	102,09 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	1.694.248	1.743.395	102,90 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.684.862	4.778.689	102,00 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.087.753	2.130.949	102,07 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	961.513	986.124	102,56 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	447.654	470.106	105,02 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	176.209	179.756	102,01 %
			13.777.377	14.092.065	102,28 %
BNY Mellon Global Credit Fund			USD	USD	%
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	6.957.102	7.102.223	102,09 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.771.157	3.846.610	102,00 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Credit Fund Forts.			USD	USD	%
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.316.121	3.488.826	105,21 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.103.982	3.166.132	102,00 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	2.726.005	2.795.780	102,56 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	169.411	172.916	102,07 %
TD Securities Inc.	Kanada	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	1.863.363	2.050.177	110,03 %
			21.907.141	22.622.664	103,27 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	17.187.027	18.906.259	110,00 %
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	9.111.587	10.022.784	110,00 %
Nomura Securities International Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.651.139	1.704.546	103,23 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	414.149	422.913	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	338.901	355.923	105,02 %
			28.702.803	31.412.425	109,44 %
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	218.075	242.961	111,41 %
			218.075	242.961	111,41 %
BNY Mellon Global Equity Income Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	11.222.105	11.790.421	105,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	6.768.631	7.117.283	105,15 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	13.620	13.913	102,15 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	1.030.748	1.148.373	111,41 %
Barclays Capital Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	946.391	969.525	102,44 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	552.960	608.267	110,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	190.484	200.031	105,01 %
BofA Securities Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	472.995	482.634	102,04 %
			21.197.934	22.330.447	105,34 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.960.441	4.045.816	102,16 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.200.851	1.225.572	102,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	585.364	597.751	102,12 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.015.130	1.118.887	110,22 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	836.944	879.968	105,14 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	740.374	759.325	102,56 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	585.980	598.235	102,09 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	373.667	396.195	106,03 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	314.362	330.248	105,05 %
RBC Europe Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	200.516	210.573	105,02 %
			9.813.629	10.162.570	103,56 %
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	7.833.687	8.727.637	111,41 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	5.060.223	5.650.365	111,66 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	478.433	502.818	105,10 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	2.205.771	2.428.267	110,09 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	2.069.064	2.350.874	113,62 %
			17.647.178	19.659.961	111,41 %
BNY Mellon Global Leaders Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	21.881	22.989	105,06 %
			21.881	22.989	105,06 %
BNY Mellon Global Opportunities Fund			USD	USD	%
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	318.824	341.595	107,14 %
			318.824	341.595	107,14 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)			EUR	EUR	%
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	63.108.759	69.423.616	110,01 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	35.376.251	36.084.576	102,00 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.			EUR	EUR	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	27.040.752	27.629.700	102,18 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	13.666.301	15.033.352	110,00 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	9.414.703	9.891.487	105,06 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	21.742.483	22.180.115	102,01 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	7.215.446	7.359.813	102,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.747.351	6.026.047	104,85 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.153.847	2.373.994	110,22 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	183.693	187.370	102,00 %
			185.649.586	196.190.069	105,68 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			GBP	GBP	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	330.947	347.707	105,06 %
			330.947	347.707	105,06 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	982.567	1.030.213	104,85 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	297.572	327.987	110,22 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	294.762	309.604	105,04 %
			1.574.901	1.667.804	105,90 %
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	14.875.772	15.190.562	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.313.329	6.511.198	103,13 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	5.685.307	5.959.414	104,82 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.202.423	1.227.863	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	922.333	971.664	105,35 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	12.023.379	12.630.587	105,05 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.			USD	USD	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.699.733	5.818.938	102,09 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.433.708	1.523.473	106,26 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.391.519	6.519.401	102,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (Euroclear TriParty)	483.366	493.091	102,01 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.980.533	6.240.917	104,35 %
UBS AG	Schweiz	OECD-Staatsanleihen - Supranationale Anleihen (Clearstream)	2.421.788	2.483.776	102,56 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.210.316	1.283.285	106,03 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	629.912	661.423	105,00 %
			65.273.418	67.515.592	103,44 %
BNY Mellon Global Unconstrained Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	1.350.582	1.485.682	110,00 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	275.894	289.866	105,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	503.329	553.671	110,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	203.518	207.590	102,00 %
			2.333.323	2.536.809	108,72 %
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			JPY	JPY	%
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	233.047.724	249.692.631	107,14 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	210.571.430	221.212.369	105,05 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	82.243.252	90.791.570	110,39 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	45.025.557	47.320.419	105,10 %
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	47.719.258	52.536.422	110,09 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	22.117.746	24.641.754	111,41 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.880.407	1.986.711	105,65 %
			642.605.373	688.181.876	107,09 %
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			EUR	EUR	%
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.495.214	2.644.617	105,99 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der ent- liehenen Wert- papiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.			EUR	EUR	%
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	401.863	444.567	110,63 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	139.700	146.881	105,14 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	G10-Schuldtitel (TriParty)	669.221	707.648	105,74 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	249.099	283.027	113,62 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	622.571	695.154	111,66 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	528.593	581.913	110,09 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	481.328	529.547	110,02 %
Societe Generale	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	281	295	104,98 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	438.275	482.112	110,00 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	373.867	416.531	111,41 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	80.899	84.996	105,06 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	57.026	62.762	110,06 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	18.923	19.879	105,06 %
			6.556.859	7.099.929	108,28 %
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.665.586	5.136.561	110,09 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	4.286.919	4.593.100	107,14 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.509.560	2.636.650	105,06 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	2.159.387	2.388.858	110,63 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	177.144	194.890	110,02 %
ING Bank NV	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	35.168	38.685	110,00 %
			13.833.764	14.988.744	108,35 %
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD	USD	%
TD Prime Services LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.059.285	3.133.434	102,42 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	524.068	536.878	102,44 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	51.979	57.186	110,02 %
			3.635.332	3.727.498	102,54 %

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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.

Der veröffentlichte Nettoinventarwert jeder Klasse einlösbarer, partizipierender Anteile beträgt wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
	Summe Nettovermögen	EUR	291.785.157	335.180.316	420.833.229
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse C	EUR	107,3489	100,3728	99,4418
	Klasse R	EUR	104,3722	97,9307	97,3616
	Klasse R (Hedged)	USD	118,6216	109,5743	107,0876
	Klasse R (Inc)	EUR	99,0722	94,3555	94,0972
	Klasse S	EUR	113,5585	106,0202	104,8799
	Klasse T (Hedged)^	CHF	–	94,4316	93,8644
	Klasse T (Hedged)	USD	131,7256	121,2323	118,0047
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	124,5104	115,0831	112,1818
	Klasse W (Acc)	EUR	102,1025	95,5638	94,7722
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	–	–	103,5767
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	111,3660	102,7934	100,4564
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	96,0752
	Klasse X	EUR	122,9744	114,1825	112,3488
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	134,9590	123,6103	119,8551
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*					
	Summe Nettovermögen	EUR	25.090.133	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	1,0033	–	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	1,0035	–	–
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,0037	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	1,0046	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0024	–	–
	Klasse G (Acc)^	EUR	1,0035	–	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	1,0036	–	–
	Klasse W (Inc)^	EUR	1,0036	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,0323	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	1,0045	–	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*					
Summe Nettovermögen		GBP	–	139.786.504	123.705.871
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse D (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,9452	0,9387
	Klasse R (Hedged)^	CHF	–	0,8845	0,8867
	Klasse R (Hedged)^	EUR	–	1,0573	1,0555
	Klasse R (Hedged)^	USD	–	1,0955	1,0745
	Klasse R (Inc) (Hedged)^	EUR	–	0,9216	0,9199
	Sterling R (Acc)^	GBP	–	1,1620	1,1419
	Sterling S (Acc)^	GBP	–	1,2317	1,2044
	Klasse T (Hedged)^	EUR	–	1,1195	1,1119
	Klasse T (Hedged)^	USD	–	1,1452	1,1187
	Klasse U (Hedged)^	EUR	–	1,0000	0,9916
	Klasse U (Hedged)^	USD	–	1,1350	1,1077
	Klasse U (Inc) (Hedged)^	EUR	–	0,9712	0,9601
	Sterling U (Acc)^	GBP	–	1,2469	1,2177
	Sterling X (Acc)^	GBP	–	1,4340	1,3874
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	67.474.300	113.142.193	95.148.164
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	JPY	101,1450	–	–
	Klasse F (Acc)	EUR	0,9891	0,9895	1,0308
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	0,9436	0,9640	1,0102
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	1,1199	1,0969	1,1225
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	1,0935	1,0790	1,1083
	Klasse R (Acc)	EUR	0,9445	0,9557	1,0071
	Klasse U (Acc)	EUR	1,0496	1,0539	1,1024
	Klasse U (Acc) (Hedged)^	CHF	–	0,9589	1,0078
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	1,0963	1,0782	1,1074
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	0,9832	0,9741	1,0046
	Klasse X (Acc)	EUR	1,0140	1,1025	1,1442
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9963	0,9792	1,0019
BNY Mellon Asian Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	29.900.543	18.778.990	14.979.746
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,4901	1,4017	1,5058
	Klasse A (Inc)	USD	0,8646	0,8157	0,9637
	Klasse A (Inc)	EUR	1,0918	1,0684	1,1907
	Klasse B (Acc)	USD	1,2608	1,1371	1,2888
	Klasse C (Acc)	USD	1,3807	1,2389	1,3974
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0961	1,0178	1,0801
	Klasse W (Inc)	EUR	1,2447	1,2031	1,3241
	Klasse W (Inc)	USD	1,0041	0,9355	1,0915
	Sterling W (Inc)	GBP	1,3302	1,3120	1,3676

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
Summe Nettovermögen		USD	36.883.296	43.544.220	58.824.565
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	4,0282	4,0234	5,1788
	Klasse A	EUR	3,2035	3,3202	4,0312
	Klasse B	USD	4,4436	4,4163	5,6561
	Klasse B	EUR	1,7106	1,7639	2,1310
	Klasse C	USD	5,1429	5,0859	6,4812
	Klasse C	EUR	3,4610	3,5511	4,2687
	Sterling C (Inc)	GBP	3,5929	3,7615	4,2823
	Klasse W	USD	1,4531	1,4334	1,8220
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
Summe Nettovermögen		USD	36.022.629	40.968.820	95.125.353
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1200	0,8982	1,7039
	Klasse A (Acc)	EUR	0,5619	0,4648	0,8290
	Klasse B (Acc)	USD	0,6236	0,4975	0,9389
	Klasse B (Acc)^	EUR	–	0,9098	–
	Klasse B (Acc)^	HKD	11,0296	–	–
	Klasse B (Acc)	SGD	1,1002	0,8915	–
	Klasse B (Inc)	SGD	–	–	0,9412
	Klasse C (Acc)	USD	0,6709	0,5330	1,0015
	Klasse E (Acc)	USD	1,2096	0,9571	1,7913
	Klasse E (Acc)	EUR	1,2430	1,0143	1,7848
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	0,9637
	Klasse G (Acc)	USD	0,9165	0,7281	1,3680
	Klasse G (Acc)	EUR	0,6932	0,5681	1,0042
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,5581	0,4542	0,8894
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9917	0,8148	1,6116
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,6245	0,5083	0,9957
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,1253	0,9148	–
	Klasse K (Acc)	USD	1,1579	0,9245	1,7460
	Klasse K (Acc)	EUR	1,1897	0,9799	1,7399
	Klasse W (Acc)	USD	1,1980	0,9498	1,7812
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,6291	0,5107	0,9984

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Brazil Equity Fund#					
Summe Nettovermögen		USD	42.260.200	39.894.419	42.616.239
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,1662	0,9460	0,9326
	Klasse A	EUR	1,4634	1,2316	1,1441
	Klasse B	USD	1,0173	0,8211	0,8054
	Klasse B	EUR	1,3013	1,0894	1,0070
	Sterling B (Acc)	GBP	1,1904	1,0138	0,8891
	Klasse C	USD	1,3718	1,1017	1,0753
	Klasse C	EUR	1,7251	1,4373	1,3220
	Sterling C (Inc)	GBP	1,2222	1,1197	1,0464
	Klasse G (Acc)	EUR	1,2145	1,0116	0,9304
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,8510	–
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9392	0,7820	0,7899
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,9317	0,7681	0,7683
	Klasse W (Acc)	USD	1,2016	0,9627	0,9372
	Klasse W (Acc)	EUR	1,4196	1,1795	1,0821
	Sterling W (Acc)	GBP	1,5211	1,2864	1,1199
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
Summe Nettovermögen		USD	25.982.861	23.339.106	24.751.005
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0223	0,9230	0,9885
	Klasse C (Acc)	USD	1,0345	0,9317	0,9898
	Klasse E (Acc)	USD	1,0444	0,9364	0,9904
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0076	0,9190	0,9891
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0374	0,9325	0,9896
	Klasse W (Acc)	USD	1,0390	0,9338	0,9900
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	0,9542	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0023	0,9164	0,9888
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0318	0,9298	0,9893
	Klasse X (Acc)	USD	1,0519	0,9399	0,9907
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	1,0148	0,9224	0,9895
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,0447	0,9359	0,9900
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
Summe Nettovermögen		USD	235.713.775	555.576.067	645.924.114
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,0997	0,9233	1,1191
	Klasse A (Inc)	USD	1,8825	1,5372	1,9816
	Klasse C (Acc)	USD	1,9323	1,5705	2,0205
	Klasse G (Acc)	USD	1,4939	1,2147	1,5627
	Klasse G (Acc)	EUR	1,5058	1,2618	1,5263
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	–	1,0771	1,4319
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,4985	1,2483	1,6630
	Klasse W (Acc)	USD	1,9548	1,5856	2,0359
	Klasse W (Acc)	EUR	1,7849	1,4963	1,8063
	Klasse W (Inc)	EUR	1,4429	1,2170	1,4741
	Sterling W (Acc)	GBP	1,0967	0,9379	1,0756
	Klasse X (Acc)	USD	2,0101	1,6234	2,0752

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	218.725.364	178.903.236	191.298.660
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0665	0,9527	1,0806
	Klasse A (Inc)	USD	0,9036	0,8635	1,0315
	Klasse C (Acc)	USD	1,0702	0,9549	1,0820
	Klasse C (Inc)	USD	0,9067	0,8655	1,0327
	Klasse E (Acc)^	USD	1,0840	–	1,0848
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0197	0,9273	1,0719
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0567	0,9470	1,0804
	Klasse E (Inc)	USD	–	–	1,0354
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0225
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,8945	0,8578	1,0316
	Sterling E (Inc) (Hedged) (M)^	GBP	1,0744	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0093	0,9207	1,0672
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8537	0,8336	1,0186
	Klasse W (Acc)	USD	1,0749	0,9579	1,0834
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0754	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	–	–	10,6971
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0161	0,9249	1,0700
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	10,4070	9,4442	10,7907
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	10,2442	9,3197	10,7387
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0533	0,9449	1,0790
	Klasse W (Inc)	USD	0,9095	0,8674	1,0341
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8596	0,8375	1,0211
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,8916	0,8559	1,0303
	Klasse X (Acc)	USD	1,0817	0,9622	1,0867
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	74.204.490	46.542.724	20.691.305
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9710	0,8937	1,0507
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0073	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0073	–	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,9579	0,8845	1,0441
	Klasse W (Acc)	USD	0,9784	0,8985	1,0543
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9173	0,8609	1,0315
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	1,1056	1,0351	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	808.942.990	948.814.250	1.921.308.172
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0874	0,9759	1,1395
	Klasse C (Acc)	USD	1,0929	0,9793	1,1417
	Klasse C (Inc)	USD	0,8674	0,8325	1,0187
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,9624	0,8778	1,0424
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,9533	0,8725	1,0400
	Klasse N (Acc)	USD	0,9545	0,8592	1,0068
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	0,9114	0,8380	1,0033
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,8359	0,8079	0,9956
	Klasse W (Acc)	USD	1,0982	0,9826	1,1439
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0956	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9577	0,8752	1,0413
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0665	0,9606	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,8765	0,8400	1,0264
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8851	0,8668	1,0830
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0532	–	–
	Klasse X (Acc)^	JPY	116,5540	–	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,1103	0,9902	1,1488
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	JPY	103,3268	–	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,0875	0,9762	1,1434
	Klasse X (Inc)	USD	0,9466	0,9040	1,1008
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,8589	0,8259	1,0072
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	1.467.640.011	1.417.476.467	726.611.703
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Inc)	USD	0,8293	0,8010	0,9625
	Klasse A (Inc)	EUR	0,8874	0,8840	0,9988
	Klasse C (Acc)	USD	1,2329	1,0991	1,2401
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0906	0,9906	1,1418
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,1615	1,0401	1,1828
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,0593	0,9646	1,1134
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0374	0,9457	1,0927
	Klasse K (Acc)	USD	1,2032	1,0729	1,2108
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	1,0745	0,9784	1,1293
	Klasse L (Acc)	USD	1,2155	1,0815	1,2184
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	1,0856	0,9868	1,1360
	Klasse L (Inc)	USD	0,9386	0,9039	–
	Klasse L (Inc) (Hedged)	EUR	0,8907	0,8761	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	1,0828	0,9700	1,1033
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,8139	0,7894	0,9558
	Klasse W (Acc)	USD	1,2400	1,1041	1,2448
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0817	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,1060	1,0060	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,9279	0,8944	1,0726
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7316	0,7207	0,8855
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9071	0,8804	1,0672
	Klasse X (Acc)	USD	1,0173	0,9038	1,0172
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	1,1515	1,0299	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,8735	0,8457	1,0086

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	283.929.865	352.246.309	554.266.191
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	135,4959	125,1957	148,8118
	Klasse A	EUR	155,3992	148,9755	167,0360
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	878,5833	840,9620	1.032,1792
	Klasse B	USD	150,9466	139,1245	164,9561
	Klasse C	USD	156,8885	144,0257	170,0873
	Klasse C	EUR	178,8525	170,4259	189,8492
	Klasse G (Inc)	USD	84,9656	81,4547	99,8756
	Klasse H (Hedged)	EUR	116,1972	109,5809	132,9036
	Klasse I (Hedged)	EUR	124,3488	116,5161	140,4363
	Klasse W	USD	160,5210	147,0669	173,3326
	Klasse W	EUR	191,9295	182,4708	202,8604
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	97,4568	92,9411	112,3116
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	96,2429	90,0071	108,2557
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	78,9235	78,7718	99,0615
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	75,2760	73,6595	92,2053
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	142,7643	131,6412	156,0680
	Klasse X	USD	179,6860	163,4571	191,2988
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	23.635.305	24.246.898	33.134.900
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,2071	2,0040	2,4303
	Klasse A	EUR	1,9991	1,8721	2,1347
	Klasse C	USD	2,4215	2,1877	2,6399
	Klasse C	EUR	2,1887	2,0394	2,3139
	Klasse C (Inc)	USD	0,6657	0,6354	0,8047
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0197	0,9460	1,1753
	Klasse W	USD	1,2332	1,1114	1,3378
	Klasse X (Inc)	USD	0,8288	0,7910	1,0020

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
Summe Nettovermögen		USD	28.563.501	25.263.639	113.559.730
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,0703	0,9281	1,0262
	Klasse A	EUR	1,2069	1,0793	1,1221
	Klasse A (Inc)	USD	0,4588	0,4186	0,4827
	Klasse A (Inc)	EUR	0,6755	0,6358	0,6896
	Sterling A (Acc)	GBP	1,0967	1,0026	0,9902
	Sterling B (Acc)	GBP	1,1441	1,0439	1,0276
	Klasse C	USD	1,4486	1,2499	1,3751
	Klasse C	EUR	1,3143	1,1694	1,2097
	Klasse C (Inc)	USD	0,4918	0,4489	0,5179
	Klasse C (Inc)^	EUR	–	0,5976	0,6487
	Sterling C (Acc)	GBP	1,6856	1,5334	1,5068
	Sterling C (Inc)	GBP	0,7654	0,7366	0,7591
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,8326	0,7392	0,8395
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,8616	0,7616	0,8606
	Sterling J (Inc) (Hedged)^	GBP	–	0,3712	0,4342
	Klasse W	USD	0,8803	0,7568	0,8298
	Klasse W	EUR	1,0305	0,9138	0,9420
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,7688	0,6774	0,7627
	Klasse W (Inc)	EUR	0,5566	0,5238	0,5684
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,5926	0,5539	0,6570
	Sterling W (Inc)	GBP	0,5974	0,5750	0,5926
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,4505	0,4149	0,4854
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
Summe Nettovermögen		USD	22.900.692	24.491.950	27.883.288
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,2665	1,1583	1,2650
	Klasse C	USD	1,0922	0,9637	1,1138
	Klasse W (Acc)	USD	1,0477	0,9211	1,0609
	Klasse X (Inc)	USD	0,8246	0,7671	0,9274
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
Summe Nettovermögen		USD	30.450.493	38.253.080	125.677.325
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9505	0,8424	1,0075
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,7208	0,6908	0,8887
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,8681	0,7868	0,9663
	Klasse W (Acc)	USD	0,9769	0,8617	1,0262
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,8454	0,7628	0,9327
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,8819	0,7839	0,9451
	Klasse X (Acc)	USD	1,0124	0,8878	1,0508

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	186.122.307	176.583.489	275.922.173
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,7777	1,6515	1,9885
	Klasse A (Inc)	EUR	1,0554	0,9944	1,2026
	Klasse B	EUR	1,2602	1,1678	1,4026
	Klasse B (Inc)	EUR	1,0615	1,0001	1,2096
	Klasse C	EUR	1,9668	1,8180	2,1781
	Klasse C (Inc)	EUR	1,1530	1,0863	1,3140
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9571	0,8848	1,0600
	Klasse H (Hedged)	CHF	1,0996	1,0426	1,2629
	Klasse I (Hedged)	CHF	1,1863	1,1193	1,3490
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9973	0,9214	1,1034
	Klasse Z	EUR	1,1027	1,0183	1,2188
BNY Mellon European Credit Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	58.400.917	43.864.621	40.738.209
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	117,1169	107,5876	125,9258
	Klasse C	EUR	123,6309	113,0068	131,6104
	Klasse W (Acc)	EUR	102,8784	93,9439	109,3006
	Klasse X	EUR	131,1564	119,2295	138,1121
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*					
Summe Nettovermögen		EUR	31.240.515	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	1,0540	–	–
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,0591	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	1,0684	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0472	–	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	1,0581	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	1,0673	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0461	–	–
	Klasse W (Inc)^	EUR	1,0411	–	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0687	–	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0498	–	–
BNY Mellon Food Innovation Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	–	1.926.984	2.766.825
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	1,1063	1,2030
	Klasse W (Acc)^	USD	–	0,9609	1,1111

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Future Earth Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	–	1.683.423	2.164.937
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	–	0,8476	1,0853
	Klasse B (Acc)^	USD	–	0,8552	1,0900
	Klasse C (Acc)^	USD	–	0,8636	1,0953
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	1,0076	1,1994
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,8094	1,0732
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,8247	1,0832
	Klasse W (Acc)^	USD	–	0,8671	1,0975
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,8279	1,0853
BNY Mellon Future Life Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	–	2.102.066	2.351.576
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc)^	EUR	–	1,2196	1,2831
	Klasse W (Acc)^	USD	–	1,0478	1,1722
BNY Mellon Global Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	487.468.836	408.355.513	434.682.361
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,0234	1,9715	2,3579
	Klasse A	EUR	1,6297	1,6473	1,8584
	Klasse A (Inc)^	USD	1,0097	–	–
	Klasse B	USD	2,0836	2,0272	2,4208
	Klasse C	USD	2,2373	2,1691	2,5813
	Klasse C	EUR	1,8122	1,8239	2,0471
	Klasse C (Inc)	USD	0,8215	0,8167	0,9813
	Sterling C (Inc)	GBP	1,2940	1,3575	1,4532
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9897	0,9875	1,2109
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0636	1,0568	1,2892
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,7843	0,7742	0,9330
	Klasse W (Acc)	USD	0,9564	0,9262	1,1011
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9049	0,9094	1,0196
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,8897	0,8700	–
	Klasse X	USD	2,4113	2,3246	2,7510
	Klasse Z (Acc)^	USD	1,0482	–	–
	Klasse Z (Inc)^	USD	1,0482	–	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9968	–	–
	Klasse Z (Inc) (Hedged)^	EUR	1,0405	–	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,8580	0,8381	1,0071
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,8205	0,8204	0,9953

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Credit Fund					
Summe Nettovermögen			USD 1.040.060.466	384.749.177	442.961.954
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9770	0,9005	1,0380
	Klasse A (Inc) (Q)^	USD	1,0435	–	–
	Klasse C (Acc)^	USD	1,0547	–	–
	Klasse C (Inc)^	USD	1,0547	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0661	1,0039	1,1815
	Klasse H (Inc) (Hedged) (Q)^	SGD	1,0333	–	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0326	–	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)^	CHF	1,0326	–	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0410	–	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)^	EUR	1,0445	–	–
	Sterling I (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0524	–	–
	Sterling I (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0524	–	–
	Klasse K (Acc)^	USD	1,0669	–	–
	Klasse K (Inc)^	USD	1,0738	–	–
	Klasse K (Acc) (Hedged)^	AUD	1,0461	–	–
	Klasse K (Inc) (Hedged)^	EUR	1,0548	–	–
	Klasse K (Inc) (M)^	USD	1,0341	–	–
	Sterling K (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0677	–	–
	Sterling K (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0677	–	–
	Klasse L (Acc)^	USD	1,0689	–	–
	Klasse L (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0501	–	–
	Klasse L (Inc)^	USD	1,0756	–	–
	Klasse L (Inc) (Hedged)^	EUR	1,0566	–	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0695	–	–
	Sterling L (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0626	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,3137	1,2034	1,3782
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0875	1,0375	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0421	–	–
	Klasse W (Inc)^	USD	1,0554	–	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	CHF	1,0336	–	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	EUR	1,0452	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,2118	1,1181	1,2914
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0529	–	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,3473	1,2281	1,3996
	Klasse X (Acc)	JPY	122,2493	103,7643	103,6889
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,3086	1,2006	1,3715
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	87,7820	84,8780	99,1545
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0691	–	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0691	–	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	182.577.833	345.001.062	432.993.493
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,2435	1,2044	1,2881
	Klasse A	EUR	1,3055	1,3126	1,3242
	Klasse A (Inc)	USD	0,9921	0,9899	1,0732
	Klasse C	USD	1,3503	1,3014	1,3850
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1512	1,1509	1,1554
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9522	0,9414	1,0271
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8231	0,8383	0,9274
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0083	0,9920	1,0769
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	0,9580	0,9375	1,0000
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,8237	0,8390	0,9283
	Klasse W	USD	1,1707	1,1257	1,1950
	Sterling W (Acc)^	GBP	0,9800	–	–
	Klasse W (Hedged)	EUR	1,0006	0,9819	1,0633
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8565	0,8724	0,9654
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0981	1,0623	1,1334
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	94,1927	95,2655	102,8088
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	84,5255	89,3267	99,1286
	Sterling Z (Acc)	GBP	1,0305	1,0473	0,9917
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,9411	0,9941	0,9630
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,9901	0,9564	1,0191
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9076	0,9113	0,9940
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund					
Summe Nettovermögen		USD	22.096.301	35.345.994	53.039.682
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,1466	1,0786	1,4299
	Klasse A	EUR	1,4249	1,3902	1,7384
	Klasse A (Inc)	EUR	1,2613	1,2312	1,5395
	Klasse B (Inc)	USD	1,1660	1,0914	1,4397
	Klasse B (Inc)	EUR	1,3389	1,2997	1,6172
	Klasse C	USD	1,4088	1,3121	1,7221
	Klasse C (Acc)	USD	1,5537	1,4471	1,8993
	Klasse C (Inc)	USD	1,2312	1,1468	1,5052
	Klasse E (Acc)	USD	1,5731	1,4572	1,9021
	Klasse E (Acc)	CHF	1,2603	1,2875	1,6632
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9670	0,9330	1,2765
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0804	1,0320	1,3978
	Klasse W (Acc)	USD	1,8224	1,6931	2,2167
	Klasse W (Acc)	EUR	1,2792	1,2336	1,5235
	Klasse W (Inc)	USD	1,2543	1,1653	1,5257
	Klasse W (Inc)	EUR	1,4142	1,3632	1,6836

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	444.347.178	535.733.690	411.101.299
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,2567	2,0594	2,1617
	Klasse A	EUR	3,0246	2,8641	2,8359
	Klasse A (Inc)	USD	1,5118	1,4261	1,5387
	Klasse A (Inc)	EUR	1,3959	1,3660	1,3903
	Sterling A (Acc)	GBP	2,1190	2,0459	1,9185
	Klasse B	USD	2,8004	2,5429	2,6559
	Klasse B	EUR	3,0455	2,8693	2,8269
	Klasse B (Inc)	USD	1,8713	1,7565	1,8857
	Klasse B (Inc)	EUR	2,1908	2,1348	2,1619
	Sterling B (Inc)	GBP	2,2969	2,2825	2,1891
	Klasse C	USD	2,6879	2,4284	2,5238
	Klasse C	EUR	3,3596	3,1500	3,0880
	Klasse C (Inc)	USD	1,9901	1,8586	1,9854
	Klasse C (Inc)	EUR	2,2208	2,1519	2,1683
	Sterling C (Inc)	GBP	2,4378	2,4106	2,3004
	Klasse G (Acc)	EUR	1,5325	1,4359	1,4076
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,6276	1,5220	1,6471
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,1793	1,1404	1,2693
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,8167	1,6821	1,8024
	Klasse W	USD	2,3879	2,1521	2,2310
	Klasse W	EUR	2,8191	2,6346	2,5763
	Klasse W (Acc)^	CHF	0,9646	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,3039	1,2043	1,2869
	Klasse W (Inc)	USD	1,7062	1,5895	1,6937
	Klasse W (Inc)	EUR	2,0215	1,9537	1,9637
	Sterling W (Acc)	GBP	3,0148	2,8779	2,6653
	Sterling W (Inc)	GBP	2,1562	2,1275	2,0252
	Klasse Z (Acc)	USD	2,0082	1,8081	1,8725
	Klasse Z (Acc)	EUR	2,2604	2,1116	2,0628
	Klasse Z (Inc)	USD	1,3415	1,2485	1,3290
	Klasse Z (Inc)	EUR	1,3811	1,3335	1,3390
	Sterling Z (Inc)	GBP	1,3478	1,3284	1,2632
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	115.137.405	109.883.243	166.693.695
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	2,8178	2,5967	2,7968
	Klasse C	USD	1,5027	1,3313	1,5163
	Klasse C	EUR	2,9578	2,7186	2,9209
	Klasse C (Inc)	USD	0,8479	0,7987	0,9611
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,2453	1,1288	1,3164
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,2862	1,1631	1,3529
	Klasse W (Acc)	USD	1,2268	1,0814	1,2255
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0964	0,9726	1,1107
	Klasse X (Inc)	USD	0,9107	0,8485	1,0103
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,7829	0,7447	0,9069

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	95.571.000	122.260.526	227.707.584
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0607	0,9737	1,0657
	Klasse A (Inc)	USD	0,8264	0,8026	0,9299
	Klasse A (Inc)	EUR	0,8533	0,8548	0,9311
	Klasse B (Acc)	SGD	1,2772	1,1847	1,2991
	Klasse B (Acc)	USD	1,0861	0,9926	1,0816
	Klasse B (Inc)	USD	0,8466	0,8185	0,9440
	Klasse B (Inc)	SGD	1,0656	1,0458	1,2135
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,9797	0,9480	1,0890
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,9971	0,9795	1,1326
	Klasse E (Inc)	USD	0,8934	0,8551	0,9764
	Klasse E (Inc)	EUR	0,9229	0,9111	0,9781
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,8093	0,7825	0,9130
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9207	0,8666	0,9807
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,7156	0,7131	0,8551
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,3313	1,2387	1,3614
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	1,1092	1,0925	1,2715
	Klasse W (Acc)	USD	1,1292	1,0246	1,1084
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9796	0,9112	1,0207
	Klasse W (Inc)	USD	0,8800	0,8447	0,9674
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7645	0,7528	0,8919
BNY Mellon Global Leaders Fund					
Summe Nettovermögen		USD	69.597.946	46.497.437	65.357.060
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,9962	1,6583	2,1514
	Klasse A (Acc)	EUR	1,7037	1,4598	1,7810
	Klasse B (Acc)	USD	1,5611	1,2904	1,6658
	Klasse C (Acc)	USD	2,1425	1,7623	2,2636
	Klasse E (Acc)	USD	1,9397	1,5874	2,0290
	Klasse E (Acc)	EUR	1,4212	1,1995	1,4415
	Sterling E (Acc)	GBP	2,1983	1,8973	2,1659
	Klasse H (Acc) (Hedged)	DKK	–	–	15,1216
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,6742	1,4247	1,9141
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	13,2533	11,2520	15,0354
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	13,1009	11,1673	15,0543
	Klasse W (Acc)	USD	2,1810	1,7894	2,2928
	Klasse W (Acc)^	EUR	1,0284	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	–	–	16,4629
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	14,0321	11,7657	15,5284
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	13,8635	11,6699	15,5378
	Sterling W (Acc)	GBP	2,1595	1,8686	2,1385

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
Summe Nettovermögen		USD	30.652.940	27.108.214	37.198.450
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	3,9263	3,2736	4,2183
	Klasse A	EUR	3,1749	2,7450	3,3366
	Klasse B	USD	4,3248	3,5879	4,6003
	Klasse C	USD	4,7171	3,8939	4,9678
	Klasse C	EUR	3,8015	3,2568	3,9193
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,7407	1,4867	1,9813
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,9251	1,6280	2,1481
	Klasse W (Acc)	USD	1,5937	1,3122	1,6705
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
Summe Nettovermögen		EUR	1.260.404.100	2.105.183.114	3.121.728.759
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,3724	1,3680	1,5477
	Klasse A (Inc)	EUR	1,1062	1,1070	1,2551
	Klasse C	EUR	1,4706	1,4586	1,6420
	Klasse C (Inc)	EUR	1,1670	1,1682	1,3244
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1293	1,1202	1,2610
	Klasse G (Inc)	EUR	1,0737	1,0747	1,2184
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,0807	1,0726	1,1938
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	1,0948	1,0698	1,1876
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1,0595	1,0417	1,1639
	Klasse W	EUR	1,3558	1,3414	1,5063
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0650	1,0757	1,2141
	Klasse W (Inc)	EUR	1,0240	1,0251	1,1620
	Klasse X	EUR	1,5448	1,5162	1,6892
	Klasse Z (Acc)	EUR	1,1431	1,1299	1,2675
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
Summe Nettovermögen		GBP	40.800.465	60.348.549	65.897.045
Nettoinventarwert zum:					
	Sterling B (Acc)	GBP	1,2860	1,2788	1,3974
	Sterling B (Inc)	GBP	1,1921	1,1874	1,2987
	Sterling C (Inc)	GBP	1,2178	1,2122	1,3256
	Sterling W (Acc)	GBP	1,3617	1,3440	1,4577
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1964	1,1917	1,3031
	Sterling X (Acc)	GBP	1,4200	1,3899	1,4953
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
Summe Nettovermögen		USD	228.357.467	346.537.616	437.609.335
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,6239	1,5912	1,7533
	Klasse C	USD	1,7455	1,7020	1,8660
	Klasse C (Inc)^	USD	–	1,3079	1,4416
	Klasse G (Acc)	USD	1,2657	1,2341	1,3531
	Klasse W	USD	1,4408	1,4013	1,5326
	Klasse W (Inc)	USD	1,2437	1,2233	1,3483
	Klasse X	USD	2,0314	1,9597	2,1261

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	776.895.860	535.281.260	792.573.372
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,2974	1,1461	1,1990
	Klasse A (Inc)	USD	0,9612	0,8931	0,9727
	Klasse C (Acc)	USD	1,3438	1,1812	1,2296
	Klasse G (Acc)	USD	1,2057	1,0598	1,1031
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0441	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1235	1,0123	1,0804
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8377	0,7938	0,8824
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0618	–	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	1,1633	1,0431	1,1075
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,8376	0,7940	0,8827
	Klasse W (Acc)	USD	1,3677	1,1992	1,2452
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,1150	1,0168	1,0815
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,1600	1,0375	1,0989
	Klasse W (Inc)	USD	0,9653	0,8969	0,9770
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8386	0,7951	0,8839
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,2703	1,1203	1,1699
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9076	0,8482	0,9300
	Klasse X (Acc)	USD	1,4223	1,2401	1,2805
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,2237	1,0732	1,1145
	Klasse Y (Acc)	USD	1,4237	1,2411	1,2813
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	1,3217	1,1589	1,2032
	Klasse Z (Acc)	USD	1,1465	1,0042	1,0417
	Klasse Z (Inc)	USD	0,9998	0,9289	1,0118
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1,1756	1,0361	1,0811
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9321	0,8712	0,9554
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
Summe Nettovermögen		USD	29.695.765	25.829.316	32.551.101
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse W (Acc)	USD	1,3856	1,2295	1,4588
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,3812	1,2257	1,4548

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
Summe Nettovermögen		JPY	17.853.251.736	23.358.895.122	21.102.568.351
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9906	1,1784	1,3006
	Klasse C	JPY	254,2329	268,5283	271,9886
	Klasse C^	USD	–	0,8719	1,0105
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,2347	1,2844	1,3082
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,4281	1,4270	1,4094
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,1237	1,1507	1,1741
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,9039	1,9608	1,9785
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	13,6851	14,1451	14,4586
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	13,4567	13,9437	14,3794
	Klasse H (Hedged)	EUR	2,2006	2,2774	2,3468
	Klasse H (Hedged)	USD	2,6025	2,6383	2,6434
	Klasse I (Hedged)	EUR	2,4657	2,5260	2,5782
	Klasse I (Hedged)	USD	2,8582	2,8718	2,8475
	Klasse W	JPY	260,9025	274,8870	277,7341
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9660	1,1346	1,2366
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,1990	1,2257	1,2478
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	14,2705	14,5682	14,7049
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	14,0569	14,3852	14,6493
	Sterling W (Acc)	GBP	2,4133	2,8960	2,9885
	Sterling W (Inc)	GBP	0,9376	1,1290	1,1682
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*					
Summe Nettovermögen		EUR	20.797.049	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	1,0341	–	–
	Klasse A (Inc)^	EUR	1,0341	–	–
	Klasse B (Acc)^	EUR	1,0365	–	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	1,0388	–	–
	Klasse E (Acc)^	EUR	1,0414	–	–
	Klasse E (Acc)^	USD	1,0264	–	–
	Klasse E (Inc)^	EUR	1,0414	–	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	1,0396	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,0251	–	–
	Klasse W (Inc)^	EUR	1,0400	–	–
	Klasse W (Inc)^	USD	1,0250	–	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	1.471.472.106	1.151.824.392	1.600.784.047
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	3,7676	3,2174	3,8035
	Klasse A	USD	2,6206	2,1707	2,7292
	Klasse A (Inc)	EUR	2,4181	2,0650	2,4411
	Sterling A (Acc)	GBP	3,8249	3,3395	3,7502
	Klasse B	EUR	3,5985	3,0577	3,5968
	Klasse B	USD	2,8061	2,3123	2,8927
	Klasse B (Acc)	SGD	1,5747	1,3173	1,6580
	Sterling B (Inc)	GBP	3,3355	2,8982	3,2384
	Klasse C	EUR	4,4061	3,7253	4,3601
	Klasse C	USD	3,0678	2,5155	3,1313
	Klasse G (Acc)	EUR	1,6115	1,3625	1,5947
	Klasse J (Acc) (Hedged)	JPY	103,5337	91,0346	107,1911
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,7845	1,5110	1,7471
	Klasse S	EUR	4,5448	3,8248	4,4543
	Klasse S (Acc) 1	USD	1,5492	1,2661	1,5682
	Klasse W	EUR	3,2681	2,7563	3,2180
	Klasse W	USD	2,7811	2,2746	2,8244
	Klasse W (Hedged)	USD	3,5439	2,9360	3,3500
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	SEK	11,3412	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	1,6403	1,3789	1,5824
	Klasse W (Inc)	USD	2,6184	2,1493	2,6723
	Sterling W (Acc)	GBP	3,5028	3,0206	3,3500
	Sterling W (Inc)	GBP	3,3006	2,8537	3,1691
	Klasse X (Acc)	USD	1,2894	1,0460	–
	Sterling X	GBP	3,2121	2,7481	3,0239

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
Summe Nettovermögen		USD	424.709.029	463.291.956	993.610.089
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,3553	1,1568	1,7836
	Klasse A (Acc)	EUR	1,5545	1,3686	1,9841
	Klasse A (Inc)	USD	1,3550	1,1565	1,7832
	Klasse A (Inc)	EUR	1,4316	1,2602	1,8270
	Klasse B (Acc)	USD	1,3886	1,1799	1,8111
	Klasse B (Acc)	SGD	0,8060	0,6951	1,0734
	Klasse C (Acc)	USD	1,4456	1,2222	1,8667
	Klasse C (Acc)	EUR	1,4475	1,2627	1,8133
	Klasse C (Inc)	EUR	1,5043	1,3117	1,8836
	Klasse E (Acc)	USD	1,4659	1,2332	1,8741
	Klasse E (Acc)	CHF	1,4319	1,3245	1,9835
	Klasse E (Acc)	EUR	1,5482	1,3434	1,9195
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,4696	1,2913	2,0412
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,4880	1,2830	2,0257
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,3224	1,1225	1,7531
	Klasse G (Acc)	USD	1,1838	1,0009	1,5287
	Klasse G (Acc)	CHF	1,0965	1,0192	1,5340
	Klasse G (Acc)	EUR	1,3516	1,1785	1,6923
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,0930	0,9472	1,5026
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,7585	0,6760	1,0839
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1708	1,0242	1,6405
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,1698	1,0233	1,6391
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	1,4123	1,2299	1,9610
	Klasse K (Acc)	USD	1,6203	1,3768	2,1133
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	1,3806	1,2254	1,9568
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	1,4135	1,2310	1,9629
	Klasse K (Acc) (Hedged)	SGD	0,7836	0,6782	1,0541
	Klasse K (Inc)	USD	1,6204	1,3769	2,1134
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	1,3791	1,2242	1,9549
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	1,4120	1,2296	1,9606
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	1,5259	1,3203	2,0521
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	1,4709	1,2611	1,9893
	Klasse W (Acc)	USD	1,4422	1,2169	1,8548
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9663	0,8531	1,3528
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,2460	1,0776	1,7062
	Sterling W (Acc)	GBP	0,8691	0,7732	1,0527
	Klasse W (Inc)	USD	1,4349	1,2118	1,8471
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1,2361	1,0699	1,6939
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	50.458.855	43.187.140	81.192.875
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	7,0539	6,0216	7,0496
	Klasse A	USD	1,6735	1,3772	1,7092
	Klasse B	EUR	3,6419	3,0935	3,6036
	Klasse C	EUR	8,5297	7,2083	8,3551
	Klasse C^	USD	–	1,5508	1,9065
	Klasse W (Acc)	EUR	1,4012	1,1813	1,3659

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	–	23.206.685	4.976.550
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	–	0,7098	0,9887
	Klasse B (Acc)^	USD	–	0,7164	0,9934
	Klasse B (Acc)^	SGD	–	0,7188	1,0028
	Klasse C (Acc)^	USD	–	0,7237	0,9986
	Klasse E (Acc)^	USD	–	0,7312	1,0038
	Sterling E (Acc)^	GBP	–	0,8061	0,9886
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	0,7097	0,9991
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,6771	0,9766
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,6904	0,9864
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	SGD	–	0,7060	0,9905
	Klasse W (Acc)^	USD	–	0,7268	1,0008
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,6932	0,9884
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	332.781.654	333.190.402	328.622.843
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9559	0,9389	1,0203
	Klasse A (Acc)	USD	0,9323	0,8826	1,0168
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9049	0,9136	1,0042
	Klasse C (Acc)^	EUR	–	0,9568	1,0347
	Klasse E (Acc)	EUR	1,0063	0,9784	1,0524
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,9396	0,9324	1,0084
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9791	0,9569	1,0347
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,8993	0,9016	0,9850
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	–	0,9928	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)^	USD	–	0,9928	–
	Klasse V (Acc)^	EUR	–	0,9371	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9933	0,9684	1,0445
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9261	0,9215	0,9993
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	1,0135	0,9688	1,0257
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9930	0,9549	1,0161
	Klasse W (Inc)	EUR	0,8793	0,8878	0,9759
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	USD	0,9986	–	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9223	0,9186	0,9961
	Klasse X (Acc)	EUR	1,0189	0,9881	1,0600
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,9435	0,9185	0,9892
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,8823	0,8909	0,9793
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,9225	0,9133	0,9847

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund					
Summe Nettovermögen		USD	11.080.716	10.693.015	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9598	0,9733	–
	Klasse C (Acc)	EUR	0,9721	0,9759	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,1040	1,0683	–
	Klasse E (Acc)	USD	1,1117	1,0699	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0723	1,0586	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,9624	0,9804	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0925	1,0630	–
	Sterling E (Inc)	GBP	0,9624	0,9804	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1,0925	1,0630	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0514	1,0542	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,1075	1,0690	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0682	1,0577	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,9588	0,9796	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0883	1,0622	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,9588	0,9796	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1,0883	1,0622	–
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	438.759.735	393.085.139	505.772.156
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	3,2318	2,7714	3,5434
	Klasse A	EUR	2,6299	2,3412	2,8236
	Klasse B	USD	3,5515	3,0304	3,8553
	Klasse B	EUR	3,1770	2,8125	3,3752
	Klasse C	USD	3,9363	3,3420	4,2305
	Klasse I (Hedged)^	EUR	–	1,4601	1,9105
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	–	–	1,1335
	Klasse W (Acc)	USD	1,7923	1,5179	1,9167
	Klasse W (Acc)	EUR	1,8185	1,5979	1,9032
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
Summe Nettovermögen		EUR	16.994.689	87.957.570	78.396.803
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9548	0,9719	1,1430
	Klasse A (Inc)^	EUR	–	0,9706	1,1421
	Klasse E (Acc)	EUR	0,9935	1,0012	1,1657
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,0543	1,0401	1,1875
	Klasse G (Acc)	EUR	1,0389	1,0523	1,2315
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9835	0,9936	1,1597
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,9340	0,9250	1,0588
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0079	1,0043	1,1574
	Klasse W (Inc)	EUR	0,9594	0,9787	1,1514
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	0,9903	1,1498
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	94.159.520	80.272.370	91.523.113
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1134	1,0113	1,0365
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1039	1,0002	1,0230

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
Summe Nettovermögen			USD 416.636.356	356.717.532	297.752.469
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1814	1,0969	–
	Klasse A (Acc)	EUR	1,6101	1,5428	1,4158
	Klasse A (Inc)^	USD	1,0904	–	–
	Klasse B (Inc)	USD	1,3929	1,3165	1,3070
	Klasse C (Acc)	USD	1,1570	1,0638	1,0280
	Klasse C (Inc)	USD	1,5483	1,4565	1,4388
	Klasse E (Inc)	USD	1,5965	1,4932	1,4670
	Klasse E (Inc)	EUR	1,5822	1,5264	1,4099
	Sterling E (Acc)	GBP	1,8257	1,7605	1,5112
	Sterling E (Inc)	GBP	1,5652	1,5441	1,3549
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1,4270	1,3451	1,3467
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,1352	1,0779	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,8379	1,6857	1,6250
	Klasse W (Acc)	EUR	1,6783	1,5879	1,4391
	Sterling W (Acc)	GBP	1,0209	0,9878	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,1553	1,0834	–
	Klasse W (Inc)	USD	1,5759	1,4784	1,4568
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0810	0,9993	–
	Sterling W (Inc)	GBP	1,5319	1,5165	1,3347

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	804.519.905	890.378.161	1.007.082.724
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9268	0,8656	1,0355
	Klasse A (Inc)	USD	0,8459	0,8209	1,0029
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,8158	0,7932	0,9809
	Klasse C (Acc)	USD	1,1493	1,0680	1,2713
	Klasse E (Acc)	USD	1,1100	1,0294	1,2229
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,9329	0,9021	1,1003
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,0095	0,9568	1,1611
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0031
	Klasse G (Acc)	USD	0,9019	0,8381	0,9978
	Sterling G (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0205
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9626	0,9188	1,1228
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,8347	0,8126	0,9977
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0075
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,7751	0,7684	0,9699
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,8875	0,8429	–
	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	1,1571	1,0742	1,2773
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9877	0,9458	1,0575
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9455	0,9149	1,1170
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0032	0,9518	1,1562
	Klasse W (Inc)	USD	0,9134	0,8810	1,0796
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,8124	0,8164	1,0273
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8079	0,7960	0,9975
	Klasse W (Inc) (M)^	HKD	–	9,7346	–
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,9731	0,9559	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,8951	0,8375	1,0034
	Klasse Z (Acc)	USD	–	–	1,0097
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	0,8427	0,8151	0,9942
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,8665	0,8219	0,9980
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0035

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	60.653.405	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse E (Acc)^	USD	1,0528	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0398	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0330	–	–
	Klasse G (Acc)^	USD	1,0483	–	–
	Klasse G (Inc)^	USD	1,0134	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,0508	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0312	–	–
	Klasse W (Inc)^	USD	1,0141	–	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	EUR	0,9948	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0448	–	–
	Klasse X (Acc)^	USD	1,0558	–	–
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	1.114.260.032	1.009.263.725	984.235.804
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9207	0,8515	0,9909
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9337	0,8591	0,9947
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9365	0,8608	0,9956
	Klasse W (Inc)	EUR	0,9151	0,8568	0,9964
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0619	–	–
	Klasse X (Acc)	EUR	0,9467	0,8670	0,9991
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,9388	0,8621	0,9961
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	35.272.822	25.869.822	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9319	0,8594	–
	Klasse C (Acc)	EUR	0,9368	0,8619	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,9390	0,8629	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,9763	0,8797	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,9636	0,8732	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9368	0,8619	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	NOK	10,6483	–	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9376	0,8621	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0600	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,9750	0,8791	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9622	0,8726	–
	Klasse X (Acc)	EUR	0,9411	0,8639	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	NOK	10,6571	–	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	0,9786	0,8807	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9658	0,8742	–

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

^^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr erneut aufgelegt.

Für den Teilfonds galt am 29. Dezember 2023 ein Fondsfeiertag. Sein letzter Nettoinventarwert zu Handelszwecken wurde daher für den 28. Dezember 2023 ausgewiesen. Bei einem in dem Teilfonds gehaltenen Wertpapier kam es am 29. Dezember 2023 zu einer maßgeblichen Kursbewegung, die zu einer Verringerung des ausgewiesenen Nettoinventarwerts für die Zwecke der Finanzberichterstattung um 146.092 USD geführt hat.

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 anwenden. 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 („Back-Testing“) 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.

^[1] Definiert als der VaR des Fonds, dessen Höchstgrenze einem Prozentsatz des NIW entspricht.

^[2] 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.

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

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 Jahre zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 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	
			2023	2022	2023	2022
BNY Mellon Asian Income Fund	FTSE Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	1.173.069	865.624
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	1.480.673	2.139.196
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	2.468.014	2.419.941
BNY Mellon Brazil Equity Fund	MSCI Brazil 10/40 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.997.271	1.785.850
BNY Mellon Food Innovation Fund**^	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	93.431
BNY Mellon Future Earth Fund**^	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	82.446
BNY Mellon Future Life Fund**^	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	101.933
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	MSCI Emerging Markets Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	909.266	1.735.038
BNY Mellon Global Equity Income Fund	FTSE World Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	13.385.352	20.139.891
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	S&P Global Infrastructure Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	4.706.910	6.677.638
BNY Mellon Global Leaders Fund	MSCI World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	3.560.176	2.178.023
BNY Mellon Global Opportunities Fund	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.371.330	1.303.222
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	60 % MSCI All-Country World Index NR und 40 % JP Morgan Global Government Bond Unhedged Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	1.164.717	1.222.305
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	Russell Nomura Small Cap Index	JPY	5,00 %	5,00 %	817.520.102	1.329.364.114
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund**^	MSCI Europe Index NR	EUR	5,00 %	5,00 %	1.026.897	k. A.
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	MSCI World Index NR	EUR	5,00 %	5,00 %	71.378.296	51.469.515
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	MSCI All-Country World Mid Cap Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	27.803.942	24.907.523
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	S&P EuroZone Small Cap Index TR	EUR	5,00 %	5,00 %	2.612.962	2.354.524
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund**^	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	k. A.	1.146.200
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund^	MSCI Emerging Markets Index NR	USD	5,00 %	k. A.	534.440	516.332
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	19.257.446	k. A.
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	S&P 500 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	14.898.779	17.055.967

^ 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.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für die Anleihefonds ist die Wahrscheinlichkeit eines Rückgangs des Nettoinventarwerts als Folge eines Abwärtstrends der Marktpreise umseitig angegeben.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wäre für Anleihefonds unter Verwendung des Value-at-Risk-Risikomodells der Anlageverwalter (bei denen der VaR auf der 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 2023 und 31. Dezember 2022, der mit einem 99%-igen Konfidenzniveau über die Haltedauer gemessen wird.

Fonds	Konfidenzniveau	VaR-Typ	Haltedauer 2023	Haltedauer 2022	Regulato- rische Grenze 2023	Regulato- rische Grenze 2022	VaR 2023	VaR 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	5,00 %	5,00 %	1,07 %	0,88 %
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	99 %	Absolut	Fünf Tage	k. A.	5,00 %	k. A.	0,79 %	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	10,00 %	10,00 %	k. A.	0,97 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	6,00 %	6,00 %	1,24 %	0,47 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,96 %	8,40 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00 %	102,40 %	84,88 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	141,24 %	119,25 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	104,85 %	106,31 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	137,70 %	121,67 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	102,93 %	100,14 %
BNY Mellon European Credit Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00 %	105,00 %	105,71 %
BNY Mellon Global Credit Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	105,00 %	108,98 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	1,66 %	2,05 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	99 %	Relativ	Ein Tag	Ein Tag	200,00 %	200,00 %	74,64 %	97,03 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	5,72 %	4,15 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	5,55 %	3,23 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	6,19 %	3,55 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	1,62 %	1,78 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	6,07 %	3,77 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,10 %	3,62 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	4,74 %	4,24 %

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der VaR ist die Risikobewertungsmethode, die verwendet wird, um Leverage und Marktrisiko/Volatilität 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 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 Niveaus 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 2023 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausnutzung
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	34,14 %	23,35 %	15,50 %
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	17,60 %	14,69 %	9,00 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	0,00 %	7,84 %	11,98 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	7,23 %	13,37 %	22,50 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	66,01 %	112,57 %	127,31 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	43,22 %	45,56 %	46,69 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	66,68 %	63,62 %	58,52 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	49,60 %	46,25 %	35,79 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	71,81 %	71,09 %	61,43 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	50,79 %	48,74 %	46,57 %
BNY Mellon European Credit Fund	51,05 %	48,20 %	47,69 %
BNY Mellon Global Credit Fund	50,68 %	46,86 %	49,61 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	5,25 %	9,30 %	12,36 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	66,88 %	57,83 %	51,22 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	11,75 %	22,80 %	52,00 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	10,80 %	20,08 %	45,85 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	11,95 %	23,38 %	51,85 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	5,25 %	9,14 %	12,15 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	10,55 %	21,99 %	48,70 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	13,52 %	16,26 %	19,00 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	20,35 %	21,70 %	24,12 %

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausnutzung
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	13,00 %	23,00 %	42,00 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	3,90 %	9,37 %	14,10 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	4,89 %	8,23 %	18,63 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	4,57 %	21,69 %	74,20 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	43,71 %	49,47 %	58,39 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	66,00 %	67,29 %	58,09 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	48,00 %	49,92 %	53,75 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	68,88 %	65,77 %	66,30 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	44,87 %	50,87 %	57,03 %
BNY Mellon European Credit Fund	49,84 %	53,12 %	54,26 %
BNY Mellon Global Credit Fund	57,76 %	50,19 %	55,68 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	6,31 %	8,77 %	13,05 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	45,49 %	47,26 %	48,26 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	20,50 %	33,28 %	51,21 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	16,15 %	29,84 %	47,16 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	17,30 %	29,71 %	58,25 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	5,89 %	8,04 %	12,16 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	18,85 %	32,33 %	47,37 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	2,95 %	9,55 %	22,70 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	15,39 %	18,38 %	21,62 %

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

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 bis zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 angewendet wurde, gestaltet sich wie folgt:

Fonds	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2023	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	488,79 %	511,18 %
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	295,97 %	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	143,64 %	152,11 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	223,94 %	189,49 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	687,71 %	563,71 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	13,80 %	24,29 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	26,36 %	28,74 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	96,05 %	185,89 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	93,42 %	74,09 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	77,79 %	105,62 %
BNY Mellon European Credit Fund	39,38 %	22,99 %
BNY Mellon Global Credit Fund	233,79 %	280,12 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	127,16 %	101,02 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	24,22 %	25,60 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	178,13 %	150,34 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	160,24 %	146,53 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	142,29 %	125,87 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	212,79 %	101,02 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	197,79 %	140,21 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	285,38 %	285,80 %

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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 Bargegenwerte 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 2023 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	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	14.758.249	78.979.914	155.300.238	24.475.034	273.513.435
Barmittel und Bargegenwerte	16.001.080	–	–	–	16.001.080
Margen auf Derivatkontrakte	26.893.536	–	–	–	26.893.536
Forderungen	–	–	–	7.061.672	7.061.672
Gesamtvermögen	57.652.865	78.979.914	155.300.238	31.536.706	323.469.723
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	9.603.795	4.110.588	1.395.128	6.621.372	21.730.883
Margen auf Derivatkontrakte	5.898.280	–	–	–	5.898.280
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.055.403	4.055.403
Verbindlichkeiten insgesamt	15.502.075	4.110.588	1.395.128	10.676.775	31.684.566
Zinssensitivitätslücke insgesamt	42.150.790	74.869.326	153.905.110		

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	11.696.206	3.882.913	7.720.579	1.366.086	24.665.784
Barmittel und Bargegenwerte	430.639	–	–	–	430.639
Margen auf Derivatkontrakte	794.992	–	–	–	794.992
Forderungen	–	–	–	158.320	158.320
Gesamtvermögen	12.921.837	3.882.913	7.720.579	1.524.406	26.049.735
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	290.606	645.574	–	1.103	937.283
Margen auf Derivatkontrakte	2	–	–	–	2
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	22.317	22.317
Verbindlichkeiten insgesamt	290.608	645.574	–	23.420	959.602
Zinssensitivitätslücke insgesamt	12.631.229	3.237.339	7.720.579		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	Unter 1 Monat EUR	1-3 Monate EUR	Über 3 Monate EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	18.993.131	29.921.343	17.460.665	6.635.823	73.010.962
Barmittel und Bargegenwerte	538.131	–	–	–	538.131
Margen auf Derivatkontrakte	727.871	–	–	–	727.871
Forderungen	–	–	–	1.388.155	1.388.155
Gesamtvermögen	20.259.133	29.921.343	17.460.665	8.023.978	75.665.119
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	9.394	178.773	251.276	6.511.631	6.951.074
Banküberziehung	2.883	–	–	–	2.883
Margen auf Derivatkontrakte	39.453	–	–	–	39.453
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.197.409	1.197.409
Verbindlichkeiten insgesamt	51.730	178.773	251.276	7.709.040	8.190.819
Zinssensitivitätslücke insgesamt	20.207.403	29.742.570	17.209.389		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	Unter 1 Monat USD	1-3 Monate USD	Über 3 Monate USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.037.629	15.926.296	6.424.552	342.049	24.730.526
Barmittel und Bargegenwerte	1.686.983	–	–	–	1.686.983
Margen auf Derivatkontrakte	1.070.029	–	–	–	1.070.029
Forderungen	–	–	–	879.704	879.704
Gesamtvermögen	4.794.641	15.926.296	6.424.552	1.221.753	28.367.242

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	20.548	426.288	180.113	567.178	1.194.127
Banküberziehung	2.229	–	–	–	2.229
Margen auf Derivatkontrakte	528.056	–	–	–	528.056
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	659.969	659.969
Verbindlichkeiten insgesamt	550.833	426.288	180.113	1.227.147	2.384.381

Zinssensitivitätslücke insgesamt

4.243.808	15.500.008	6.244.439

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

	Unter 1 Monat USD	1-3 Monate USD	Über 3 Monate USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	499.855	13.788.335	4.927.905	199.972.394	219.188.489
Barmittel und Bargegenwerte	10.599.591	–	–	–	10.599.591
Margen auf Derivatkontrakte	6.453.000	–	–	–	6.453.000
Forderungen	–	–	–	242.354	242.354
Gesamtvermögen	17.552.446	13.788.335	4.927.905	200.214.748	236.483.434

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	6	6
Margen auf Derivatkontrakte	509.794	–	–	–	509.794
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	259.859	259.859
Verbindlichkeiten insgesamt	509.794	–	–	259.865	769.659

Zinssensitivitätslücke insgesamt

17.042.652	13.788.335	4.927.905

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.527.914	156.431.492	50.841.224	3.968.548	212.769.178
Barmittel und Bargegenwerte	3.306.535	–	–	–	3.306.535
Forderungen	–	–	–	4.096.486	4.096.486
Gesamtvermögen	4.834.449	156.431.492	50.841.224	8.065.034	220.172.199

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	9	–	–	1.133.320	1.133.329
Margen auf Derivatkontrakte	5	–	–	–	5
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	313.501	313.501
Verbindlichkeiten insgesamt	14	–	–	1.446.821	1.446.835

Zinssensitivitätslücke insgesamt	4.834.435	156.431.492	50.841.224

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	559.598	35.592.419	36.025.163	1.540.720	73.717.900
Barmittel und Bargegenwerte	290.707	–	–	–	290.707
Margen auf Derivatkontrakte	112.674	–	–	–	112.674
Forderungen	–	–	–	894.960	894.960
Gesamtvermögen	962.979	35.592.419	36.025.163	2.435.680	75.016.241

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	195.100	–	–	495.643	690.743
Margen auf Derivatkontrakte	43.805	–	–	–	43.805
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	77.203	77.203
Verbindlichkeiten insgesamt	238.905	–	–	572.846	811.751

Zinssensitivitätslücke insgesamt	724.074	35.592.419	36.025.163

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.600.141	400.655.442	384.315.622	7.946.106	796.517.311
Barmittel und Bargegenwerte	4.748.302	–	–	–	4.748.302
Margen auf Derivatkontrakte	553.216	–	–	–	553.216
Forderungen	–	–	–	18.008.322	18.008.322
Gesamtvermögen	8.901.659	400.655.442	384.315.622	25.954.428	819.827.151

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4	–	–	20.473	20.477
Banküberziehung	8	–	–	–	8
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	10.863.676	10.863.676
Verbindlichkeiten insgesamt	12	–	–	10.884.149	10.884.161

Zinssensitivitätslücke insgesamt	8.901.647	400.655.442	384.315.622

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	11.220.083	1.038.637.137	369.736.925	15.203.497	1.434.797.642
Barmittel und Bargegenwerte	11.016.097	–	–	–	11.016.097
Forderungen	–	–	–	25.804.379	25.804.379
Gesamtvermögen	22.236.180	1.038.637.137	369.736.925	41.007.876	1.471.618.118

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	158.760	158.760
Banküberziehung	3	–	–	–	3
Margen auf Derivatkontrakte	53	–	–	–	53
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.819.291	3.819.291
Verbindlichkeiten insgesamt	56	–	–	3.978.051	3.978.107

Zinssensitivitätslücke insgesamt	22.236.124	1.038.637.137	369.736.925

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.803.146	109.880.122	153.442.909	8.150.182	274.276.359
Barmittel und Bargegenwerte	5.653.890	–	–	–	5.653.890
Margen auf Derivatkontrakte	1.735.194	–	–	–	1.735.194
Forderungen	–	–	–	3.964.509	3.964.509
Gesamtvermögen	10.192.230	109.880.122	153.442.909	12.114.691	285.629.952

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	341.085	–	–	867.508	1.208.593
Banküberziehung	157	–	–	–	157
Margen auf Derivatkontrakte	27.402	–	–	–	27.402
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	463.935	463.935
Verbindlichkeiten insgesamt	368.644	–	–	1.331.443	1.700.087

Zinssensitivitätslücke insgesamt

9.823.586	109.880.122	153.442.909

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	697.702	8.309.077	14.152.442	11.746	23.170.967
Barmittel und Bargegenwerte	171.857	–	–	–	171.857
Margen auf Derivatkontrakte	87.039	–	–	–	87.039
Forderungen	–	–	–	416.746	416.746
Gesamtvermögen	956.598	8.309.077	14.152.442	428.492	23.846.609

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	40.407	–	–	38.471	78.878
Banküberziehung	95	–	–	–	95
Margen auf Derivatkontrakte	62.052	–	–	–	62.052
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	70.279	70.279
Verbindlichkeiten insgesamt	102.554	–	–	108.750	211.304

Zinssensitivitätslücke insgesamt

854.044	8.309.077	14.152.442

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	610.706	11.434.973	15.627.221	555.293	28.228.193
Barmittel und Bargegenwerte	236.872	–	–	–	236.872
Forderungen	–	–	–	596.032	596.032
Gesamtvermögen	847.578	11.434.973	15.627.221	1.151.325	29.061.097

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	329.474	329.474
Banküberziehung	52	–	–	–	52
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	168.070	168.070
Verbindlichkeiten insgesamt	52	–	–	497.544	497.596

Zinssensitivitätslücke insgesamt	847.526	11.434.973	15.627.221		

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.826.221	7.194.728	13.293.836	350.030	22.664.815
Barmittel und Bargegenwerte	173.612	–	–	–	173.612
Margen auf Derivatkontrakte	39.385	–	–	–	39.385
Forderungen	–	–	–	459.485	459.485
Gesamtvermögen	2.039.218	7.194.728	13.293.836	809.515	23.337.297

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	12.012	–	–	293.362	305.374
Margen auf Derivatkontrakte	42.615	–	–	–	42.615
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	88.616	88.616
Verbindlichkeiten insgesamt	54.627	–	–	381.978	436.605

Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.984.591	7.194.728	13.293.836		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	695.401	11.010.849	14.795.880	3.307.560	29.809.690
Barmittel und Bargegenwerte	615.853	–	–	–	615.853
Margen auf Derivatkontrakte	15.005	–	–	–	15.005
Forderungen	–	–	–	552.006	552.006
Gesamtvermögen	1.326.259	11.010.849	14.795.880	3.859.566	30.992.554

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	21.687	–	–	435.811	457.498
Margen auf Derivatkontrakte	37.502	–	–	–	37.502
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	47.061	47.061
Verbindlichkeiten insgesamt	59.189	–	–	482.872	542.061

Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.267.070	11.010.849	14.795.880		

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	6.472.699	79.599.919	90.113.165	2.608.749	178.794.532
Barmittel und Bargegenwerte	4.756.407	–	–	–	4.756.407
Margen auf Derivatkontrakte	2.949.674	–	–	–	2.949.674
Forderungen	–	–	–	3.291.586	3.291.586
Gesamtvermögen	14.178.780	79.599.919	90.113.165	5.900.335	189.792.199

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.305.355	–	174.375	27.826	1.507.556
Margen auf Derivatkontrakte	1.286.930	–	–	–	1.286.930
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	875.406	875.406
Verbindlichkeiten insgesamt	2.592.285	–	174.375	903.232	3.669.892

Zinssensitivitätslücke insgesamt	11.586.495	79.599.919	89.938.790		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon European Credit Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.105.061	28.640.801	25.204.935	1.404.605	57.355.402
Barmittel und Bargegenwerte	348.006	–	–	–	348.006
Margen auf Derivatkontrakte	185.214	–	–	–	185.214
Forderungen	–	–	–	757.919	757.919
Gesamtvermögen	2.638.281	28.640.801	25.204.935	2.162.524	58.646.541
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	103.192	106.853	–	11.878	221.923
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	23.701	23.701
Verbindlichkeiten insgesamt	103.192	106.853	–	35.579	245.624
Zinssensitivitätslücke insgesamt	2.535.089	28.533.948	25.204.935		
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	324.052	24.327.406	5.103.171	1.371.940	31.126.569
Barmittel und Bargegenwerte	374.597	–	–	–	374.597
Forderungen	–	–	–	585.662	585.662
Gesamtvermögen	698.649	24.327.406	5.103.171	1.957.602	32.086.828
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.102	238.896	22.590	131.197	395.785
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	450.528	450.528
Verbindlichkeiten insgesamt	3.102	238.896	22.590	581.725	846.313
Zinssensitivitätslücke insgesamt	695.547	24.088.510	5.080.581		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	34.086.123	204.258.553	239.428.323	9.533.527	487.306.526
Barmittel und Bargegenwerte	2.382.313	–	–	–	2.382.313
Margen auf Derivatkontrakte	9.767.629	–	–	–	9.767.629
Forderungen	–	–	–	7.224.295	7.224.295
Gesamtvermögen	46.236.065	204.258.553	239.428.323	16.757.822	506.680.763

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.881.824	–	–	12.193.375	14.075.199
Banküberziehung	106	–	–	–	106
Margen auf Derivatkontrakte	556.685	–	–	–	556.685
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.579.937	4.579.937
Verbindlichkeiten insgesamt	2.438.615	–	–	16.773.312	19.211.927

Zinssensitivitätslücke insgesamt	43.797.450	204.258.553	239.428.323

BNY Mellon Global Credit Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	28.877.000	308.063.457	578.914.519	90.300.351	1.006.155.327
Barmittel und Bargegenwerte	21.656.496	–	–	–	21.656.496
Margen auf Derivatkontrakte	29.868.304	–	–	–	29.868.304
Forderungen	–	–	–	13.883.564	13.883.564
Gesamtvermögen	80.401.800	308.063.457	578.914.519	104.183.915	1.071.563.691

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.495.803	9.489.060	–	9.131.731	23.116.594
Banküberziehung	3.907	–	–	–	3.907
Margen auf Derivatkontrakte	4.441.185	–	–	–	4.441.185
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.941.539	3.941.539
Verbindlichkeiten insgesamt	8.940.895	9.489.060	–	13.073.270	31.503.225

Zinssensitivitätslücke insgesamt	71.460.905	298.574.397	578.914.519

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	21.470.198	91.209.961	46.424.900	21.341.160	180.446.219
Barmittel und Bargegenwerte	1.864.236	–	–	–	1.864.236
Margen auf Derivatkontrakte	8.462.920	–	–	–	8.462.920
Forderungen	–	–	–	1.362.894	1.362.894
Gesamtvermögen	31.797.354	91.209.961	46.424.900	22.704.054	192.136.269

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.980.425	–	–	7.309.334	9.289.759
Banküberziehung	55	–	–	–	55
Margen auf Derivatkontrakte	14.747	–	–	–	14.747
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	253.875	253.875
Verbindlichkeiten insgesamt	1.995.227	–	–	7.563.209	9.558.436

Zinssensitivitätslücke insgesamt	29.802.127	91.209.961	46.424.900

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	609.604	84.001.453	27.038.648	991.351	112.641.056
Barmittel und Bargegenwerte	1.281.424	–	–	–	1.281.424
Forderungen	–	–	–	1.856.372	1.856.372
Gesamtvermögen	1.891.028	84.001.453	27.038.648	2.847.723	115.778.852

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	354.649	354.649
Banküberziehung	8.076	–	–	–	8.076
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	278.722	278.722
Verbindlichkeiten insgesamt	8.076	–	–	633.371	641.447

Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.882.952	84.001.453	27.038.648

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	246.255.359	114.776.683	98.844.199	758.032.654	1.217.908.895
Barmittel und Bargegenwerte	48.098.303	–	–	–	48.098.303
Margen auf Derivatkontrakte	21.078.591	–	–	–	21.078.591
Forderungen	–	–	–	15.072.781	15.072.781
Gesamtvermögen	315.432.253	114.776.683	98.844.199	773.105.435	1.302.158.570

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	13.888.675	–	–	5.972.133	19.860.808
Banküberziehung	198.715	–	–	–	198.715
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	21.694.947	21.694.947
Verbindlichkeiten insgesamt	14.087.390	–	–	27.667.080	41.754.470

Zinssensitivitätslücke insgesamt	301.344.863	114.776.683	98.844.199

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Unter 1 Jahr GBP	1-6 Jahre GBP	Über 6 Jahre GBP	Unver- zinslich GBP	Gesamt 2023 GBP
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	7.404.961	5.142.453	3.175.117	24.182.111	39.904.642
Barmittel und Bargegenwerte	785.214	–	–	–	785.214
Margen auf Derivatkontrakte	708.468	–	–	–	708.468
Forderungen	–	–	–	71.936	71.936
Gesamtvermögen	8.898.643	5.142.453	3.175.117	24.254.047	41.470.260

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	449.103	–	–	119.789	568.892
Banküberziehung	572	–	–	–	572
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	100.331	100.331
Verbindlichkeiten insgesamt	449.675	–	–	220.120	669.795

Zinssensitivitätslücke insgesamt	8.448.968	5.142.453	3.175.117

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.436.490	62.990.089	18.033.658	135.889.805	225.350.042
Barmittel und Bargegenwerte	4.393.303	–	–	–	4.393.303
Margen auf Derivatkontrakte	5.186.032	–	–	–	5.186.032
Forderungen	–	–	–	1.570.617	1.570.617
Gesamtvermögen	18.015.825	62.990.089	18.033.658	137.460.422	236.499.994

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.653.855	–	–	4.792.264	7.446.119
Banküberziehung	132.048	–	–	–	132.048
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	564.360	564.360
Verbindlichkeiten insgesamt	2.785.903	–	–	5.356.624	8.142.527

Zinssensitivitätslücke insgesamt	15.229.922	62.990.089	18.033.658

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	6.283.354	710.901.596	16.120.361	31.004.249	764.309.560
Barmittel und Bargegenwerte	116.440	–	–	–	116.440
Margen auf Derivatkontrakte	17.330.000	–	–	–	17.330.000
Forderungen	–	–	–	21.016.363	21.016.363
Gesamtvermögen	23.729.794	710.901.596	16.120.361	52.020.612	802.772.363

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	14.541.434	14.541.434
Banküberziehung	9.323	–	–	–	9.323
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	11.325.746	11.325.746
Verbindlichkeiten insgesamt	9.323	–	–	25.867.180	25.876.503

Zinssensitivitätslücke insgesamt	23.720.471	710.901.596	16.120.361

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	548.356	4.112.480	2.834.293	20.659.180	28.154.309
Barmittel und Bargegenwerte	1.574.750	–	–	–	1.574.750
Forderungen	–	–	–	67.595	67.595
Gesamtvermögen	2.123.106	4.112.480	2.834.293	20.726.775	29.796.654
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	88.838	88.838
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	12.051	12.051
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	100.889	100.889
Zinssensitivitätslücke insgesamt	2.123.106	4.112.480	2.834.293		
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	41.979.115	181.950.225	99.251.119	7.956.116	331.136.575
Barmittel und Bargegenwerte	3.201.058	–	–	–	3.201.058
Margen auf Derivatkontrakte	6.900.791	–	–	–	6.900.791
Forderungen	–	–	–	8.176.161	8.176.161
Gesamtvermögen	52.080.964	181.950.225	99.251.119	16.132.277	349.414.585
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.794.690	–	–	7.250.684	11.045.374
Margen auf Derivatkontrakte	31.742	–	–	–	31.742
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.555.815	5.555.815
Verbindlichkeiten insgesamt	3.826.432	–	–	12.806.499	16.632.931
Zinssensitivitätslücke insgesamt	48.254.532	181.950.225	99.251.119		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.514.167	1.617.270	1.335.215	11.312.561	16.779.213
Barmittel und Bargegenwerte	555.260	–	–	–	555.260
Margen auf Derivatkontrakte	305.086	–	–	–	305.086
Forderungen	–	–	–	80.124	80.124
Gesamtvermögen	3.374.513	1.617.270	1.335.215	11.392.685	17.719.683
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	192.063	–	–	165.752	357.815
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	367.179	367.179
Verbindlichkeiten insgesamt	192.063	–	–	532.931	724.994
Zinssensitivitätslücke insgesamt	3.182.450	1.617.270	1.335.215		

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	508.147	37.381.343	47.886.882	6.821.544	92.597.916
Barmittel und Bargegenwerte	117.970	–	–	–	117.970
Margen auf Derivatkontrakte	4.920.640	–	–	–	4.920.640
Forderungen	–	–	–	1.209.271	1.209.271
Gesamtvermögen	5.546.757	37.381.343	47.886.882	8.030.815	98.845.797
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	848.129	830.110	50.944	1.498.457	3.227.640
Banküberziehung	129.659	–	–	–	129.659
Margen auf Derivatkontrakte	1.193.722	–	–	–	1.193.722
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	135.256	135.256
Verbindlichkeiten insgesamt	2.171.510	830.110	50.944	1.633.713	4.686.277
Zinssensitivitätslücke insgesamt	3.375.247	36.551.233	47.835.938		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	11.449.879	238.128.310	532.601.586	16.790.816	798.970.591
Barmittel und Bargegenwerte	675.677	–	–	–	675.677
Forderungen	–	–	–	10.380.656	10.380.656
Gesamtvermögen	12.125.556	238.128.310	532.601.586	27.171.472	810.026.924

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	102.853	102.853
Banküberziehung	74	–	–	–	74
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.404.092	5.404.092
Verbindlichkeiten insgesamt	74	–	–	5.506.945	5.507.019

Zinssensitivitätslücke insgesamt	12.125.482	238.128.310	532.601.586

Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2023 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.009.424	27.087.519	25.294.545	19.803	56.411.291
Barmittel und Bargegenwerte	3.531.153	–	–	–	3.531.153
Margen auf Derivatkontrakte	891.751	–	–	–	891.751
Forderungen	–	–	–	880.070	880.070
Gesamtvermögen	8.432.328	27.087.519	25.294.545	899.873	61.714.265

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	297.759	–	–	704.216	1.001.975
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	58.885	58.885
Verbindlichkeiten insgesamt	297.759	–	–	763.101	1.060.860

Zinssensitivitätslücke insgesamt	8.134.569	27.087.519	25.294.545

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	49.292.870	520.778.971	496.501.765	381.116	1.066.954.722
Barmittel und Bargegenwerte	30.761.650	–	–	–	30.761.650
Margen auf Derivatkontrakte	10.411.181	–	–	–	10.411.181
Forderungen	–	–	–	19.017.493	19.017.493
Gesamtvermögen	90.465.701	520.778.971	496.501.765	19.398.609	1.127.145.046

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.150.027	4.750.096	–	26.854	7.926.977
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.958.037	4.958.037
Verbindlichkeiten insgesamt	3.150.027	4.750.096	–	4.984.891	12.885.014

Zinssensitivitätslücke insgesamt	87.315.674	516.028.875	496.501.765		

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2023 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16.433	21.652.192	12.690.789	37.745	34.397.159
Barmittel und Bargegenwerte	257.806	–	–	–	257.806
Margen auf Derivatkontrakte	139.111	–	–	–	139.111
Forderungen	–	–	–	581.404	581.404
Gesamtvermögen	413.350	21.652.192	12.690.789	619.149	35.375.480

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	76.772	–	–	2.165	78.937
Margen auf Derivatkontrakte	4.800	–	–	–	4.800
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	18.921	18.921
Verbindlichkeiten insgesamt	81.572	–	–	21.086	102.658

Zinssensitivitätslücke insgesamt	331.778	21.652.192	12.690.789		

* 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 2022 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	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	119.800.186	37.449.701	120.485.509	35.023.859	312.759.255
Barmittel und Bargegenwerte	19.806.407	–	–	–	19.806.407
Margen auf Derivatkontrakte	26.871.213	–	–	–	26.871.213
Forderungen	–	–	–	5.645.848	5.645.848
Gesamtvermögen	166.477.806	37.449.701	120.485.509	40.669.707	365.082.723
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.334.521	9.386.850	1.154.328	10.505.261	25.380.960
Banküberziehung	508.227	–	–	–	508.227
Margen auf Derivatkontrakte	68.994	–	–	–	68.994
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.944.226	3.944.226
Verbindlichkeiten insgesamt	4.911.742	9.386.850	1.154.328	14.449.487	29.902.407
Zinssensitivitätslücke insgesamt	161.566.064	28.062.851	119.331.181		
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Unter 1 Monat GBP	1-3 Monate GBP	Über 3 Monate GBP	Unver- zinslich GBP	Gesamt 2022 GBP
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	57.967.935	39.022.656	13.332.715	31.468.867	141.792.173
Barmittel und Bargegenwerte	2.166.813	–	–	–	2.166.813
Margen auf Derivatkontrakte	1.888.351	–	–	–	1.888.351
Forderungen	–	–	–	3.138.255	3.138.255
Gesamtvermögen	62.023.099	39.022.656	13.332.715	34.607.122	148.985.592
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.554	47.428	–	5.514.517	5.563.499
Banküberziehung	307	–	–	–	307
Margen auf Derivatkontrakte	22.880	–	–	–	22.880
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.612.402	3.612.402
Verbindlichkeiten insgesamt	24.741	47.428	–	9.126.919	9.199.088
Zinssensitivitätslücke insgesamt	61.998.358	38.975.228	13.332.715		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	Unter 1 Monat EUR	1-3 Monate EUR	Über 3 Monate EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	78.493.112	20.980.143	8.533.870	16.393.544	124.400.669
Barmittel und Bargegenwerte	1.821.223	–	–	–	1.821.223
Margen auf Derivatkontrakte	979.396	–	–	–	979.396
Forderungen	–	–	–	1.106.136	1.106.136
Gesamtvermögen	81.293.731	20.980.143	8.533.870	17.499.680	128.307.424
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	9.039	7.261.868	3.480.669	10.751.576
Banküberziehung	3.114	–	–	–	3.114
Margen auf Derivatkontrakte	165.356	–	–	–	165.356
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	4.245.185	4.245.185
Verbindlichkeiten insgesamt	168.470	9.039	7.261.868	7.725.854	15.165.231
Zinssensitivitätslücke insgesamt	81.125.261	20.971.104	1.272.002		

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	Unter 1 Monat USD	1-3 Monate USD	Über 3 Monate USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.734.441	11.158.437	8.643.843	322.481	21.859.202
Barmittel und Bargegenwerte	1.344.114	–	–	–	1.344.114
Margen auf Derivatkontrakte	2.111.390	–	–	–	2.111.390
Forderungen	–	–	–	128.588	128.588
Gesamtvermögen	5.189.945	11.158.437	8.643.843	451.069	25.443.294
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	32.078	1.046.793	49.274	236.734	1.364.879
Banküberziehung	1.676	–	–	–	1.676
Margen auf Derivatkontrakte	616.410	–	–	–	616.410
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	121.223	121.223
Verbindlichkeiten insgesamt	650.164	1.046.793	49.274	357.957	2.104.188
Zinssensitivitätslücke insgesamt	4.539.781	10.111.644	8.594.569		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	50.090.121	–	–	465.709.292	515.799.413
Barmittel und Bargegenwerte	33.357.102	–	–	–	33.357.102
Margen auf Derivatkontrakte	7.002.749	–	–	–	7.002.749
Forderungen	–	–	–	355.935	355.935
Gesamtvermögen	90.449.972	–	–	466.065.227	556.515.199
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	595.325	–	–	33	595.358
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	343.774	343.774
Verbindlichkeiten insgesamt	595.325	–	–	343.807	939.132
Zinssensitivitätslücke insgesamt	89.854.647	–	–		
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	105.692	115.846.352	59.844.119	785.200	176.581.363
Barmittel und Bargegenwerte	1.745.292	–	–	–	1.745.292
Margen auf Derivatkontrakte	298.861	–	–	–	298.861
Forderungen	–	–	–	3.506.315	3.506.315
Gesamtvermögen	2.149.845	115.846.352	59.844.119	4.291.515	182.131.831
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	3.087.854	3.087.854
Margen auf Derivatkontrakte	1.197	–	–	–	1.197
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	139.544	139.544
Verbindlichkeiten insgesamt	1.197	–	–	3.227.398	3.228.595
Zinssensitivitätslücke insgesamt	2.148.648	115.846.352	59.844.119		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	58.484	25.570.021	20.445.617	230.438	46.304.560
Barmittel und Bargegenwerte	165.112	–	–	–	165.112
Margen auf Derivatkontrakte	338.921	–	–	–	338.921
Forderungen	–	–	–	572.273	572.273
Gesamtvermögen	562.517	25.570.021	20.445.617	802.711	47.380.866

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	24.305	–	–	716.228	740.533
Margen auf Derivatkontrakte	34.663	–	–	–	34.663
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	62.946	62.946

Verbindlichkeiten insgesamt	58.968	–	–	779.174	838.142

Zinssensitivitätslücke insgesamt	503.549	25.570.021	20.445.617		

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	63.206	458.799.609	467.587.989	1.226.961	927.677.765
Barmittel und Bargegenwerte	10.019.740	–	–	–	10.019.740
Margen auf Derivatkontrakte	725.012	–	–	–	725.012
Forderungen	–	–	–	41.733.455	41.733.455
Gesamtvermögen	10.807.958	458.799.609	467.587.989	42.960.416	980.155.972

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	110.805	–	–	3.309.099	3.419.904
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	27.921.818	27.921.818

Verbindlichkeiten insgesamt	110.805	–	–	31.230.917	31.341.722

Zinssensitivitätslücke insgesamt	10.697.153	458.799.609	467.587.989		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	109.800	837.708.220	537.014.121	4.660.805	1.379.492.946
Barmittel und Bargegenwerte	8.247.680	–	–	–	8.247.680
Margen auf Derivatkontrakte	2.622.553	–	–	–	2.622.553
Forderungen	–	–	–	48.720.421	48.720.421
Gesamtvermögen	10.980.033	837.708.220	537.014.121	53.381.226	1.439.083.600
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	3.999.065	3.999.065
Margen auf Derivatkontrakte	10.494	–	–	–	10.494
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	17.597.574	17.597.574
Verbindlichkeiten insgesamt	10.494	–	–	21.596.639	21.607.133
Zinssensitivitätslücke insgesamt	10.969.539	837.708.220	537.014.121		

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	61.869	133.472.743	187.218.172	19.595.949	340.348.733
Barmittel und Bargegenwerte	7.306.736	–	–	–	7.306.736
Margen auf Derivatkontrakte	1.948.187	–	–	–	1.948.187
Forderungen	–	–	–	5.387.780	5.387.780
Gesamtvermögen	9.316.792	133.472.743	187.218.172	24.983.729	354.991.436
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	5.591	–	–	1.970.512	1.976.103
Banküberziehung	32	–	–	–	32
Margen auf Derivatkontrakte	104.233	–	–	–	104.233
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	664.759	664.759
Verbindlichkeiten insgesamt	109.856	–	–	2.635.271	2.745.127
Zinssensitivitätslücke insgesamt	9.206.936	133.472.743	187.218.172		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	53.410	4.524.258	17.022.043	5.256	21.604.967
Barmittel und Bargegenwerte	2.284.652	–	–	–	2.284.652
Margen auf Derivatkontrakte	74.257	–	–	–	74.257
Forderungen	–	–	–	445.473	445.473
Gesamtvermögen	2.412.319	4.524.258	17.022.043	450.729	24.409.349

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	10.234	–	–	12.781	23.015
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	139.436	139.436
Verbindlichkeiten insgesamt	10.234	–	–	152.217	162.451

Zinssensitivitätslücke insgesamt	2.402.085	4.524.258	17.022.043

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	8.427.073	15.064.141	142.171	23.633.385
Barmittel und Bargegenwerte	1.435.740	–	–	–	1.435.740
Forderungen	–	–	–	479.325	479.325
Gesamtvermögen	1.435.740	8.427.073	15.064.141	621.496	25.548.450

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	95.817	95.817
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	188.994	188.994
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	284.811	284.811

Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.435.740	8.427.073	15.064.141

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	163.117	4.539.335	17.905.546	57.037	22.665.035
Barmittel und Bargegenwerte	1.437.336	–	–	–	1.437.336
Margen auf Derivatkontrakte	18.067	–	–	–	18.067
Forderungen	–	–	–	464.026	464.026
Gesamtvermögen	1.618.520	4.539.335	17.905.546	521.063	24.584.464
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.363	–	–	81.275	83.638
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	8.876	8.876
Verbindlichkeiten insgesamt	2.363	–	–	90.151	92.514
Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.616.157	4.539.335	17.905.546		

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	123.744	10.264.049	21.320.954	3.798.610	35.507.357
Barmittel und Bargegenwerte	2.653.157	–	–	–	2.653.157
Margen auf Derivatkontrakte	364.635	–	–	–	364.635
Forderungen	–	–	–	712.517	712.517
Gesamtvermögen	3.141.536	10.264.049	21.320.954	4.511.127	39.237.666
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	47.614	–	–	844.024	891.638
Margen auf Derivatkontrakte	30.884	–	–	–	30.884
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	62.064	62.064
Verbindlichkeiten insgesamt	78.498	–	–	906.088	984.586
Zinssensitivitätslücke insgesamt	3.063.038	10.264.049	21.320.954		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Euroland Bond Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.661.737	78.462.793	86.649.994	3.022.233	169.796.757
Barmittel und Bargegenwerte	6.174.319	–	–	–	6.174.319
Margen auf Derivatkontrakte	652.798	–	–	–	652.798
Forderungen	–	–	–	1.666.364	1.666.364
Gesamtvermögen	8.488.854	78.462.793	86.649.994	4.688.597	178.290.238
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	940.665	42.467	–	86.989	1.070.121
Margen auf Derivatkontrakte	148	–	–	–	148
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	636.480	636.480
Verbindlichkeiten insgesamt	940.813	42.467	–	723.469	1.706.749
Zinssensitivitätslücke insgesamt	7.548.041	78.420.326	86.649.994		
BNY Mellon European Credit Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	456.225	22.068.346	18.776.415	1.316.008	42.616.994
Barmittel und Bargegenwerte	1.154.877	–	–	–	1.154.877
Margen auf Derivatkontrakte	65.082	–	–	–	65.082
Forderungen	–	–	–	691.889	691.889
Gesamtvermögen	1.676.184	22.068.346	18.776.415	2.007.897	44.528.842
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	87.947	14.684	–	11.771	114.402
Margen auf Derivatkontrakte	4	–	–	–	4
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	549.815	549.815
Verbindlichkeiten insgesamt	87.951	14.684	–	561.586	664.221
Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.588.233	22.053.662	18.776.415		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	24.085.504	171.385.983	201.752.696	9.740.353	406.964.536
Barmittel und Bargegenwerte	3.878.191	–	–	–	3.878.191
Margen auf Derivatkontrakte	3.600.625	–	–	–	3.600.625
Forderungen	–	–	–	8.485.407	8.485.407
Gesamtvermögen	31.564.320	171.385.983	201.752.696	18.225.760	422.928.759

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	92.838	–	–	7.331.433	7.424.271
Banküberziehung	150.911	–	–	–	150.911
Margen auf Derivatkontrakte	303.373	–	–	–	303.373
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	6.694.691	6.694.691
Verbindlichkeiten insgesamt	547.122	–	–	14.026.124	14.573.246
Zinssensitivitätslücke insgesamt	31.017.198	171.385.983	201.752.696		

BNY Mellon Global Credit Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	9.915.961	159.369.524	196.360.011	11.806.366	377.451.862
Barmittel und Bargegenwerte	2.930.230	–	–	–	2.930.230
Margen auf Derivatkontrakte	9.374.926	–	–	–	9.374.926
Forderungen	–	–	–	5.129.683	5.129.683
Gesamtvermögen	22.221.117	159.369.524	196.360.011	16.936.049	394.886.701

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.865.934	3.373.387	–	1.921.723	7.161.044
Banküberziehung	950.423	–	–	–	950.423
Margen auf Derivatkontrakte	507.229	–	–	–	507.229
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.518.828	1.518.828
Verbindlichkeiten insgesamt	3.323.586	3.373.387	–	3.440.551	10.137.524
Zinssensitivitätslücke insgesamt	18.897.531	155.996.137	196.360.011		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	46.443.431	164.210.427	96.744.760	23.489.861	330.888.479
Barmittel und Bargegenwerte	13.575.817	–	–	–	13.575.817
Margen auf Derivatkontrakte	6.575.294	–	–	–	6.575.294
Forderungen	–	–	–	2.852.981	2.852.981
Gesamtvermögen	66.594.542	164.210.427	96.744.760	26.342.842	353.892.571

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	8.388.906	8.388.906
Banküberziehung	6	–	–	–	6
Margen auf Derivatkontrakte	213.548	–	–	–	213.548
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	289.049	289.049
Verbindlichkeiten insgesamt	213.554	–	–	8.677.955	8.891.509
Zinssensitivitätslücke insgesamt	66.380.988	164.210.427	96.744.760		

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	417.341	66.741.949	39.561.556	344.203	107.065.049
Barmittel und Bargegenwerte	3.235.084	–	–	–	3.235.084
Forderungen	–	–	–	1.681.377	1.681.377
Gesamtvermögen	3.652.425	66.741.949	39.561.556	2.025.580	111.981.510

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	565.872	565.872
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.532.395	1.532.395
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	2.098.267	2.098.267
Zinssensitivitätslücke insgesamt	3.652.425	66.741.949	39.561.556		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	135.855.815	205.562.819	278.805.454	1.391.125.801	2.011.349.889
Barmittel und Bargegenwerte	64.974.947	–	–	–	64.974.947
Margen auf Derivatkontrakte	56.009.210	–	–	–	56.009.210
Forderungen	–	–	–	22.790.453	22.790.453
Gesamtvermögen	256.839.972	205.562.819	278.805.454	1.413.916.254	2.155.124.499

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	18.255.185	–	–	7.204.631	25.459.816
Banküberziehung	3.130.555	–	–	–	3.130.555
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	21.272.843	21.272.843
Verbindlichkeiten insgesamt	21.385.740	–	–	28.477.474	49.863.214

Zinssensitivitätslücke insgesamt	235.454.232	205.562.819	278.805.454

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Unter 1 Jahr GBP	1-6 Jahre GBP	Über 6 Jahre GBP	Unver- zinslich GBP	Gesamt 2022 GBP
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.185.250	8.634.708	6.951.473	37.605.534	57.376.965
Barmittel und Bargegenwerte	2.792.729	–	–	–	2.792.729
Margen auf Derivatkontrakte	1.227.269	–	–	–	1.227.269
Forderungen	–	–	–	560.297	560.297
Gesamtvermögen	8.205.248	8.634.708	6.951.473	38.165.831	61.957.260

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	494.045	–	–	608.741	1.102.786
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	503.801	503.801
Verbindlichkeiten insgesamt	494.045	–	–	1.112.542	1.606.587

Zinssensitivitätslücke insgesamt	7.711.203	8.634.708	6.951.473

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	42.343.779	30.992.619	35.895.589	222.932.528	332.164.515
Barmittel und Bargegenwerte	13.357.037	–	–	–	13.357.037
Margen auf Derivatkontrakte	24.222.460	–	–	–	24.222.460
Forderungen	–	–	–	854.193	854.193
Gesamtvermögen	79.923.276	30.992.619	35.895.589	223.786.721	370.598.205

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.864.121	–	–	18.323.199	21.187.320
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.860.528	2.860.528
Verbindlichkeiten insgesamt	2.864.121	–	–	21.183.727	24.047.848

Zinssensitivitätslücke insgesamt	77.059.155	30.992.619	35.895.589

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	493.622.073	12.054.628	24.676.361	530.353.062
Barmittel und Bargegenwerte	2.923.857	–	–	–	2.923.857
Margen auf Derivatkontrakte	23.110.000	–	–	–	23.110.000
Forderungen	–	–	–	7.950.684	7.950.684
Gesamtvermögen	26.033.857	493.622.073	12.054.628	32.627.045	564.337.603

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	28.018.215	28.018.215
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.038.128	1.038.128
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	29.056.343	29.056.343

Zinssensitivitätslücke insgesamt	26.033.857	493.622.073	12.054.628

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	600.343	3.376.669	3.627.710	17.221.282	24.826.004
Barmittel und Bargegenwerte	1.064.323	–	–	–	1.064.323
Forderungen	–	–	–	78.317	78.317
Gesamtvermögen	1.664.666	3.376.669	3.627.710	17.299.599	25.968.644

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	132.984	132.984
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	6.344	6.344
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	139.328	139.328

Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.664.666	3.376.669	3.627.710		

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	66.220.538	143.881.575	95.670.074	14.690.440	320.462.627
Barmittel und Bargegenwerte	12.983.643	–	–	–	12.983.643
Margen auf Derivatkontrakte	272.481	–	–	–	272.481
Forderungen	–	–	–	15.503.947	15.503.947
Gesamtvermögen	79.476.662	143.881.575	95.670.074	30.194.387	349.222.698

Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	2.570.305	2.570.305
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	212.339	–	–	–	212.339
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	13.249.651	13.249.651
Verbindlichkeiten insgesamt	212.340	–	–	15.819.956	16.032.296

Zinssensitivitätslücke insgesamt	79.264.322	143.881.575	95.670.074		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.258.420	9.247.683	10.574.648	55.162.602	83.243.353
Barmittel und Bargegenwerte	3.775.350	–	–	–	3.775.350
Margen auf Derivatkontrakte	1.818.157	–	–	–	1.818.157
Forderungen	–	–	–	320.097	320.097
Gesamtvermögen	13.851.927	9.247.683	10.574.648	55.482.699	89.156.957

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	612.839	–	–	343.366	956.205
Banküberziehung	127.998	–	–	–	127.998
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	112.102	112.102

Verbindlichkeiten insgesamt	740.837	–	–	455.468	1.196.305

Zinssensitivitätslücke insgesamt	13.111.090	9.247.683	10.574.648		

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.770.034	27.474.553	50.898.199	149.653	80.292.439
Barmittel und Bargegenwerte	648.777	–	–	–	648.777
Margen auf Derivatkontrakte	2.311.282	–	–	–	2.311.282
Forderungen	–	–	–	991.816	991.816
Gesamtvermögen	4.730.093	27.474.553	50.898.199	1.141.469	84.244.314

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	219.533	135.318	–	2.304.824	2.659.675
Banküberziehung	1.173.514	–	–	–	1.173.514
Margen auf Derivatkontrakte	6	–	–	–	6
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	138.749	138.749

Verbindlichkeiten insgesamt	1.393.053	135.318	–	2.443.573	3.971.944

Zinssensitivitätslücke insgesamt	3.337.040	27.339.235	50.898.199		

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2022 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.294.982	163.550.867	682.755.786	4.916.513	855.518.148
Barmittel und Bargegenwerte	25.146.277	–	–	–	25.146.277
Forderungen	–	–	–	10.666.937	10.666.937
Gesamtvermögen	29.441.259	163.550.867	682.755.786	15.583.450	891.331.362

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	104.789	104.789
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	848.412	848.412
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	953.201	953.201

Zinssensitivitätslücke insgesamt	29.441.259	163.550.867	682.755.786

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	45.699.914	511.517.742	424.280.648	508.510	982.006.814
Barmittel und Bargegenwerte	17.600.086	–	–	–	17.600.086
Margen auf Derivatkontrakte	1.325.513	–	–	–	1.325.513
Forderungen	–	–	–	14.431.451	14.431.451
Gesamtvermögen	64.625.513	511.517.742	424.280.648	14.939.961	1.015.363.864

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.748.690	–	–	68.756	2.817.446
Margen auf Derivatkontrakte	838.858	–	–	–	838.858
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.443.835	2.443.835
Verbindlichkeiten insgesamt	3.587.548	–	–	2.512.591	6.100.139

Zinssensitivitätslücke insgesamt	61.037.965	511.517.742	424.280.648

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2022 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	98.735	13.168.175	10.781.976	54.623	24.103.509
Barmittel und Bargegenwerte	1.616.998	–	–	–	1.616.998
Margen auf Derivatkontrakte	152.377	–	–	–	152.377
Forderungen	–	–	–	156.340	156.340
Gesamtvermögen	1.868.110	13.168.175	10.781.976	210.963	26.029.224
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	37.543	–	–	1.276	38.819
Margen auf Derivatkontrakte	83.864	–	–	–	83.864
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	36.719	36.719
Verbindlichkeiten insgesamt	121.407	–	–	37.995	159.402
Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.746.703	13.168.175	10.781.976		

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 der Schwankungen vorherrschender Marktzinsen zu profitieren bzw. dies zu begrenzen.

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 75 Basispunkte („Bp.“) an den Hauptmärkten, an denen die aufgeführten Fonds investiert waren (31. Dezember 2022: 75 Bp.).

Bei einem angenommenen Anstieg der Zinsen um 31. Dezember 2023 um 75 Bp. (31. Dezember 2022: 75 Bp.) bei ansonsten konstanten Variablen hätte sich der Gesamtertrag der Fonds umgehend wie nachfolgend aufgeführt verändert. Ein Rückgang um 75 Bp. (31. Dezember 2022: 75 Bp.) hätte analoge, aber entgegengesetzte Auswirkungen auf die Gesamterträge der Fonds).

Fonds	Funktionale Währung	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2023	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2022
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	2,310	2,730
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	4,553	4,598
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	3,683	3,893
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	2,363	2,918
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	3,375	3,525
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	4,523	4,425
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	EUR	2,550	k. A.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Fonds	Funktionale Währung	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung
		2023	2022
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	5,085	4,540
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	1,395	1,598
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	0,251	0,364
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	USD	3,675	k. A.
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	3,173	3,203
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	EUR	3,023	3,293

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2023 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		822.353	14.825.734	–	–	(14.003.381)
Brasilianischer Real		(74.852)	2.528.936	–	–	(2.603.788)
Kanadischer Dollar		(3.222.079)	249.452	(1.833.853)	–	(1.637.678)
Chilenischer Peso		211.579	389.655	–	–	(178.076)
Chinesischer Yuan		3.363	659.437	–	–	(656.074)
Kolumbianischer Peso		(313.091)	1.530.879	–	–	(1.843.970)
Tschechische Krone		8.656	482.655	–	–	(473.999)
Hongkong-Dollar		(482.512)	40	–	–	(482.552)
Ungarischer Forint		44.241	722.046	–	–	(677.805)
Indische Rupie		436.257	–	–	–	436.257
Indonesische Rupiah		8.031	704.164	–	–	(696.133)
Japanischer Yen		7.732.604	11.409.975	(1.545.306)	781.767	(2.913.832)
Koreanischer Won		564.084	7.729.501	–	–	(7.165.417)
Malaysischer Ringgit		(790)	–	–	–	(790)
Mexikanischer Peso		54.982	4.719.759	–	–	(4.664.777)
Neuseeländischer Dollar		107.746	14.433.890	–	–	(14.326.144)
Norwegische Krone		(197.536)	19	–	–	(197.555)
Polnischer Zloty		1.399	507.699	–	–	(506.300)
Rumänischer Leu		334	497.238	–	–	(496.904)
Russischer Rubel		208.906	208.906	–	–	–
Singapur-Dollar		243	243	–	–	–
Südafrikanischer Rand		(7.658)	1.420.410	–	–	(1.428.068)
Pfund Sterling		(1.094.320)	24.507.871	(272.058)	125.079	(25.455.212)
Schwedische Krone		1.317.268	1.922.294	–	–	(605.026)
Schweizer Franken		(766.892)	561	–	–	(767.453)
Taiwan-Dollar		(459.283)	–	–	–	(459.283)
Thailändischer Baht		11.575	374.114	–	–	(362.539)
Türkische Lira		41.974	544.104	–	–	(502.130)
US-Dollar		(7.786.133)	53.830.249	(4.803.909)	20.106.311	(76.918.784)
		(2.829.551)	144.199.831	(8.455.126)	21.013.157	(159.587.413)
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		(5.422)	459.615	(11.876)	–	(453.161)
US-Dollar		(28.237)	7.278.086	(226.461)	1.213.024	(8.292.886)
		(33.659)	7.737.701	(238.337)	1.213.024	(8.746.047)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Hongkong-Dollar		25.910	69.067	(43.157)	–	–
Japanischer Yen		107.076	547.677	(440.601)	–	–
US-Dollar		1.198.632	6.241.343	(5.042.711)	–	–
		1.331.618	6.858.087	(5.526.469)	–	–
BNY Mellon Asian Income Fund						
		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		3.515.761	–	–	3.515.761	–
Hongkong-Dollar		4.655.493	34.240	–	4.621.253	–
Indische Rupie		1.772.346	–	–	1.772.346	–
Indonesische Rupiah		2.560.373	–	–	2.560.373	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Asian Income Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
	Koreanischer Won	3.852.348	–	–	3.852.348	–
	Neuseeländischer Dollar	963.353	–	–	963.353	–
	Singapur-Dollar	4.927.837	–	–	4.927.837	–
	Pfund Sterling	950.786	8.994	–	941.792	–
	Taiwan-Dollar	4.412.739	–	–	4.412.739	–
	Thailändischer Baht	368.509	–	–	368.509	–
		27.979.545	43.234	–	27.936.311	–

BNY Mellon Asian Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.504.609	–	–	2.504.609	–
Chinesischer Yuan	4.394.931	–	–	4.394.931	–
Euro	1.792.129	37.311	–	1.754.818	–
Hongkong-Dollar	4.935.318	–	–	4.935.318	–
Indische Rupie	11.839.908	34.975	–	11.804.933	–
Indonesische Rupiah	1.994.485	–	–	1.994.485	–
Koreanischer Won	1.740.591	–	–	1.740.591	–
Philippinischer Peso	11	–	–	11	–
Pfund Sterling	360.000	–	–	360.000	–
Taiwan-Dollar	4.700.370	13.822	–	4.686.548	–
	34.262.352	86.108	–	34.176.244	–

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.597	3.597	–	–	–
Kanadischer Dollar	868	868	–	–	–
Euro	9.433.192	1	–	9.433.191	–
Hongkong-Dollar	509	509	–	–	–
Japanischer Yen	2.944.588	–	–	2.944.588	–
Koreanischer Won	713.861	79.618	–	634.243	–
Singapur-Dollar	746.676	–	–	746.676	–
Pfund Sterling	6.491	6.491	–	–	–
Schweizer Franken	773.622	1.189	–	772.433	–
	14.623.404	92.273	–	14.531.131	–

BNY Mellon Brazil Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	33.716.539	241.135	–	33.475.404	–
Euro	27.658	27.658	–	–	–
Pfund Sterling	20.484	20.484	–	–	–
	33.764.681	289.277	–	33.475.404	–

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.072.936	48.341	–	–	1.024.595
Brasilianischer Real	720.932	–	(14.698)	–	735.630
Kanadischer Dollar	1.880.029	17.312	(101.578)	–	1.964.295
Chilenischer Peso	471.794	–	–	–	471.794
Tschechische Krone	(289.891)	159	–	–	(290.050)
Euro	975.681	197.455	(218.467)	–	996.693
Hongkong-Dollar	1.281	1.281	–	–	–
Ungarischer Forint	2.092.877	31	–	–	2.092.846

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Indische Rupie		2.023.494	–	–	–	2.023.494
Indonesische Rupiah		(207.181)	–	–	–	(207.181)
Israelischer Schekel		(2.436.358)	–	–	–	(2.436.358)
Japanischer Yen		(773.345)	135.780	–	–	(909.125)
Koreanischer Won		(1.737.304)	45.570	–	–	(1.782.874)
Malaysischer Ringgit		(2.347.008)	–	–	–	(2.347.008)
Mexikanischer Peso		2.331.436	–	–	–	2.331.436
Neuseeländischer Dollar		1.138.096	–	–	–	1.138.096
Norwegische Krone		443.690	–	–	–	443.690
Philippinischer Peso		(1.313.113)	–	–	–	(1.313.113)
Polnischer Zloty		(76.162)	–	–	–	(76.162)
Singapur-Dollar		(8.810)	–	(8.810)	–	–
Südafrikanischer Rand		(171.562)	–	(8.682)	–	(162.880)
Pfund Sterling		1.676.093	26.288	(7.880)	–	1.657.685
Schwedische Krone		138.088	–	(1.148)	–	139.236
Schweizer Franken		(599.331)	–	–	–	(599.331)
		5.006.362	472.217	(361.263)	–	4.895.408

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	43.679	43.679	–	–	–
Pfund Sterling	27.840	27.840	–	–	–
	71.519	71.519	–	–	–

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(464.448)	44.298.934	–	–	(44.763.382)
Pfund Sterling	(69.781)	5.025.303	–	–	(5.095.084)
	(534.229)	49.324.237	–	–	(49.858.466)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	5.416	5.416	–	–	–
Kanadischer Dollar	(18.484)	2.336.293	(32)	–	(2.354.745)
Euro	(268.254)	17.536.115	(11.343)	–	(17.793.026)
Japanischer Yen	3.376	3.376	–	–	–
Pfund Sterling	(49.783)	3.702.207	(18.314)	–	(3.733.676)
	(327.729)	23.583.407	(29.689)	–	(23.881.447)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	107	107	–	–	–
	107	107	–	–	–

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	78	78	–	–	–
	78	78	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		482.237	31.499.938	(341.085)	–	(30.676.616)
Hongkong-Dollar		107	107	–	–	–
Pfund Sterling		1.041	1.041	–	–	–
		483.385	31.501.086	(341.085)	–	(30.676.616)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		(85.487)	1.794.346	(40.407)	–	(1.839.426)
Pfund Sterling		838	838	–	–	–
		(84.649)	1.795.184	(40.407)	–	(1.839.426)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real		2.760.636	2.997.340	–	–	(236.704)
Chilenischer Peso		825.319	838.897	–	–	(13.578)
Chinesischer Yuan		2.837.165	1.422.150	–	–	1.415.015
Kolumbianischer Peso		924.723	2.816.784	–	–	(1.892.061)
Tschechische Krone		1.781.564	1.334.797	–	–	446.767
Dominikanischer Peso		149.016	149.016	–	–	–
Euro		576.657	978	–	–	575.679
Hongkong-Dollar		(613.603)	–	–	–	(613.603)
Ungarischer Forint		897.002	969.532	–	–	(72.530)
Indische Rupie		567.895	–	–	–	567.895
Indonesische Rupiah		2.767.020	2.780.824	–	–	(13.804)
Koreanischer Won		568.991	356.886	–	–	212.105
Malaysischer Ringgit		2.855.687	1.724.864	–	–	1.130.823
Mexikanischer Peso		2.905.963	3.766.676	–	–	(860.713)
Peruanischer neuer Sol		655.713	627.087	–	–	28.626
Philippinischer Peso		22.216	–	–	–	22.216
Polnischer Zloty		2.148.644	1.223.526	–	–	925.118
Rumänischer Leu		1.149.187	871.655	–	–	277.532
Russischer Rubel		259.445	259.445	–	–	–
Südafrikanischer Rand		2.369.275	3.056.519	–	–	(687.244)
Pfund Sterling		2.088	2.088	–	–	–
Schweizer Franken		40	40	–	–	–
Taiwan-Dollar		(596.552)	–	–	–	(596.552)
Thailändischer Baht		2.834.640	1.896.633	–	–	938.007
Türkische Lira		288.983	763.488	–	–	(474.505)
Uruguayischer Peso		36.968	36.968	–	–	–
		27.553.292	26.474.803	–	–	1.078.489

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real		1.084.368	1.090.719	–	–	(6.351)
Chilenischer Peso		435.322	586.828	–	–	(151.506)
Chinesischer Yuan		1.100.513	255.286	–	–	845.227
Kolumbianischer Peso		170.104	1.489.728	–	–	(1.319.624)
Tschechische Krone		696.499	543.308	–	–	153.191
Euro		411.188	560.684	(12.012)	–	(137.484)
Hongkong-Dollar		(455.898)	–	–	–	(455.898)
Ungarischer Forint		346.552	268.216	–	–	78.336
Indische Rupie		453.909	–	–	–	453.909
Indonesische Rupiah		1.077.330	886.462	–	–	190.868

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Koreanischer Won		449.276	229.727	–	–	219.549
Malaysischer Ringgit		1.107.595	768.546	–	–	339.049
Mexikanischer Peso		1.167.978	1.957.352	–	–	(789.374)
Peruanischer neuer Sol		254.191	192.086	–	–	62.105
Philippinischer Peso		9.663	–	–	–	9.663
Polnischer Zloty		837.149	279.895	–	–	557.254
Rumänischer Leu		453.521	285.051	–	–	168.470
Russischer Rubel		188.894	188.894	–	–	–
Südafrikanischer Rand		937.504	1.225.964	–	–	(288.460)
Pfund Sterling		952	952	–	–	–
Taiwan-Dollar		(476.635)	–	–	–	(476.635)
Thailändischer Baht		1.117.973	881.985	–	–	235.988
Türkische Lira		125.353	493.964	–	–	(368.611)
Uruguayischer Peso		43.744	43.744	–	–	–
		11.289.737	11.982.083	(12.012)	–	(680.334)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	933.946	1.650.674	–	–	(716.728)
Chilenischer Peso	484.630	760.780	–	–	(276.150)
Chinesischer Yuan	987.279	167.733	–	–	819.546
Kolumbianischer Peso	(17.684)	1.773.894	–	–	(1.791.578)
Tschechische Krone	625.004	706.084	–	–	(81.080)
Euro	576.845	1.258.073	(21.687)	–	(659.541)
Ungarischer Forint	302.052	243.290	–	–	58.762
Indonesische Rupiah	981.318	433.938	–	–	547.380
Israelischer Schekel	215	215	–	–	–
Koreanischer Won	610.276	301.034	–	–	309.242
Malaysischer Ringgit	992.863	463.284	–	–	529.579
Mexikanischer Peso	1.045.244	2.606.667	–	–	(1.561.423)
Peruanischer neuer Sol	221.018	146.695	–	–	74.323
Philippinischer Peso	9.573	–	–	–	9.573
Polnischer Zloty	754.750	236	–	–	754.514
Rumänischer Leu	403.402	189.047	–	–	214.355
Russischer Rubel	350.476	350.476	–	–	–
Südafrikanischer Rand	829.477	1.181.949	–	–	(352.472)
Pfund Sterling	324	324	–	–	–
Thailändischer Baht	976.648	632.853	–	–	343.795
Türkische Lira	122.839	639.128	–	–	(516.289)
	11.029.148	13.345.027	(21.687)	–	(2.294.192)

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	144.986	144.986	–	–	–
Kanadischer Dollar	352.133	–	(638.841)	–	990.974
Chinesischer Yuan	67.416	21	–	–	67.395
Tschechische Krone	(8.094)	41	–	–	(8.135)
Japanischer Yen	720.024	3	(4.260)	–	724.281
Mexikanischer Peso	38	38	–	–	–
Norwegische Krone	39	39	–	–	–
Polnischer Zloty	24.647	24.647	–	–	–
Südafrikanischer Rand	1.067	1.067	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		(465.230)	35.077	–	–	(500.307)
Schwedische Krone		608.571	711.944	–	–	(103.373)
Schweizer Franken		512	512	–	–	–
US-Dollar		(15.098)	1.209.307	(363.294)	2.500.760	(3.361.871)
		1.431.011	2.127.682	(1.006.395)	2.500.760	(2.191.036)

BNY Mellon European Credit Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling	103	103	–	–	–
US-Dollar	22.798	92.318	(25.064)	1.349.380	(1.393.836)
	22.901	92.421	(25.064)	1.349.380	(1.393.836)

BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Norwegische Krone	33.797	1.575.450	–	–	(1.541.653)
Pfund Sterling	68.712	3.426.928	(50.886)	–	(3.307.330)
Schweizer Franken	1.043	1.043	–	–	–
US-Dollar	31.951	2.614.376	(15.442)	–	(2.566.983)
	135.503	7.617.797	(66.328)	–	(7.415.966)

BNY Mellon Global Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	22.678.102	29.236.394	(175.607)	–	(6.382.685)
Kanadischer Dollar	1.095.226	20.563.977	(581.787)	–	(18.886.964)
Kolumbianischer Peso	3.568.365	2.421.965	–	–	1.146.400
Dänische Krone	1.139.348	24.806.549	–	–	(23.667.201)
Euro	102.929.273	86.900.653	(786.481)	–	16.815.101
Indische Rupie	(121.442)	6.732.634	–	–	(6.854.076)
Indonesische Rupiah	4.540.133	14.370.267	–	–	(9.830.134)
Japanischer Yen	96.475.395	23.639.299	(39.873)	–	72.875.969
Koreanischer Won	4.677.348	–	–	–	4.677.348
Malaysischer Ringgit	226.153	7.181.856	–	–	(6.955.703)
Mexikanischer Peso	7.433.279	6.937.387	–	–	495.892
Neuseeländischer Dollar	(4.914.672)	58.529.477	–	–	(63.444.149)
Norwegische Krone	(81.076)	9.808.927	–	–	(9.890.003)
Peruanischer neuer Sol	4.632.956	4.852.875	–	–	(219.919)
Pfund Sterling	13.988.354	19.579.315	–	–	(5.590.961)
Schwedische Krone	718.241	10.498.039	–	–	(9.779.798)
Uruguayischer Peso	3.467.558	3.467.558	–	–	–
	262.452.541	329.527.172	(1.583.748)	–	(65.490.883)

BNY Mellon Global Credit Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	333.608	4.183.291	–	–	(3.849.683)
Brasilianischer Real	(109.796)	126.091	–	–	(235.887)
Kanadischer Dollar	981.661	77.309	–	–	904.352
Chinesischer Yuan	267.293	–	–	–	267.293
Euro	522.138	404.808.555	(9.670.626)	27.097.655	(421.713.446)
Ungarischer Forint	2	2	–	–	–
Japanischer Yen	13.338.816	392.666	(33.084)	–	12.979.234
Mexikanischer Peso	8	8	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	492	492	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Credit Fund Forts.		USD	USD	USD	USD	USD
	Norwegische Krone	38	38	–	–	–
	Polnischer Zloty	95	95	–	–	–
	Südafrikanischer Rand	51	51	–	–	–
	Pfund Sterling	259.632	43.226.317	(31.208)	–	(42.935.477)
	Schwedische Krone	338.331	338.331	–	–	–
	Schweizer Franken	(400.983)	898.439	–	–	(1.299.422)
	Taiwan-Dollar	(1.942.214)	–	–	–	(1.942.214)
		13.589.172	454.051.685	(9.734.918)	27.097.655	(457.825.250)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.743.851	5.577.694	(66.301)	–	(1.767.542)
Brasilianischer Real	4.591.393	4.591.393	–	–	–
Kanadischer Dollar	(247.962)	4.739.258	(108.553)	–	(4.878.667)
Kolumbianischer Peso	1.838.285	2.552.755	–	–	(714.470)
Euro	(5.368.647)	21.005.000	(800.684)	1.944.120	(27.517.083)
Indische Rupie	(25.930)	1.602.257	–	–	(1.628.187)
Indonesische Rupiah	1.665.168	4.732.624	–	–	(3.067.456)
Japanischer Yen	4.723.114	5.057.932	(229.278)	–	(105.540)
Koreanischer Won	1.887.196	–	–	–	1.887.196
Malaysischer Ringgit	(42.528)	2.679.521	–	–	(2.722.049)
Mexikanischer Peso	3.596.248	7.363.315	–	–	(3.767.067)
Neuseeländischer Dollar	(4.591.063)	13.874.170	–	–	(18.465.233)
Norwegische Krone	15.722	2.840.505	–	–	(2.824.783)
Peruanischer neuer Sol	(20.374)	2.207.780	–	–	(2.228.154)
Pfund Sterling	(4.186.188)	16.488.028	(150.598)	5.126.696	(25.650.314)
Schwedische Krone	(1.951.340)	–	–	–	(1.951.340)
Schweizer Franken	1.901.930	–	–	1.901.930	–
Uruguayischer Peso	1.241.312	1.241.312	–	–	–
	8.770.187	96.553.544	(1.355.414)	8.972.746	(95.400.689)

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	1.368.354	8.744	–	1.359.610	–
Chinesischer Yuan	1.941.203	–	–	1.941.203	–
Euro	846.372	–	–	846.372	–
Hongkong-Dollar	2.445.243	–	–	2.445.243	–
Indische Rupie	5.890.530	114.191	–	5.776.339	–
Indonesische Rupiah	979.570	–	–	979.570	–
Japanischer Yen	250.405	–	–	250.405	–
Koreanischer Won	915.706	–	–	915.706	–
Malaysischer Ringgit	371	371	–	–	–
Mexikanischer Peso	788.534	–	–	788.534	–
Polnischer Zloty	249.376	–	–	249.376	–
Südafrikanischer Rand	344.795	–	–	344.795	–
Pfund Sterling	227.960	–	–	227.960	–
Taiwan-Dollar	2.083.807	6.911	–	2.076.896	–
	18.332.226	130.217	–	18.202.009	–

BNY Mellon Global Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.541.325	–	–	2.541.325	–
Brasilianischer Real	8.182.955	111.618	–	8.071.337	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		80.652.835	–	–	80.652.835	–
Hongkong-Dollar		6.671.934	86.265	–	6.585.669	–
Indonesische Rupiah		8.613.537	–	–	8.613.537	–
Koreanischer Won		12.362.031	–	–	12.362.031	–
Pfund Sterling		23.626.044	90.776	–	23.535.268	–
Schweizer Franken		29.763.925	–	–	29.763.925	–
Taiwan-Dollar		13.545.120	–	–	13.545.120	–
		185.959.706	288.659	–	185.671.047	–

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(150.078)	20.173.928	–	–	(20.324.006)
Pfund Sterling	217.748	4.423.851	–	–	(4.206.103)
	67.670	24.597.779	–	–	(24.530.109)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar	1.316.147	20.165	–	1.295.982	–
Euro	30.209.683	–	–	30.209.683	–
Hongkong-Dollar	3.821.708	–	–	3.821.708	–
Israelischer Schekel	1.369	1.369	–	–	–
Norwegische Krone	4.279	4.279	–	–	–
Singapur-Dollar	1	1	–	–	–
Pfund Sterling	4.849.340	32	–	4.849.308	–
	40.202.527	25.846	–	40.176.681	–

BNY Mellon Global Leaders Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.832.643	–	–	2.832.643	–
Dänische Krone	3.260.752	–	–	3.260.752	–
Euro	12.408.200	–	–	12.408.200	–
Hongkong-Dollar	2.380.032	–	–	2.380.032	–
Japanischer Yen	2.508.607	–	–	2.508.607	–
Schweizer Franken	2.238.223	–	–	2.238.223	–
	25.628.457	–	–	25.628.457	–

BNY Mellon Global Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	438.215	–	–	438.215	–
Euro	4.913.425	–	–	4.913.425	–
Hongkong-Dollar	834.859	–	–	834.859	–
Indische Rupie	674.846	676	–	674.170	–
Japanischer Yen	1.618.112	–	–	1.618.112	–
Koreanischer Won	460.798	–	–	460.798	–
Malaysischer Ringgit	1	1	–	–	–
Pfund Sterling	2.751.578	–	–	2.751.578	–
Schweizer Franken	451.333	–	–	451.333	–
	12.143.167	677	–	12.142.490	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	EUR		EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(93.966)	28.722.916	–	–	(28.816.882)
Brasilianischer Real		41.884.428	35.697.613	–	6.186.815	–
Hongkong-Dollar		20.214.368	1.354.990	–	8.208.737	10.650.641
Indische Rupie		12.592.558	94.937	–	12.497.621	–
Indonesische Rupiah		8.193.482	8.165.695	–	8.115.198	(8.087.411)
Japanischer Yen		33.434.591	2.029.688	–	5.961.214	25.443.689
Koreanischer Won		8.891.104	–	–	8.891.104	–
Mexikanischer Peso		56.779.047	56.779.047	–	–	–
Pfund Sterling		21.576.194	20.277.775	(91.926)	164.610.652	(163.220.307)
Schwedische Krone		(11)	–	(11)	–	–
Schweizer Franken		2.227.472	–	–	28.291.409	(26.063.937)
US-Dollar		193.672.090	118.500.948	(14.530.907)	400.681.111	(310.979.062)
		399.371.357	271.623.609	(14.622.844)	643.443.861	(501.073.269)

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Australischer Dollar	27.908	27.908	–	–	–
Brasilianischer Real	1.333.918	1.132.361	–	201.557	–
Euro	(963.435)	464.844	(11.293)	3.024.225	(4.441.211)
Hongkong-Dollar	373.805	47.830	–	268.037	57.938
Ungarischer Forint	2.832	–	–	–	2.832
Indische Rupie	402.306	1.996	–	400.310	–
Indonesische Rupiah	242.279	263.840	–	243.734	(265.295)
Japanischer Yen	1.082.583	41.434	–	192.990	848.159
Koreanischer Won	285.950	–	–	285.950	–
Mexikanischer Peso	1.826.944	1.826.944	–	–	–
Schweizer Franken	(87.864)	–	–	914.496	(1.002.360)
US-Dollar	5.972.883	3.487.450	(467.231)	12.917.645	(9.964.981)
	10.500.109	7.294.607	(478.524)	18.448.944	(14.764.918)

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	145.889	145.889	–	–	–
Brasilianischer Real	7.656.942	6.538.482	–	1.118.460	–
Euro	(12.044.377)	4.304.728	(65.341)	18.297.784	(34.581.548)
Hongkong-Dollar	2.258.655	315.275	–	1.484.969	458.411
Indische Rupie	2.236.379	6.244	–	2.230.135	–
Indonesische Rupiah	1.514.140	1.648.332	–	1.364.114	(1.498.306)
Japanischer Yen	6.280.390	360.683	–	1.087.926	4.831.781
Koreanischer Won	1.612.918	–	–	1.612.918	–
Mexikanischer Peso	10.353.675	10.353.675	–	–	–
Pfund Sterling	(3.186.840)	4.513.341	(17.435)	30.564.669	(38.247.415)
Schweizer Franken	(626.903)	–	–	5.112.556	(5.739.459)
	16.200.868	28.186.649	(82.776)	62.873.531	(74.776.536)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	623.194	8.974.430	–	–	(8.351.236)
Euro	(5.433.568)	450.551.673	–	–	(455.985.241)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		(1.038.576)	84.252.949	–	–	(85.291.525)
Schwedische Krone		86	86	–	–	–
Schweizer Franken		522	522	–	–	–
		(5.848.342)	543.779.660	–	–	(549.628.002)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(72.239)	407.092	–	–	(479.331)
Brasilianischer Real	171.154	171.154	–	–	–
Kolumbianischer Peso	150.318	150.318	–	–	–
Dänische Krone	221.207	–	–	221.207	–
Euro	2.071.813	600.928	–	1.977.836	(506.951)
Hongkong-Dollar	535.688	–	–	535.688	–
Japanischer Yen	1.395.478	6.904	–	1.388.574	–
Koreanischer Won	271.790	–	–	271.790	–
Mexikanischer Peso	328.374	328.374	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	17.797	276.471	–	–	(258.674)
Pfund Sterling	3.310.464	7.623	–	4.272.817	(969.976)
Schweizer Franken	1.126.726	–	–	1.126.726	–
	9.528.570	1.948.864	–	9.794.638	(2.214.932)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Euro	106.521.342	106.521.342	–	–	–
Pfund Sterling	68.137.831	68.137.831	–	–	–
US-Dollar	92.940.276	92.940.276	–	–	–
	267.599.449	267.599.449	–	–	–

BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	1.035.038	–	–	1.035.038	–
Pfund Sterling	3.976.283	–	–	3.976.283	–
Schwedische Krone	476.550	–	–	476.550	–
Schweizer Franken	4.152.918	–	–	4.152.918	–
	9.640.789	–	–	9.640.789	–

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	30.153.934	1	–	30.153.933	–
Kanadischer Dollar	65.314.766	111.645	–	65.203.121	–
Dänische Krone	52.905.114	–	–	52.905.114	–
Hongkong-Dollar	24.419.577	–	–	24.419.577	–
Japanischer Yen	88.090.177	–	–	88.090.177	–
Pfund Sterling	81.764.690	–	–	81.764.690	–
Schweizer Franken	65.478.156	–	–	65.478.156	–
US-Dollar	881.096.503	17.530	–	881.078.973	–
	1.289.222.917	129.176	–	1.289.093.741	–

BNY Mellon Mobility Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2	2	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Chinesischer Yuan		787	787	–	–	–
Euro		76.216.382	1	–	76.216.381	–
Hongkong-Dollar		14.578.412	–	–	14.578.412	–
Japanischer Yen		40.300.141	–	–	40.300.141	–
Koreanischer Won		6.759.099	42.000	–	6.717.099	–
Singapur-Dollar		914	914	–	–	–
Pfund Sterling		12.636.177	–	–	12.636.177	–
Schwedische Krone		7.306.729	99	–	7.306.630	–
Schweizer Franken		7.675.815	1.189	–	7.674.626	–
Taiwan-Dollar		4.970.639	215.210	–	4.755.429	–
		170.445.097	260.202	–	170.184.895	–

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	447.318	134	–	447.184	–
Norwegische Krone	10	10	–	–	–
Pfund Sterling	2	2	–	–	–
Schwedische Krone	634.889	6.310	–	628.579	–
Schweizer Franken	4.373	4.373	–	–	–
US-Dollar	646.698	14.302	–	632.963	(567)
	1.733.290	25.131	–	1.708.726	(567)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	7.372.320	10.610.603	(128.818)	–	(3.109.465)
Brasilianischer Real	8.958.473	8.958.473	–	–	–
Kanadischer Dollar	(110.517)	8.112.509	(207.866)	–	(8.015.160)
Kolumbianischer Peso	3.219.884	8.138.146	–	–	(4.918.262)
Indische Rupie	(20.332)	4.048.374	–	–	(4.068.706)
Indonesische Rupiah	2.835.267	12.266.124	–	–	(9.430.857)
Japanischer Yen	9.013.661	9.318.615	(374.111)	–	69.157
Koreanischer Won	3.306.215	–	–	–	3.306.215
Malaysischer Ringgit	(49.895)	3.321.255	–	–	(3.371.150)
Mexikanischer Peso	6.385.874	14.118.955	–	–	(7.733.081)
Neuseeländischer Dollar	(8.526.557)	22.790.276	–	–	(31.316.833)
Norwegische Krone	3.980	5.329.205	–	–	(5.325.225)
Peruanischer neuer Sol	40.727	5.572.603	–	–	(5.531.876)
Pfund Sterling	(7.971.516)	41.376.395	(315.131)	–	(49.032.780)
Schwedische Krone	(3.419.636)	–	–	–	(3.419.636)
Uruguayischer Peso	2.383.817	2.383.817	–	–	–
US-Dollar	(22.246.927)	126.191.920	(1.272.691)	–	(147.166.156)
	1.174.838	282.537.270	(2.298.617)	–	(279.063.815)

BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	864.302	2.483	–	861.819	–
Chinesischer Yuan	1.783.249	–	–	1.783.249	–
Euro	954.495	611	–	953.884	–
Hongkong-Dollar	615.111	988	–	614.123	–
Indische Rupie	3.366.206	6.740	–	3.359.466	–
Indonesische Rupiah	483.988	–	–	483.988	–
Koreanischer Won	185.345	–	–	185.345	–
Mexikanischer Peso	259.552	–	–	259.552	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Südafrikanischer Rand		542.479	–	–	542.479	–
Pfund Sterling		88.061	–	–	88.061	–
Taiwan-Dollar		1.243.653	6.911	–	1.236.742	–
		10.386.441	17.733	–	10.368.708	–

BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	11.945.535	–	–	11.945.535	–
Euro	79.888.672	–	–	79.888.672	–
Hongkong-Dollar	13.773.452	–	–	13.773.452	–
Indische Rupie	8.996.136	201	–	8.995.935	–
Indonesische Rupiah	8.642.137	–	–	8.642.137	–
Japanischer Yen	8.773.598	22.892	–	8.750.706	–
Pfund Sterling	25.584.366	39.583	–	25.544.783	–
Schweizer Franken	8.109.636	–	–	8.109.636	–
Taiwan-Dollar	7.769.944	–	–	7.769.944	–
	173.483.476	62.676	–	173.420.800	–

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	30.168	–	–	–	30.168
Brasilianischer Real	588.618	500.513	–	88.105	–
Dänische Krone	28.272	834	–	27.438	–
Hongkong-Dollar	360.728	23.861	–	119.583	217.284
Indische Rupie	178.515	103	–	178.412	–
Indonesische Rupiah	102.818	115.934	–	135.885	(149.001)
Japanischer Yen	461.969	11.259	–	85.404	365.306
Koreanischer Won	123.839	–	–	123.839	–
Mexikanischer Peso	796.412	796.412	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	12.247	377	–	–	11.870
Norwegische Krone	43.707	1.311	–	42.396	–
Pfund Sterling	525.977	473.541	(1.311)	2.473.592	(2.419.845)
Schweizer Franken	43.689	–	–	437.905	(394.216)
Taiwan-Dollar	50.153	–	–	50.153	–
US-Dollar	2.748.924	1.717.923	(201.161)	5.724.384	(4.492.222)
	6.096.036	3.642.068	(202.472)	9.487.096	(6.830.656)

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(72.982)	5.933.458	–	–	(6.006.440)
Kanadischer Dollar	281.588	113	–	–	281.475
Chinesischer Yuan	2.849	2.849	–	–	–
Tschechische Krone	6.147	11	–	–	6.136
Euro	(1.397.150)	41.678.913	(962.443)	5.715.419	(47.829.039)
Ungarischer Forint	804	–	–	–	804
Japanischer Yen	1.832.196	3.548	(2.143)	–	1.830.791
Koreanischer Won	4.604	4.604	–	–	–
Mexikanischer Peso	8.728	20	–	–	8.708
Neuseeländischer Dollar	3.094	3.094	–	–	–
Norwegische Krone	78	78	–	–	–
Polnischer Zloty	3.126	3.126	–	–	–
Singapur-Dollar	519	519	–	–	–
Südafrikanischer Rand	26.304	16	–	–	26.288

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2023	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		(206.898)	11.013.432	(399)	–	(11.219.931)
Schwedische Krone		433	933	–	–	(500)
Schweizer Franken		(133.388)	764	–	–	(134.152)
		360.052	58.645.478	(964.985)	5.715.419	(63.035.860)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		57	57	–	–	–
Pfund Sterling		887	887	–	–	–
		944	944	–	–	–
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		192	192	–	–	–
Hongkong-Dollar		6.403	6.403	–	–	–
Pfund Sterling		9.041	9.041	–	–	–
		15.636	15.636	–	–	–
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		426.113	17.694.923	(183.190)	–	(17.085.620)
Pfund Sterling		25.580	896.402	–	–	(870.822)
		451.693	18.591.325	(183.190)	–	(17.956.442)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		411.207	1.570.278	–	–	(1.159.071)
US-Dollar		(1.084.783)	6.798.274	(217.507)	–	(7.665.550)
		(673.576)	8.368.552	(217.507)	–	(8.824.621)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		9.761	103.957	–	–	(94.196)
US-Dollar		(110.581)	880.544	(22.653)	–	(968.472)
		(100.820)	984.501	(22.653)	–	(1.062.668)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2022 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(392.758)	18.125.767	–	–	(18.518.525)
Brasilianischer Real		(57.642)	4.256.539	–	–	(4.314.181)
Kanadischer Dollar		(1.190.972)	365.624	–	–	(1.556.596)
Chilenischer Peso		(9.396)	–	–	–	(9.396)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Chinesischer Yuan		(16.183)	1.433.598	–	–	(1.449.781)
Kolumbianischer Peso		516.908	1.182.543	–	–	(665.635)
Tschechische Krone		827.491	25	–	–	827.466
Ägyptisches Pfund		22.658	22.658	–	–	–
Hongkong-Dollar		42	42	–	–	–
Ungarischer Forint		(28.097)	713.401	–	–	(741.498)
Indische Rupie		86.213	–	–	–	86.213
Indonesische Rupiah		70.982	483.078	–	–	(412.096)
Japanischer Yen		(675.638)	5.709.102	(508.227)	–	(5.876.513)
Koreanischer Won		370.169	7.387.300	–	–	(7.017.131)
Mexikanischer Peso		(361.232)	4.651.952	–	–	(5.013.184)
Neuseeländischer Dollar		(170.758)	11.547.574	–	–	(11.718.332)
Norwegische Krone		(142.201)	13.445	–	–	(155.646)
Peruanischer neuer Sol		(396.637)	–	–	–	(396.637)
Philippinischer Peso		(1.002.602)	–	–	–	(1.002.602)
Polnischer Zloty		484.507	205	–	–	484.302
Rumänischer Leu		(1.023.338)	470.376	–	–	(1.493.714)
Russischer Rubel		189.795	189.795	–	–	–
Südafrikanischer Rand		465.360	2.263.685	–	–	(1.798.325)
Pfund Sterling		546.268	27.002.632	–	–	(26.456.364)
Schwedische Krone		1.206.528	559.298	–	–	647.230
Schweizer Franken		2.700.205	60.426	–	–	2.639.779
Thailändischer Baht		1.014.168	128	–	–	1.014.040
Türkische Lira		(372.338)	–	–	–	(372.338)
US-Dollar		(2.193.520)	20.654.557	(3.357.451)	30.778.339	(50.268.965)
		467.982	107.093.750	(3.865.678)	30.778.339	(133.538.429)

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Dänische Krone	193.830	321.579	(56.166)	–	(71.583)
Euro	(1.825.946)	5.720.529	(3.292.628)	–	(4.253.847)
Norwegische Krone	183.643	218.852	(35.209)	–	–
Schwedische Krone	(17.305)	150.236	(167.541)	–	–
Schweizer Franken	588.179	500.883	(466.759)	689.199	(135.144)
US-Dollar	2.187.206	295.922	(203.227)	2.073.750	20.761
	1.309.607	7.208.001	(4.221.530)	2.762.949	(4.439.813)

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Hongkong-Dollar	207.682	498.274	(290.592)	–	–
Japanischer Yen	(91.125)	233.327	(324.452)	–	–
Singapur-Dollar	(28.006)	7.062	(35.068)	–	–
Pfund Sterling	5.675	5.675	–	–	–
Schweizer Franken	126.610	694.517	(567.907)	–	–
US-Dollar	(335.488)	6.797.165	(7.325.993)	775.405	(582.065)
	(114.652)	8.236.020	(8.544.012)	775.405	(582.065)

BNY Mellon Asian Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.107.711	–	–	2.107.711	–
Chinesischer Yuan	261.198	–	–	261.198	–
Euro	5.439	5.439	–	–	–
Hongkong-Dollar	3.738.534	21.548	–	3.716.986	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Asian Income Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Indische Rupie		167.440	–	–	167.440	–
Indonesische Rupiah		1.082.217	–	–	1.082.217	–
Koreanischer Won		2.252.220	–	–	2.252.220	–
Neuseeländischer Dollar		644.844	–	–	644.844	–
Singapur-Dollar		3.623.456	–	–	3.623.456	–
Pfund Sterling		748.055	–	–	748.055	–
Taiwan-Dollar		2.105.940	–	–	2.105.940	–
Thailändischer Baht		401.069	–	–	401.069	–
		17.138.123	26.987	–	17.111.136	–

BNY Mellon Asian Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.623.255	–	–	2.623.255	–
Chinesischer Yuan	7.214.128	–	–	7.214.128	–
Euro	1.358.251	9.418	(2)	1.359.499	(10.664)
Hongkong-Dollar	9.311.492	–	–	9.311.492	–
Indische Rupie	11.642.501	14.221	–	11.628.280	–
Indonesische Rupiah	1.295.405	–	–	1.295.405	–
Koreanischer Won	2.721.737	–	–	2.721.737	–
Philippinischer Peso	8	–	–	8	–
Taiwan-Dollar	4.071.091	–	–	4.071.091	–
	40.237.868	23.639	(2)	40.224.895	(10.664)

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.416.647	3	–	1.416.644	–
Kanadischer Dollar	849	849	–	–	–
Dänische Krone	1.116.685	939	–	1.115.746	–
Euro	10.322.900	118.497	–	10.204.403	–
Hongkong-Dollar	510	510	–	–	–
Japanischer Yen	2.450.624	13.640	–	2.436.984	–
Koreanischer Won	812.773	2.352	–	810.421	–
Singapur-Dollar	895.073	66.699	–	828.374	–
Pfund Sterling	58	58	–	–	–
Schweizer Franken	1.480.670	1.043	–	1.479.627	–
	18.496.789	204.590	–	18.292.199	–

BNY Mellon Brazil Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	31.564.712	549.879	–	31.014.833	–
Euro	405.434	405.434	–	–	–
Pfund Sterling	371.192	371.192	–	–	–
	32.341.338	1.326.505	–	31.014.833	–

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	613.706	932	(138.328)	–	751.102
Brasilianischer Real	915.824	35.599	(16.735)	–	896.960
Kanadischer Dollar	2.031.289	351.010	(19.332)	–	1.699.611
Chilenischer Peso	544.617	–	–	–	544.617
Tschechische Krone	(286.517)	–	–	–	(286.517)
Euro	(1.309.244)	80.749	(744.565)	–	(645.428)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Hongkong-Dollar		3.345	3.345	–	–	–
Ungarischer Forint		2.118.891	29	–	–	2.118.862
Indische Rupie		2.033.011	–	–	–	2.033.011
Indonesische Rupiah		(205.905)	–	–	–	(205.905)
Israelischer Schekel		(1.999.267)	–	–	–	(1.999.267)
Japanischer Yen		(2.108.968)	–	(200.262)	–	(1.908.706)
Koreanischer Won		(2.125.907)	2.904	(58.274)	–	(2.070.537)
Malaysischer Ringgit		(2.133.092)	–	–	–	(2.133.092)
Mexikanischer Peso		1.848.753	–	–	–	1.848.753
Neuseeländischer Dollar		953.110	–	–	–	953.110
Norwegische Krone		522.188	–	–	–	522.188
Philippinischer Peso		(1.684.528)	–	–	–	(1.684.528)
Polnischer Zloty		1.519.970	–	–	–	1.519.970
Singapur-Dollar		(6.127)	62	(6.189)	–	–
Südafrikanischer Rand		(162.361)	13.126	–	–	(175.487)
Pfund Sterling		1.126.524	39.381	(2.849)	–	1.089.992
Schwedische Krone		(454.146)	–	(1.889)	–	(452.257)
Schweizer Franken		(1.852.918)	–	–	–	(1.852.918)
		(97.752)	527.137	(1.188.423)	–	563.534

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	42.078	42.078	–	–	–
Pfund Sterling	25.694	25.694	–	–	–
	67.772	67.772	–	–	–

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(378.778)	38.744.645	–	–	(39.123.423)
Pfund Sterling	(47.511)	4.177.779	–	–	(4.225.290)
	(426.289)	42.922.424	–	–	(43.348.713)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(5.069)	–	(5.069)	–	–
Kanadischer Dollar	(16.068)	1.598.340	–	–	(1.614.408)
Euro	(113.145)	11.357.256	–	–	(11.470.401)
Japanischer Yen	(3.825)	–	(3.825)	–	–
Pfund Sterling	(30.157)	1.841.233	–	–	(1.871.390)
	(168.264)	14.796.829	(8.894)	–	(14.956.199)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	125.455	125.455	–	–	–
Pfund Sterling	1.849	1.849	–	–	–
	127.304	127.304	–	–	–

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(203.938)	24.134.935	–	–	(24.338.873)
Hongkong-Dollar	25	25	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Russischer Rubel		126.533	126.533	–	–	–
Pfund Sterling		975	975	–	–	–
Schweizer Franken		(31)	–	(31)	–	–
		(76.436)	24.262.468	(31)	–	(24.338.873)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(79.343)	1.438.716	–	–	(1.518.059)
Pfund Sterling	357	357	–	–	–
	(78.986)	1.439.073	–	–	(1.518.059)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	2.417.173	3.604.188	–	–	(1.187.015)
Chilenischer Peso	627.810	421.059	–	–	206.751
Chinesischer Yuan	2.612.171	2.946.828	–	–	(334.657)
Kolumbianischer Peso	1.178.069	2.206.700	–	–	(1.028.631)
Tschechische Krone	1.139.594	631.165	–	–	508.429
Euro	32.405	16.331	–	–	16.074
Hongkong-Dollar	(1.218.741)	–	–	–	(1.218.741)
Ungarischer Forint	763.623	788.123	–	–	(24.500)
Indonesische Rupiah	2.458.712	2.719.745	–	–	(261.033)
Koreanischer Won	664.194	365.335	–	–	298.859
Malaysischer Ringgit	2.562.353	1.573.791	–	–	988.562
Mexikanischer Peso	2.234.188	2.221.400	–	–	12.788
Peruanischer neuer Sol	341.103	546.155	–	–	(205.052)
Philippinischer Peso	(626.859)	–	–	–	(626.859)
Polnischer Zloty	2.121.810	–	–	–	2.121.810
Rumänischer Leu	226.789	132.972	–	–	93.817
Russischer Rubel	233.657	233.657	–	–	–
Südafrikanischer Rand	2.764.857	3.912.521	–	–	(1.147.664)
Pfund Sterling	1.339	1.339	–	–	–
Schweizer Franken	36	36	–	–	–
Thailändischer Baht	3.270.493	1.334.287	–	–	1.936.206
Türkische Lira	(22.802)	–	–	–	(22.802)
Uruguayischer Peso	33.835	33.835	–	–	–
	23.815.809	23.689.467	–	–	126.342

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	1.172.652	1.991.477	–	–	(818.825)
Chilenischer Peso	283.124	198.833	–	–	84.291
Chinesischer Yuan	1.287.541	409.672	–	–	877.869
Kolumbianischer Peso	683.570	1.035.885	–	–	(352.315)
Tschechische Krone	446.168	175.621	–	–	270.547
Euro	(24.119)	1.071.075	–	–	(1.095.194)
Hongkong-Dollar	(550.358)	–	–	–	(550.358)
Ungarischer Forint	369.320	573.275	–	–	(203.955)
Indonesische Rupiah	1.257.179	1.190.414	–	–	66.765
Koreanischer Won	642.217	354.434	–	–	287.783
Malaysischer Ringgit	1.257.308	767.132	–	–	490.176
Mexikanischer Peso	1.024.759	1.371.430	–	–	(346.671)
Peruanischer neuer Sol	54.811	256.161	–	–	(201.350)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Philippinischer Peso		(599.710)	–	–	–	(599.710)
Polnischer Zloty		1.168.335	–	–	–	1.168.335
Rumänischer Leu		(196.587)	20.162	–	–	(216.749)
Russischer Rubel		182.887	182.887	–	–	–
Südafrikanischer Rand		1.449.285	2.106.978	–	–	(657.693)
Pfund Sterling		8.933	8.933	–	–	–
Thailändischer Baht		1.880.695	683.914	–	–	1.196.781
Türkische Lira		(117.050)	–	–	–	(117.050)
Uruguayischer Peso		40.438	40.438	–	–	–
		11.721.398	12.438.721	–	–	(717.323)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	1.113.575	3.495.776	–	–	(2.382.201)
Chilenischer Peso	268.985	322.816	–	–	(53.831)
Chinesischer Yuan	860.537	721.325	–	–	139.212
Kolumbianischer Peso	769.205	1.416.067	–	–	(646.862)
Tschechische Krone	35.763	24	–	–	35.739
Ägyptisches Pfund	23.212	23.212	–	–	–
Euro	(2.310)	2.747.213	–	–	(2.749.523)
Ungarischer Forint	353.751	654.226	–	–	(300.475)
Indonesische Rupiah	1.219.088	968.499	–	–	250.589
Israelischer Schekel	222	222	–	–	–
Koreanischer Won	935.895	504.591	–	–	431.304
Malaysischer Ringgit	1.221.111	472.235	–	–	748.876
Mexikanischer Peso	896.592	2.610.310	–	–	(1.713.718)
Peruanischer neuer Sol	18.968	232.009	–	–	(213.041)
Polnischer Zloty	1.259.112	32	–	–	1.259.080
Rumänischer Leu	158	158	–	–	–
Russischer Rubel	295.053	295.053	–	–	–
Südafrikanischer Rand	1.699.384	3.012.907	–	–	(1.313.523)
Pfund Sterling	342	342	–	–	–
Thailändischer Baht	2.183.212	311.478	–	–	1.871.734
Türkische Lira	6	6	–	–	–
	13.151.861	17.788.501	–	–	(4.636.640)

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	163	163	–	–	–
Chinesischer Yuan	71.245	71.245	–	–	–
Tschechische Krone	887.903	–	–	–	887.903
Mexikanischer Peso	68.885	5.150.345	–	–	(5.081.460)
Norwegische Krone	41	41	–	–	–
Pfund Sterling	(103.432)	251	–	–	(103.683)
Schwedische Krone	1	1	–	–	–
Schweizer Franken	103.565	481	–	–	103.084
US-Dollar	(35.740)	3.019.667	(38.206)	2.165.146	(5.182.347)
	992.631	8.242.194	(38.206)	2.165.146	(9.376.503)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon European Credit Fund		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		592	592	–	–	–
US-Dollar		63.679	123.133	–	1.215.129	(1.274.583)
		64.271	123.725	–	1.215.129	(1.274.583)

BNY Mellon Food Innovation Fund*

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	18.446	–	–	18.446	–
Kanadischer Dollar	36.398	–	–	36.398	–
Dänische Krone	94.175	470	–	93.705	–
Euro	241.003	–	–	241.003	–
Hongkong-Dollar	48.520	9	–	48.511	–
Japanischer Yen	101.617	284	–	101.333	–
Mexikanischer Peso	55.700	1.199	–	54.501	–
Norwegische Krone	77.427	326	–	77.101	–
Pfund Sterling	74.537	616	–	73.921	–
Schweizer Franken	127.977	–	–	127.977	–
	875.800	2.904	–	872.896	–

BNY Mellon Future Earth Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	32.813	94	–	32.719	–
Brasilianischer Real	23.748	–	–	23.748	–
Chinesischer Yuan	158.298	–	–	158.298	–
Dänische Krone	102.636	–	–	102.636	–
Euro	207.656	–	–	207.656	–
Japanischer Yen	134.303	–	–	134.303	–
Koreanischer Won	32.800	–	–	32.800	–
Norwegische Krone	30.995	–	–	30.995	–
Pfund Sterling	122.976	419	–	122.557	–
Schwedische Krone	21.839	–	–	21.839	–
Taiwan-Dollar	50.512	–	–	50.512	–
	918.576	513	–	918.063	–

BNY Mellon Future Life Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	21.807	154	–	21.653	–
Dänische Krone	63.333	–	–	63.333	–
Euro	157.267	–	–	157.267	–
Hongkong-Dollar	84.735	–	–	84.735	–
Indische Rupie	26.065	–	–	26.065	–
Pfund Sterling	132.862	–	–	132.862	–
Schweizer Franken	185.444	–	–	185.444	–
	671.513	154	–	671.359	–

BNY Mellon Global Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	6.453.154	16.954.415	(92.838)	–	(10.408.423)
Kanadischer Dollar	12.173.877	24.438.871	–	–	(12.264.994)
Chilenischer Peso	(4.032.718)	–	–	–	(4.032.718)
Kolumbianischer Peso	(238.792)	4.929.020	–	–	(5.167.812)
Tschechische Krone	8.621	8.621	–	–	–
Dänische Krone	750.759	12.910.791	–	–	(12.160.032)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		93.273.440	59.177.903	–	–	34.095.537
Indische Rupie		(132.160)	1.916.405	–	–	(2.048.565)
Indonesische Rupiah		3.785.010	5.664.890	–	–	(1.879.880)
Japanischer Yen		79.991.770	20.562.789	–	–	59.428.981
Koreanischer Won		(4.251.150)	–	–	–	(4.251.150)
Malaysischer Ringgit		20.478	1.941.550	–	–	(1.921.072)
Mexikanischer Peso		6.302.412	7.408.195	–	–	(1.105.783)
Neuseeländischer Dollar		(313.334)	37.197.293	–	–	(37.510.627)
Norwegische Krone		52.115	2.756.767	–	–	(2.704.652)
Polnischer Zloty		(6.465.672)	–	–	–	(6.465.672)
Pfund Sterling		15.006.949	12.071.599	–	–	2.935.350
Schwedische Krone		6.845.873	7.779.507	–	–	(933.634)
		209.230.632	215.718.616	(92.838)	–	(6.395.146)

BNY Mellon Global Credit Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(181.743)	5.577.375	(63.512)	–	(5.695.606)
Brasilianischer Real	(163.278)	638.510	–	–	(801.788)
Kanadischer Dollar	(103.532)	54.892	(96.168)	–	(62.256)
Chilenischer Peso	(8.027)	–	–	–	(8.027)
Chinesischer Yuan	272.914	–	–	–	272.914
Kolumbianischer Peso	4.443	–	–	–	4.443
Tschechische Krone	702.608	–	–	–	702.608
Euro	(5.654.802)	141.382.213	(4.233.524)	–	(142.803.491)
Ungarischer Forint	3	3	–	–	–
Indische Rupie	(1.727)	–	–	–	(1.727)
Indonesische Rupiah	11.639	–	–	–	11.639
Japanischer Yen	(476.812)	1.273.506	(123.585)	–	(1.626.733)
Koreanischer Won	(294.969)	–	–	–	(294.969)
Mexikanischer Peso	(30.939)	7	–	–	(30.946)
Neuseeländischer Dollar	72.131	494	–	–	71.637
Norwegische Krone	(3.907)	39	–	–	(3.946)
Polnischer Zloty	25.331	85	–	–	25.246
Südafrikanischer Rand	4.054	55	–	–	3.999
Pfund Sterling	(206.456)	35.221.546	–	–	(35.428.002)
Schwedische Krone	(102.426)	–	–	–	(102.426)
Schweizer Franken	1.510.384	159.035	–	–	1.351.349
	(4.625.111)	184.307.760	(4.516.789)	–	(184.416.082)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(10.353)	6.136.940	–	–	(6.147.293)
Brasilianischer Real	2.602.132	3.307.615	–	–	(705.483)
Kanadischer Dollar	(379.993)	33.657.178	–	–	(34.037.171)
Chilenischer Peso	(2.583.597)	–	–	–	(2.583.597)
Kolumbianischer Peso	(595.528)	4.308.502	–	–	(4.904.030)
Tschechische Krone	(5.215.561)	14.751	–	–	(5.230.312)
Dänische Krone	(21.248)	4.430.909	–	–	(4.452.157)
Euro	2.049.201	32.837.875	–	–	(30.788.674)
Indische Rupie	(69.510)	2.108.284	–	–	(2.177.794)
Indonesische Rupiah	5.155.817	5.145.871	–	–	9.946
Japanischer Yen	2.724.160	–	(6)	–	2.724.166
Koreanischer Won	(5.371.483)	–	–	–	(5.371.483)
Mexikanischer Peso	5.020.677	8.673.531	–	–	(3.652.854)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Neuseeländischer Dollar		(166.740)	24.592.346	–	–	(24.759.086)
Peruanischer neuer Sol		3.324.527	3.324.527	–	–	–
Polnischer Zloty		(5.211.148)	–	–	–	(5.211.148)
Südafrikanischer Rand		(64.729)	3.341.083	–	–	(3.405.812)
Pfund Sterling		(5.757.509)	32.493.261	–	5.104.833	(43.355.603)
Schwedische Krone		5.404.537	–	–	–	5.404.537
		833.652	164.372.673	(6)	5.104.833	(168.643.848)

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	279.747	–	–	279.747	–
Brasilianischer Real	1.967.570	1.028	–	1.967.752	(1.210)
Chinesischer Yuan	5.306.109	–	–	5.306.109	–
Euro	1.056.904	–	–	1.056.904	–
Hongkong-Dollar	6.830.834	–	–	6.830.834	–
Indische Rupie	8.953.122	65.935	–	8.887.187	–
Indonesische Rupiah	537.618	–	–	537.618	–
Japanischer Yen	785.708	–	–	785.708	–
Koreanischer Won	1.408.153	–	–	1.408.153	–
Malaysischer Ringgit	387	387	–	–	–
Mexikanischer Peso	956.354	10.463	–	945.891	–
Südafrikanischer Rand	425.930	–	–	425.930	–
Taiwan-Dollar	2.281.775	–	–	2.281.775	–
	30.790.211	77.813	–	30.713.608	(1.210)

BNY Mellon Global Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	4.752.378	–	–	4.752.378	–
Euro	91.568.376	518.889	(109)	91.532.221	(482.625)
Hongkong-Dollar	12.744.020	137.000	–	12.607.020	–
Koreanischer Won	11.977.058	–	–	11.977.058	–
Pfund Sterling	73.987.500	–	(5.543)	73.987.500	5.543
Schwedische Krone	9.996.915	–	–	9.996.915	–
Schweizer Franken	36.426.754	–	–	36.426.754	–
US-Dollar	5.543	–	–	–	5.543
	241.458.544	655.889	(5.652)	241.279.846	(471.539)

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(127.238)	21.558.356	–	–	(21.685.594)
Pfund Sterling	(72.484)	4.216.829	–	–	(4.289.313)
	(199.722)	25.775.185	–	–	(25.974.907)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar	2.538.138	–	–	2.538.138	–
Euro	49.799.100	154.980	–	49.644.120	–
Hongkong-Dollar	3.236.226	–	–	3.271.089	(34.863)
Israelischer Schekel	1.410	1.410	–	–	–
Norwegische Krone	775	775	–	–	–
Singapur-Dollar	209.254	209.254	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		12.374.557	49	–	12.374.508	–
		68.159.460	366.468	–	67.827.855	(34.863)

BNY Mellon Global Leaders Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.775.018	–	–	1.775.018	–
Dänische Krone	2.365.982	–	–	2.365.982	–
Euro	7.126.533	10.289	–	7.116.244	–
Hongkong-Dollar	2.558.420	–	–	2.558.420	–
Japanischer Yen	1.882.292	–	–	1.882.292	–
Pfund Sterling	342.471	342.471	–	–	–
Schweizer Franken	1.906.866	–	–	1.906.866	–
	17.957.582	352.760	–	17.604.822	–

BNY Mellon Global Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	296.540	–	–	296.540	–
Euro	3.433.475	1.641	–	3.433.475	(1.641)
Hongkong-Dollar	1.162.930	–	–	1.162.930	–
Indische Rupie	569.699	–	–	569.699	–
Japanischer Yen	1.776.434	–	–	1.776.434	–
Koreanischer Won	616.631	–	–	616.631	–
Malaysischer Ringgit	1	1	–	–	–
Pfund Sterling	2.906.662	–	–	2.906.662	–
Schweizer Franken	1.303.025	–	–	1.303.025	–
	12.065.397	1.642	–	12.065.396	(1.641)

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	(10.568.020)	76.105.805	(4.210.877)	12.024.915	(94.487.863)
Brasilianischer Real	23.445.584	16.374.085	–	7.084.474	(12.975)
Chinesischer Yuan	(8.983.124)	–	–	3.882.237	(12.865.361)
Dänische Krone	6.813.819	–	–	6.813.819	–
Hongkong-Dollar	28.442.742	9.956.159	(358.290)	29.266.825	(10.421.952)
Ungarischer Forint	21.114.822	–	–	–	21.114.822
Indische Rupie	11.895.739	46.323	–	11.849.416	–
Indonesische Rupiah	8.160.313	–	–	8.160.313	–
Japanischer Yen	10.552.697	33.734	–	10.518.963	–
Koreanischer Won	10.753.735	–	–	10.753.735	–
Mexikanischer Peso	21.345.265	21.345.265	–	–	–
Pfund Sterling	38.068.048	46.078.985	(1.709.439)	370.678.804	(376.980.302)
Schwedische Krone	49.409.286	–	(10)	–	49.409.296
Schweizer Franken	(4.117.363)	–	–	30.484.267	(34.601.630)
US-Dollar	706.615.373	193.154.477	(4.224.180)	685.205.741	(167.520.665)
	912.948.916	363.094.833	(10.502.796)	1.186.723.509	(626.366.630)

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Australischer Dollar	(9.420)	1.138.447	(95.188)	156.634	(1.209.313)
Brasilianischer Real	684.230	477.603	–	207.006	(379)
Chinesischer Yuan	95.548	–	–	95.548	–
Dänische Krone	(26.377)	–	–	193.011	(219.388)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.						
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Euro		(4.192.694)	2.257.182	(222.909)	4.945.711	(11.172.678)
Hongkong-Dollar		767.466	277.818	(9.959)	780.364	(280.757)
Ungarischer Forint		590.442	–	–	–	590.442
Indische Rupie		330.273	1.203	–	329.070	–
Indonesische Rupiah		232.455	–	–	232.455	–
Japanischer Yen		273.162	844	–	272.318	–
Koreanischer Won		(77.504)	–	–	295.407	(372.911)
Mexikanischer Peso		622.830	622.830	–	–	–
Neuseeländischer Dollar		(11.285)	1.181.817	–	–	(1.193.102)
Schweizer Franken		46.843	–	–	840.723	(793.880)
US-Dollar		14.106.475	7.604.014	(118.298)	18.744.941	(12.124.182)
		13.432.444	13.561.758	(446.354)	27.093.188	(26.776.148)

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(3.135.332)	6.523.710	(555.357)	1.487.566	(10.591.251)
Brasilianischer Real	3.861.682	2.698.711	–	1.165.105	(2.134)
Chinesischer Yuan	(1.454.724)	–	–	485.777	(1.940.501)
Dänische Krone	(177.100)	–	–	1.287.754	(1.464.854)
Euro	(77.530.389)	12.122.727	(1.290.970)	29.443.625	(117.805.771)
Hongkong-Dollar	4.108.321	1.612.481	(58.807)	4.726.169	(2.171.522)
Indische Rupie	(1.354.570)	3.681	–	1.972.756	(3.331.007)
Indonesische Rupiah	1.352.279	–	–	1.352.279	–
Japanischer Yen	1.728.779	5.690	–	1.723.089	–
Koreanischer Won	48.851	–	–	1.893.938	(1.845.087)
Mexikanischer Peso	3.518.156	3.518.156	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	(79.191)	6.592.229	–	–	(6.671.420)
Pfund Sterling	(14.999.631)	6.874.441	(277.650)	55.102.426	(76.698.848)
Schweizer Franken	(798.383)	–	–	5.487.716	(6.286.099)
	(84.911.252)	39.951.826	(2.182.784)	106.128.200	(228.808.494)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(230.947)	8.706.737	–	–	(8.937.684)
Euro	(5.323.927)	299.467.109	–	–	(304.791.036)
Pfund Sterling	(649.159)	59.864.267	–	–	(60.513.426)
Schwedische Krone	80.155	2.319.485	–	–	(2.239.330)
Schweizer Franken	475	475	–	–	–
	(6.123.403)	370.358.073	–	–	(376.481.476)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	106.860	410.609	–	175.865	(479.614)
Kolumbianischer Peso	107.181	107.181	–	–	–
Dänische Krone	117.259	756	–	116.503	–
Euro	1.574.641	550.729	–	1.513.111	(489.199)
Hongkong-Dollar	708.659	–	–	708.659	–
Japanischer Yen	1.258.499	2.000	–	1.256.499	–
Koreanischer Won	347.675	–	–	347.675	–
Mexikanischer Peso	295.175	295.175	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	104.727	267.608	–	97.038	(259.919)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		2.686.848	14.072	–	3.589.206	(916.430)
Schweizer Franken		1.023.429	–	–	1.023.429	–
		8.330.953	1.648.130	–	8.827.985	(2.145.162)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Euro	110.447.654	110.447.654	–	–	–
Pfund Sterling	46.437.292	46.437.292	–	–	–
US-Dollar	95.905.561	95.905.561	–	–	–
	252.790.507	252.790.507	–	–	–

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	27.398.685	1	–	27.398.684	–
Kanadischer Dollar	56.391.945	94.394	–	56.297.551	–
Dänische Krone	48.752.169	–	–	48.752.169	–
Hongkong-Dollar	32.160.498	–	–	32.160.498	–
Japanischer Yen	69.821.364	–	–	69.821.364	–
Singapur-Dollar	81.913	81.913	–	–	–
Pfund Sterling	75.355.503	189.075	–	75.166.428	–
Schweizer Franken	64.413.886	–	–	64.413.886	–
US-Dollar	674.458.797	18.990.042	(53)	655.595.439	(126.631)
	1.048.834.760	19.355.425	(53)	1.029.606.019	(126.631)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2	2	–	–	–
Chinesischer Yuan	13.268.257	348.581	–	12.919.676	–
Euro	68.266.240	96	–	68.266.144	–
Hongkong-Dollar	9.471.883	142.286	–	9.329.597	–
Japanischer Yen	45.683.975	276.266	–	45.407.709	–
Koreanischer Won	18.835.275	42.777	–	18.792.498	–
Singapur-Dollar	152	152	–	–	–
Pfund Sterling	180	180	–	–	–
Schwedische Krone	8.813.458	115.656	–	8.697.802	–
Schweizer Franken	7.580.730	123.713	–	7.457.017	–
Taiwan-Dollar	10.684.307	–	–	10.684.307	–
	182.604.459	1.049.709	–	181.554.750	–

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	461.551	14.900	–	446.651	–
Pfund Sterling	2	2	–	–	–
Schwedische Krone	476.950	6.315	–	470.635	–
Schweizer Franken	4.113	4.113	–	–	–
US-Dollar	516.463	27.540	–	488.923	–
	1.459.079	52.870	–	1.406.209	–

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	784.963	1	–	784.962	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		994.270	6.732	–	987.538	–
Schweizer Franken		347	347	–	–	–
		1.779.580	7.080	–	1.772.500	–

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	6.782	5.293.414	–	–	(5.286.632)
Kanadischer Dollar	(262.232)	29.745.284	–	–	(30.007.516)
Chilenischer Peso	(2.494.624)	–	–	–	(2.494.624)
Kolumbianischer Peso	(213.914)	5.550.567	–	–	(5.764.481)
Tschechische Krone	(5.262.327)	11.303	–	–	(5.273.630)
Dänische Krone	10.929	4.241.291	–	–	(4.230.362)
Indische Rupie	(95.822)	2.825.493	–	–	(2.921.315)
Indonesische Rupiah	4.979.382	6.569.978	–	–	(1.590.596)
Japanischer Yen	2.643.924	–	–	–	2.643.924
Koreanischer Won	(5.367.851)	–	–	–	(5.367.851)
Malaysischer Ringgit	(40.466)	1.901.092	(1)	–	(1.941.557)
Mexikanischer Peso	5.053.824	8.174.471	–	–	(3.120.647)
Neuseeländischer Dollar	(79.680)	21.489.367	–	–	(21.569.047)
Peruanischer neuer Sol	4.006.341	4.006.341	–	–	–
Polnischer Zloty	(5.253.210)	–	–	–	(5.253.210)
Pfund Sterling	(5.620.991)	40.001.257	–	–	(45.622.248)
Schwedische Krone	5.019.469	–	–	–	5.019.469
US-Dollar	(4.731.319)	130.939.466	–	–	(135.670.785)
	(7.701.785)	260.749.324	(1)	–	(268.451.108)

BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	3.510.619	–	–	3.510.619	–
Euro	65.187.535	107.670	–	65.079.865	–
Hongkong-Dollar	21.288.202	–	–	21.288.202	–
Indische Rupie	4.990.779	203	–	4.990.576	–
Indonesische Rupiah	3.730.449	–	–	3.730.449	–
Japanischer Yen	13.583.495	26.254	–	13.557.241	–
Koreanischer Won	8.332.485	–	–	8.332.485	–
Pfund Sterling	27.371.292	–	–	27.371.292	–
Schwedische Krone	6.404.199	–	–	6.404.199	–
Schweizer Franken	28.903.539	–	–	28.903.539	–
	183.302.594	134.127	–	183.168.467	–

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	(201.842)	1.700.740	(115.593)	348.201	(2.135.190)
Brasilianischer Real	296.436	462	–	296.517	(543)
Chinesischer Yuan	773.457	–	–	1.597.819	(824.362)
Dänische Krone	250.876	–	–	250.876	–
Hongkong-Dollar	1.312.124	405.844	(14.438)	1.632.103	(711.385)
Ungarischer Forint	529.767	–	–	–	529.767
Indische Rupie	816.982	–	–	816.982	–
Indonesische Rupiah	199.577	–	–	199.577	–
Japanischer Yen	1.059.868	8.490	–	1.051.378	–
Koreanischer Won	433.608	–	–	433.608	–
Mexikanischer Peso	1.559.660	1.559.660	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Neuseeländischer Dollar		(95.734)	2.364.195	–	–	(2.459.929)
Norwegische Krone		285.190	11.422	–	273.768	–
Pfund Sterling		141.596	3.875.678	–	16.528.481	(20.262.563)
Schwedische Krone		1.239.542	–	–	–	1.239.542
Schweizer Franken		(122.594)	–	–	1.583.810	(1.706.404)
Taiwan-Dollar		540.268	–	–	540.268	–
US-Dollar		27.390.080	8.509.571	(162.051)	22.099.807	(3.057.247)
		36.408.861	18.436.062	(292.082)	47.653.195	(29.388.314)

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(10.403)	1.693.503	–	–	(1.703.906)
Brasilianischer Real	(7.082)	258.359	–	–	(265.441)
Kanadischer Dollar	32.789	1.598	–	–	31.191
Chinesischer Yuan	(877)	–	–	–	(877)
Tschechische Krone	396.352	–	–	–	396.352
Euro	(1.668.577)	34.850.117	(139.781)	–	(36.378.913)
Japanischer Yen	3.008	1.016.049	–	–	(1.013.041)
Koreanischer Won	(19.776)	712.632	–	–	(732.408)
Mexikanischer Peso	404	1.944.519	–	–	(1.944.115)
Neuseeländischer Dollar	17.118	673.780	–	–	(656.662)
Südafrikanischer Rand	(50.409)	1.428.333	–	–	(1.478.742)
Pfund Sterling	(126.150)	6.839.071	(43.611)	–	(6.921.610)
Schweizer Franken	803.163	–	–	–	803.163
	(630.440)	49.417.961	(183.392)	–	(49.865.009)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	4.774.031	4.774.031	–	–	–
Pfund Sterling	1.653.742	1.653.742	–	–	–
	6.427.773	6.427.773	–	–	–

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	305.810	305.810	–	–	–
Hongkong-Dollar	6.406	6.406	–	–	–
Singapur-Dollar	15.154	15.154	–	–	–
Pfund Sterling	8.493	8.493	–	–	–
Schweizer Franken	(2.903.834)	–	–	–	(2.903.834)
	(2.567.971)	335.863	–	–	(2.903.834)

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling	(915.600)	6.728.362	–	–	(7.643.962)
US-Dollar	(1.623)	6.131.693	–	–	(6.133.316)
	(917.223)	12.860.055	–	–	(13.777.278)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Netto- engagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlich- keiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		(48.798)	103.315	–	–	(152.113)
US-Dollar		(72.631)	619.279	–	–	(691.910)
		(121.429)	722.594	–	–	(844.023)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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 2023 und 31. Dezember 2022 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 zuzurechnende Nettovermögen ausgewirkt hätte.

Fonds	Funktionale Währung	Anstieg/ (Rückgang) des Nettoinventarwerts 2023	Anstieg/ (Rückgang) des Nettoinventarwerts 2022
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	1.398.977	856.906
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	USD	1.713.118	2.011.893
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	731.170	924.839
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	1.688.234	1.617.067
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	(26.711)	(21.314)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	(16.386)	(8.413)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	5	k. A.
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	4	6.365
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	24.169	(3.822)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	551.457	657.593
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	EUR	6.775	k. A.
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	13.122.627	10.461.532
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	USD	916.611	1.539.511
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	9.297.985	12.072.927
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	2.010.126	3.407.973
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	1.281.423	897.879
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	607.158	603.270
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	(292.417)	(306.170)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	476.429	416.548
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	13.379.972	12.639.525
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	EUR	482.039	k. A.
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	64.461.146	52.441.738
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	8.522.255	9.130.223
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	86.665	72.954
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	USD	519.322	502.861
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	USD	8.674.174	9.165.130
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	47	321.389
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	USD	22.585	k. A.
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	(33.679)	(45.861)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	EUR	(5.041)	(6.071)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Der BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund war zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

Bei Fonds, die den VaR-Ansatz verwenden, wurde die Analyse der Währungsrisikosensitivität bei der Berechnung des Marktpreisrisikos berücksichtigt.

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 der langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen durch Standard & Poor's beträgt am Ende des Berichtszeitraums AA (31. Dezember 2022: 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.

Die Bewertung der langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen durch Standard & Poor's der Kontrahenten, mit denen die Fonds am 31. Dezember 2023 Geschäfte abgeschlossen haben, ist in nachstehender Tabelle aufgeführt (Bewertung für 31. Dezember 2022 ist identisch, sofern nicht anders angegeben):

Kontrahent	Rating	Kontrahent	Rating
Bank of America Merrill Lynch	A-	Lloyds Bank Corporate Markets Plc	A
Bank of Montreal	A+	Merrill Lynch International	A+
Bank of New York Mellon Corporation	A	Morgan Stanley & Co. LLC	A+

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Kontrahent	Rating	Kontrahent	Rating
Barclays Bank Plc	A+ (31. Dezember 2022: A)	Morgan Stanley & Co International Plc	A+
BNP Paribas	A+	Natixis CIB (Tochtergesellschaft A der Groupe BPCE)	A
Canadian Imperial Bank of Commerce	A+	Natwest Markets Plc	A
Citibank N.A.	A+	Nomura Holdings Inc	BBB+
Citigroup Global Markets Limited	A+	RBC Capital Markets LLC	AA-
Commonwealth Bank of Australien	AA-	RBC Europe Limited	AA-
Credit Suisse AG	A+ (31. Dezember 2022: BBB-)	Royal Bank of Canada	AA-
Deutsche Bank AG	A (31. Dezember 2022: A-)	Royal Bank of Scotland Plc	A+ (31. Dezember 2022: A)
Goldman Sachs & Co.	A+ (31. Dezember 2022: BBB+)	Skandinaviska Enskilda Banken AB	A+
Goldman Sachs International	A+	Societe Generale	A
HSBC Bank plc	A+	Standard Chartered Bank	A+
ING Bank N.V.	A+	State Street Corp	A
JPMorgan Chase Bank N.A.	A+	Toronto Dominion Bank	AA-
J.P.Morgan SE	A+	UBS AG	A+
J.P.Morgan Securities Plc	A+	Westpac Banking Corporation	AA-
Lloyds Bank Plc	A+		

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 Staatsanleihefonds 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 2023 und 31. Dezember 2022 auf.

Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	111.489	298.325
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	USD	1.761.938	1.252.552
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	k. A.	418.358
BNY Mellon Food Innovation Fund*	USD	k. A.	48.413
BNY Mellon Future Earth Fund*	USD	k. A.	25.669
BNY Mellon Future Life Fund*	USD	k. A.	60.144
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	1.410.817	2.812.843
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	75.231	11.508.948
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	USD	728.813	942.702
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	10.417.693	10.480.956
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	1.067.268	2.000.000
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	560.878	821.696
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	35.490.996	43.948.526
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	386.862	752.177
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	2.967.870	8.572.389
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.441.589	1.019.773
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	EUR	k. A.	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	USD	442.492	366.327
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	USD	6.029.885	10.944.816
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	EUR	37.676	2.380.282
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	11.438.515	8.172.917

* 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 2023 und 31. Dezember 2022 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	AAA	12,23	8,70
	AA	6,70	6,44
	A	20,59	7,63
	BBB	17,62	5,70
	BB	7,10	5,29
	B	1,50	1,16
	CCC	0,42	0,13
	Ohne Rating	33,84	64,95
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	AAA	3,56	k. A.
	AA	4,79	k. A.
	A	13,57	k. A.
	BBB	11,55	k. A.
	BB	6,14	k. A.
	B	0,80	k. A.
	Ohne Rating	59,59	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	AAA	k. A.	3,54
	AA	k. A.	6,35
	AA-	k. A.	6,29
	A+	k. A.	21,74
	A	k. A.	4,52
	BBB-	k. A.	2,72
	Ohne Rating	k. A.	54,84
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fonds	AAA	k. A.	19,17
	AA+	5,92	k. A.
	AA	8,73	3,74
	AA-	6,75	7,00
	A+	4,05	3,74
	A-	k. A.	k. A.
	BBB+	k. A.	1,20
	BBB	k. A.	k. A.
	BBB-	74,55	3,74
	BB-	k. A.	0,72
	Ohne Rating	5,92	60,69
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	AA+	55,61	89,84
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	AA+	7,56	8,91

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	AA	0,72	0,64
	A	3,80	4,89
	BBB	9,03	10,49
	BB	40,38	36,87
	B	30,81	29,90
	CCC	8,51	9,54
	CC	0,15	0,19
	D	0,06	0,09
	Ohne Rating	6,54	7,39
BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund	AAA	1,28	1,31
	AA	11,73	13,09
	A	41,89	40,82
	BBB	37,79	38,00
	BB und niedriger	4,23	3,58
	Ohne Rating	3,08	3,20
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	AA	k. A.	1,75
	A	9,10	10,24
	BBB	32,22	29,19
	BB	34,26	37,27
	B	10,19	16,82
	CCC	5,77	3,14
	Ohne Rating	8,46	1,59
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	AA	0,31	0,32
	A	2,03	3,01
	BBB	7,42	8,46
	BB	43,02	39,02
	B	33,08	34,23
	CCC	10,63	11,94
	C und niedriger	0,38	0,17
	Ohne Rating	3,13	2,85
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	AA	3,08	1,23
	A	8,04	6,80
	BBB	26,31	32,57
	BB	15,41	14,53
	B	14,65	16,56
	CCC und niedriger	2,10	4,02
	Ohne Rating	30,41	24,29

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fonds	AA	1,82	k. A.
	A	2,30	4,91
	BBB	30,41	35,07
	BB	8,24	13,23
	B	14,71	14,32
	CCC und niedriger	5,21	4,51
	Ohne Rating	37,31	27,96
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	AA	k. A.	k. A.
	A+	k. A.	k. A.
	A	6,75	5,68
	A-	k. A.	k. A.
	BBB+	k. A.	k. A.
	BBB	25,56	18,61
	BBB-	k. A.	k. A.
	BB	22,25	31,35
	BB-	k. A.	k. A.
	Ohne Rating	45,44	44,36
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	AA	1,89	k. A.
	A	4,43	4,38
	BBB	27,64	26,05
	BB	16,16	28,62
	B	10,36	7,26
	CCC und niedriger	2,90	2,60
	Ohne Rating	36,62	31,09
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	AA-	2,20	k. A.
	A+	3,60	2,75
	A	0,44	k. A.
	A-	k. A.	0,71
	BBB+	12,92	9,00
	BBB	4,76	8,69
	BBB-	12,04	8,30
	BB+	3,89	3,80
	BB	12,25	10,11
	BB-	1,67	15,05
	B+	4,08	3,37
	B	1,63	2,92
	B-	7,92	6,41
	CCC+	k. A.	4,69
	CC	1,32	0,96
	Ohne Rating	1,65	23,24

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	AAA	14,64	8,37
	AA	31,37	25,38
	A	14,28	15,48
	BBB	7,10	8,71
	BB	1,49	1,03
	B	k. A.	0,11
	Ohne Rating	0,61	40,92
BNY Mellon European Credit Fund	AAA	1,52	0,28
	AA	10,66	10,51
	A	32,14	34,56
	BBB	29,41	29,50
	BB und niedriger	5,56	3,00
	Ohne Rating	18,35	19,28
	BNY EM Corporate Fund	1,63	0,92
	BNY Short Dated HY Fund	0,73	1,95
'BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	A-	4,95	k. A.
	BBB+	1,39	k. A.
	BBB-	1,23	k. A.
	BB+	4,17	k. A.
	BB	7,21	k. A.
	BB-	14,76	k. A.
	B+	10,50	k. A.
	B	22,53	k. A.
	B-	6,15	k. A.
	Ohne Rating	27,11	k. A.
BNY Mellon Global Bond Fund	AAA	42,26	64,66
	AA	35,05	15,78
	A	9,68	8,83
	BBB	12,40	10,73
	BB	0,61	k. A.
BNY Mellon Global Credit Fund	AAA	4,09	3,53
	AA	8,33	9,01
	A	23,41	24,00
	BBB	28,34	20,04
	unter BBB	4,37	3,12
	Ohne Rating	31,46	40,30
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	AAA	26,77	51,80

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	AA	21,47	7,98
	A	9,73	5,58
	BBB	22,85	18,87
	BB	9,82	11,58
	B	1,29	2,76
	CC	0,20	1,14
	Ohne Rating	7,87	0,29
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BBB	1,03	3,74
	BB	34,87	38,36
	B	43,85	45,67
	CCC und niedriger	3,47	8,07
	Ohne Rating	16,78	4,16
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	AAA	1,22	29,34
	AA	11,39	12,10
	BBB	49,78	22,52
	BB	11,86	14,87
	B und niedriger	1,52	10,17
	Ohne Rating	24,23	11,00
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	AAA	k. A.	11,80
	AA	66,25	53,90
	BBB	21,12	7,15
	BB	10,67	12,00
	B und niedriger	1,82	8,03
	Ohne Rating	0,14	7,12
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	AAA	k. A.	11,19
	AA	61,36	58,32
	BBB	22,13	9,66
	BB	11,71	8,38
	B und niedriger	0,98	6,04
	Ohne Rating	3,82	6,41
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	A	2,12	3,06
	BB	0,69	25,05
	B	32,91	48,90
	CCC	49,01	7,89
	Ohne Rating	3,36	15,10
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	AAA	9,07	81,69
	AA+	k. A.	k. A.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	AA	72,23	2,65
	A+	k. A.	k. A.
	A	2,14	2,00
	BBB+	k. A.	k. A.
	BBB	11,13	9,68
	BBB-	k. A.	k. A.
	BB+	k. A.	k. A.
	BB	5,15	2,58
	B	k. A.	1,40
	Ohne Rating	0,28	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	AAA	25,62	53,34
	AA	18,62	5,66
	A	10,06	7,52
	BBB	25,66	21,24
	BB	10,53	8,78
	B	4,18	3,22
	CC	0,13	0,24
	Ohne Rating	5,20	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	AAA	k. A.	29,16
	AA	13,51	11,02
	A	1,99	2,56
	BBB	47,23	35,40
	BB	18,62	10,52
	B	4,76	5,57
	Ohne Rating	13,89	5,77
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	AAA	3,79	3,89
	AA	5,48	8,46
	A	15,31	11,46
	BBB	21,37	21,41
	BB	14,73	11,19
	B und niedriger	17,30	16,60
	Ohne Rating	22,02	26,99
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	AAA	5,13	6,11
	AA	52,19	51,23
	A	20,84	21,92
	BBB	3,99	3,92
	BB	0,68	0,55
	Ohne Rating	17,17	16,27

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	AAA	1,54	k. A.
	AA	2,63	k. A.
	A	16,88	k. A.
	BBB	28,31	k. A.
	BB	8,05	k. A.
	B	11,94	k. A.
	Ohne Rating	30,65	k. A.
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fonds	AAA	0,98	1,66
	AA	14,11	14,64
	A	37,62	41,52
	BBB	25,85	23,11
	BB	4,83	4,00
	B	k. A.	0,25
	CCC	1,26	k. A.
	Ohne Rating	15,35	14,82
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	AAA	1,82	3,49
	AA	9,97	10,86
	A	44,00	43,36
	BBB	22,59	19,01
	BB	5,13	4,00
	CCC	0,26	k. A.
	Ohne Rating	16,23	19,28

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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 Gesamtnettovermögen 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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Das Höchstengagement für die Fonds als ein Sicherungsgeber ist nachstehend aufgeführt.

Fonds	Basis- währung	31. Dezember 2023 Maximales Engagement	31. Dezember 2022 Maximales Engagement
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	76.065.791	169.014.628
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	2.977.110	1.963.406
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	k. A.	4.000.000
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	1.000.000	4.605.000
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	k. A.	26.301.000
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	5.500.000	k. A.
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	EUR	450.000	k. A.
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	310.625.300	229.413.793
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	4.415.800	k. A.
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	USD	35.357.079	41.809.162
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	104.500.000	k. A.

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.

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 2023 verpfändete kein Kontrahent Sachsicherheiten für von den Teilfonds gehaltene Derivatgeschäfte.

Zum 31. Dezember 2022 wurden die folgenden Sachsicherheiten für Derivatgeschäfte entgegengenommen:

Fonds	Kontrahent	Währung	Beizulegender Zeitwert
BNY Mellon Global Credit Fund	Citigroup Global Markets Limited	USD	18.262

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

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 aufrechtzuerhalten.

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 2023 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	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	6.392.397	–	–	6.392.397
Optionen	41.259	–	2.574	–	43.833
Swaps	–	3.208.824	–	5.505.716	8.714.540
Terminkontrakte (Forwards)	315.273.113	70.970.472	977.445	–	387.221.030
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	315.314.372	80.571.693	980.019	5.505.716	402.371.800
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	5.898.280	–	–	–	5.898.280
Antizipative Passiva	187.165	–	–	–	187.165
Sonstige Verbindlichkeiten	3.868.238	–	–	–	3.868.238
Einlösbare, partizipierende Anteile	291.785.157	–	–	–	291.785.157
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	617.053.212	80.571.693	980.019	5.505.716	704.110.640
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	226.228	–	–	226.228
Swaps	–	64.378	–	645.574	709.952
Terminkontrakte (Forwards)	155.410	–	–	–	155.410
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	155.410	290.606	–	645.574	1.091.590
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	2	–	–	–	2
Antizipative Passiva	12.924	–	–	–	12.924
Sonstige Verbindlichkeiten	9.393	–	–	–	9.393
Einlösbare, partizipierende Anteile	25.090.133	–	–	–	25.090.133
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	25.267.862	290.606	–	645.574	26.204.042

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	151.101	–	–	151.101
Swaps	9.394	27.672	6.315.772	–	6.352.838
Terminkontrakte (Forwards)	40.003.864	–	–	–	40.003.864
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	40.013.258	178.773	6.315.772	–	46.507.803
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	2.883	–	–	–	2.883
Margen auf Derivatkontrakte	39.453	–	–	–	39.453
Antizipative Passiva	46.095	–	–	–	46.095
Sonstige Verbindlichkeiten	1.151.314	–	–	–	1.151.314
Einlösbare, partizipierende Anteile	67.474.300	–	–	–	67.474.300
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	108.727.303	178.773	6.315.772	–	115.221.848
BNY Mellon Asian Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	277	–	–	–	277
Antizipative Passiva	57.295	–	–	–	57.295
Sonstige Verbindlichkeiten	34.432	–	–	–	34.432
Einlösbare, partizipierende Anteile	29.900.543	–	–	–	29.900.543
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	29.992.547	–	–	–	29.992.547
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	82	–	–	–	82
Antizipative Passiva	96.069	–	–	–	96.069
Sonstige Verbindlichkeiten	761.545	–	–	–	761.545
Einlösbare, partizipierende Anteile	36.883.296	–	–	–	36.883.296
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	37.740.992	–	–	–	37.740.992
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	974.416	–	–	–	974.416
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	974.416	–	–	–	974.416
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	68.153	–	–	–	68.153
Sonstige Verbindlichkeiten	467.554	–	–	–	467.554
Einlösbare, partizipierende Anteile	36.022.629	–	–	–	36.022.629
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	37.532.752	–	–	–	37.532.752

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	315.990	–	–	–	315.990
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	315.990	–	–	–	315.990
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	677	–	–	–	677
Antizipative Passiva	108.426	–	–	–	108.426
Sonstige Verbindlichkeiten	1.682.773	–	–	–	1.682.773
Einlösbare, partizipierende Anteile	42.260.200	–	–	–	42.260.200
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	44.368.066	–	–	–	44.368.066
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	20.548	426.288	28.603	–	475.439
Swaps	59.244	–	341.609	151.510	552.363
Terminkontrakte (Forwards)	1.738	14.449.818	–	–	14.451.556
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	81.530	14.876.106	370.212	151.510	15.479.358
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	2.229	–	–	–	2.229
Margen auf Derivatkontrakte	528.056	–	–	–	528.056
Antizipative Passiva	32.340	–	–	–	32.340
Sonstige Verbindlichkeiten	627.629	–	–	–	627.629
Einlösbare, partizipierende Anteile	25.982.861	–	–	–	25.982.861
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	27.254.645	14.876.106	370.212	151.510	42.652.473
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	2.149	–	–	–	2.149
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.149	–	–	–	2.149
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	509.794	–	–	–	509.794
Antizipative Passiva	259.859	–	–	–	259.859
Einlösbare, partizipierende Anteile	235.713.775	–	–	–	235.713.775
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	236.485.577	–	–	–	236.485.577

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	9	–	–	9
Terminkontrakte (Forwards)	63.240.204	–	–	–	63.240.204
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	63.240.204	9	–	–	63.240.213

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	5	–	–	–	5
Antizipative Passiva	140.202	–	–	–	140.202
Sonstige Verbindlichkeiten	173.299	–	–	–	173.299
Einlösbare, partizipierende Anteile	218.725.364	–	–	–	218.725.364
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	282.279.074	9	–	–	282.279.083

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	195.100	–	–	195.100
Terminkontrakte (Forwards)	24.854.057	–	–	–	24.854.057
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	24.854.057	195.100	–	–	25.049.157

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	43.805	–	–	–	43.805
Antizipative Passiva	56.574	–	–	–	56.574
Sonstige Verbindlichkeiten	20.629	–	–	–	20.629
Einlösbare, partizipierende Anteile	74.204.490	–	–	–	74.204.490
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	99.179.555	195.100	–	–	99.374.655

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	4	–	–	4
Terminkontrakte (Forwards)	7.212.273	–	–	–	7.212.273
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	7.212.273	4	–	–	7.212.277

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	8	–	–	–	8
Antizipative Passiva	433.627	–	–	–	433.627
Sonstige Verbindlichkeiten	10.430.049	–	–	–	10.430.049
Einlösbare, partizipierende Anteile	808.942.990	–	–	–	808.942.990
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	827.018.947	4	–	–	827.018.951

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 2023	Gesamt

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	16.771.910	–	–	–	16.771.910
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.771.910	–	–	–	16.771.910

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	3	–	–	–	3
Margen auf Derivatkontrakte	53	–	–	–	53
Antizipative Passiva	736.403	–	–	–	736.403
Sonstige Verbindlichkeiten	3.082.888	–	–	–	3.082.888
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.467.640.011	–	–	–	1.467.640.011
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.488.231.268	–	–	–	1.488.231.268

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	341.085	–	–	341.085
Terminkontrakte (Forwards)	34.918.752	–	–	–	34.918.752
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	34.918.752	341.085	–	–	35.259.837

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	157	–	–	–	157
Margen auf Derivatkontrakte	27.402	–	–	–	27.402
Antizipative Passiva	249.807	–	–	–	249.807
Sonstige Verbindlichkeiten	214.128	–	–	–	214.128
Einlösbare, partizipierende Anteile	283.929.865	–	–	–	283.929.865
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	319.340.111	341.085	–	–	319.681.196

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	40.407	–	–	40.407
Terminkontrakte (Forwards)	1.863.731	–	–	–	1.863.731
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.863.731	40.407	–	–	1.904.138

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	95	–	–	–	95
Margen auf Derivatkontrakte	62.052	–	–	–	62.052
Antizipative Passiva	35.324	–	–	–	35.324
Sonstige Verbindlichkeiten	34.955	–	–	–	34.955
Einlösbare, partizipierende Anteile	23.635.305	–	–	–	23.635.305
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	25.631.462	40.407	–	–	25.671.869

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	97.096	11.012.929	909.536	–	12.019.561
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	97.096	11.012.929	909.536	–	12.019.561
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	52	–	–	–	52
Antizipative Passiva	66.448	–	–	–	66.448
Sonstige Verbindlichkeiten	101.622	–	–	–	101.622
Einlösbare, partizipierende Anteile	28.563.501	–	–	–	28.563.501
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	28.828.719	11.012.929	909.536	–	40.751.184
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	12.012	–	–	12.012
Terminkontrakte (Forwards)	1.356.878	7.584.966	689.476	–	9.631.320
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.356.878	7.596.978	689.476	–	9.643.332
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	42.615	–	–	–	42.615
Antizipative Passiva	28.616	–	–	–	28.616
Sonstige Verbindlichkeiten	60.000	–	–	–	60.000
Einlösbare, partizipierende Anteile	22.900.692	–	–	–	22.900.692
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	24.388.801	7.596.978	689.476	–	32.675.255
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	21.687	–	–	21.687
Terminkontrakte (Forwards)	2.884.725	9.706.113	–	–	12.590.838
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.884.725	9.727.800	–	–	12.612.525
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	37.502	–	–	–	37.502
Antizipative Passiva	47.061	–	–	–	47.061
Einlösbare, partizipierende Anteile	30.450.493	–	–	–	30.450.493
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	33.419.781	9.727.800	–	–	43.147.581

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	1.305.355	–	–	1.305.355
Swaps	–	–	–	174.375	174.375
Terminkontrakte (Forwards)	1.918.036	50.722	–	–	1.968.758
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.918.036	1.356.077	–	174.375	3.448.488
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	1.286.930	–	–	–	1.286.930
Antizipative Passiva	191.208	–	–	–	191.208
Sonstige Verbindlichkeiten	684.198	–	–	–	684.198
Einlösbare, partizipierende Anteile	186.122.307	–	–	–	186.122.307
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	190.202.679	1.356.077	–	174.375	191.733.131
BNY Mellon European Credit Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	103.192	–	–	103.192
Swaps	–	–	–	106.853	106.853
Terminkontrakte (Forwards)	299.663	–	–	–	299.663
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	299.663	103.192	–	106.853	509.708
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	23.701	–	–	–	23.701
Einlösbare, partizipierende Anteile	58.400.917	–	–	–	58.400.917
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	58.724.281	103.192	–	106.853	58.934.326
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Swaps	–	–	3.102	261.486	264.588
Terminkontrakte (Forwards)	1.876.267	3.465.556	–	–	5.341.823
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.876.267	3.465.556	3.102	261.486	5.606.411
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	30.851	–	–	–	30.851
Sonstige Verbindlichkeiten	419.677	–	–	–	419.677
Einlösbare, partizipierende Anteile	31.240.515	–	–	–	31.240.515
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	33.567.310	3.465.556	3.102	261.486	37.297.454

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 2023
BNY Mellon Global Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.881.824	–	–	1.881.824
Terminkontrakte (Forwards)	3.006.104	289.240.129	–	–	292.246.233
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.006.104	291.121.953	–	–	294.128.057
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	106	–	–	–	106
Margen auf Derivatkontrakte	556.685	–	–	–	556.685
Antizipative Passiva	497.162	–	–	–	497.162
Sonstige Verbindlichkeiten	4.082.775	–	–	–	4.082.775
Einlösbare, partizipierende Anteile	487.468.836	–	–	–	487.468.836
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	495.611.668	291.121.953	–	–	786.733.621
BNY Mellon Global Credit Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	3.701.085	–	–	3.701.085
Optionen	57.146	–	–	–	57.146
Swaps	–	794.718	–	9.489.060	10.283.778
Terminkontrakte (Forwards)	494.750.317	235.887	–	–	494.986.204
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	494.807.463	4.731.690	–	9.489.060	509.028.213
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	3.907	–	–	–	3.907
Margen auf Derivatkontrakte	4.441.185	–	–	–	4.441.185
Antizipative Passiva	443.190	–	–	–	443.190
Sonstige Verbindlichkeiten	3.498.349	–	–	–	3.498.349
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.040.060.466	–	–	–	1.040.060.466
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.543.254.560	4.731.690	–	9.489.060	1.557.475.310
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.980.425	–	–	1.980.425
Terminkontrakte (Forwards)	1.082.624	176.668.670	–	–	177.751.294
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.082.624	178.649.095	–	–	179.731.719
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	55	–	–	–	55
Margen auf Derivatkontrakte	14.747	–	–	–	14.747
Antizipative Passiva	215.783	–	–	–	215.783
Sonstige Verbindlichkeiten	38.092	–	–	–	38.092
Einlösbare, partizipierende Anteile	182.577.833	–	–	–	182.577.833
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	183.929.134	178.649.095	–	–	362.578.229

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	24.253	–	–	–	24.253
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	24.253	–	–	–	24.253
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	88	–	–	–	88
Antizipative Passiva	55.699	–	–	–	55.699
Sonstige Verbindlichkeiten	248.053	–	–	–	248.053
Einlösbare, partizipierende Anteile	22.096.301	–	–	–	22.096.301
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	22.424.394	–	–	–	22.424.394
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	403.529	–	–	–	403.529
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	403.529	–	–	–	403.529
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	1.427	–	–	–	1.427
Antizipative Passiva	671.719	–	–	–	671.719
Sonstige Verbindlichkeiten	598.473	–	–	–	598.473
Einlösbare, partizipierende Anteile	444.347.178	–	–	–	444.347.178
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	446.022.326	–	–	–	446.022.326
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	26.863.133	–	–	–	26.863.133
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	26.863.133	–	–	–	26.863.133
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	8.076	–	–	–	8.076
Antizipative Passiva	123.221	–	–	–	123.221
Sonstige Verbindlichkeiten	155.501	–	–	–	155.501
Einlösbare, partizipierende Anteile	115.137.405	–	–	–	115.137.405
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	142.287.336	–	–	–	142.287.336

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.120.759	–	–	–	1.120.759
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.120.759	–	–	–	1.120.759
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	120.783	–	–	–	120.783
Sonstige Verbindlichkeiten	16.900	–	–	–	16.900
Einlösbare, partizipierende Anteile	95.571.000	–	–	–	95.571.000
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	96.829.442	–	–	–	96.829.442
BNY Mellon Global Leaders Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	870.866	–	–	–	870.866
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	870.866	–	–	–	870.866
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	305	–	–	–	305
Antizipative Passiva	80.865	–	–	–	80.865
Sonstige Verbindlichkeiten	16.524	–	–	–	16.524
Einlösbare, partizipierende Anteile	69.597.946	–	–	–	69.597.946
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	70.566.506	–	–	–	70.566.506
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.749	–	–	–	1.749
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.749	–	–	–	1.749
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	13.954	–	–	–	13.954
Antizipative Passiva	66.644	–	–	–	66.644
Sonstige Verbindlichkeiten	14.879	–	–	–	14.879
Einlösbare, partizipierende Anteile	30.652.940	–	–	–	30.652.940
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	30.750.166	–	–	–	30.750.166

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	343.300	–	–	343.300
Optionen	4.277.283	2.635.575	7.709.975	–	14.622.833
Terminkontrakte (Forwards)	32.108.021	238.593.289	–	–	270.701.310
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	36.385.304	241.572.164	7.709.975	–	285.667.443

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	198.715	–	–	–	198.715
Antizipative Passiva	1.422.321	–	–	–	1.422.321
Sonstige Verbindlichkeiten	20.272.626	–	–	–	20.272.626
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.260.404.100	–	–	–	1.260.404.100
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.318.683.066	241.572.164	7.709.975	–	1.567.965.205

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Futures	–	11.293	–	–	11.293
Optionen	140.420	82.435	247.321	–	470.176
Terminkontrakte (Forwards)	6.189.971	5.164.725	–	–	11.354.696
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.330.391	5.258.453	247.321	–	11.836.165

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	572	–	–	–	572
Antizipative Passiva	61.784	–	–	–	61.784
Sonstige Verbindlichkeiten	38.547	–	–	–	38.547
Einlösbare, partizipierende Anteile	40.800.465	–	–	–	40.800.465
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	47.231.759	5.258.453	247.321	–	52.737.533

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	65.341	–	–	65.341
Optionen	811.175	477.885	1.516.704	–	2.805.764
Terminkontrakte (Forwards)	93.378.253	13.649.975	–	–	107.028.228
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	94.189.428	14.193.201	1.516.704	–	109.899.333

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	132.048	–	–	–	132.048
Antizipative Passiva	327.415	–	–	–	327.415
Sonstige Verbindlichkeiten	236.945	–	–	–	236.945
Einlösbare, partizipierende Anteile	228.357.467	–	–	–	228.357.467
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	323.243.303	14.193.201	1.516.704	–	338.953.208

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 2023	Gesamt

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	253.938.166	303.865.345	–	–	557.803.511
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	253.938.166	303.865.345	–	–	557.803.511

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	9.323	–	–	–	9.323
Antizipative Passiva	678.522	–	–	–	678.522
Sonstige Verbindlichkeiten	10.647.224	–	–	–	10.647.224
Einlösbare, partizipierende Anteile	776.895.860	–	–	–	776.895.860
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.042.169.095	303.865.345	–	–	1.346.034.440

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.187.261	1.244.955	–	–	2.432.216
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.187.261	1.244.955	–	–	2.432.216

Verbindlichkeiten

Antizipative Passiva	12.051	–	–	–	12.051
Einlösbare, partizipierende Anteile	29.695.765	–	–	–	29.695.765
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	30.895.077	1.244.955	–	–	32.140.032

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Terminkontrakte (Forwards)	5.883.600.340	–	–	–	5.883.600.340
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	5.883.600.340	–	–	–	5.883.600.340

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	5.245	–	–	–	5.245
Antizipative Passiva	21.199.005	–	–	–	21.199.005
Sonstige Verbindlichkeiten	106.681.160	–	–	–	106.681.160
Einlösbare, partizipierende Anteile	17.853.251.736	–	–	–	17.853.251.736
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	23.864.737.486	–	–	–	23.864.737.486

BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Antizipative Passiva	22.291	–	–	–	22.291
Einlösbare, partizipierende Anteile	20.797.049	–	–	–	20.797.049
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	20.819.340	–	–	–	20.819.340

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	32.684.944	–	–	–	32.684.944
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	32.684.944	–	–	–	32.684.944
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	2.395	–	–	–	2.395
Antizipative Passiva	1.938.328	–	–	–	1.938.328
Sonstige Verbindlichkeiten	2.178.124	–	–	–	2.178.124
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.471.472.106	–	–	–	1.471.472.106
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.508.275.897	–	–	–	1.508.275.897
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	8.365.390	–	–	–	8.365.390
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	8.365.390	–	–	–	8.365.390
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	2.251	–	–	–	2.251
Antizipative Passiva	571.880	–	–	–	571.880
Sonstige Verbindlichkeiten	746.212	–	–	–	746.212
Einlösbare, partizipierende Anteile	424.709.029	–	–	–	424.709.029
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	434.394.762	–	–	–	434.394.762
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	2	–	–	–	2
Antizipative Passiva	68.131	–	–	–	68.131
Sonstige Verbindlichkeiten	84.068	–	–	–	84.068
Einlösbare, partizipierende Anteile	50.458.855	–	–	–	50.458.855
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	50.611.056	–	–	–	50.611.056

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	3.794.690	–	–	3.794.690
Terminkontrakte (Forwards)	134.806.145	216.977.977	–	–	351.784.122
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	134.806.145	220.772.667	–	–	355.578.812
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	31.742	–	–	–	31.742
Antizipative Passiva	316.668	–	–	–	316.668
Sonstige Verbindlichkeiten	5.239.147	–	–	–	5.239.147
Einlösbare, partizipierende Anteile	332.781.654	–	–	–	332.781.654
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	473.175.356	220.772.667	–	–	693.948.023
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	4.079	–	–	–	4.079
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.079	–	–	–	4.079
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	10.970	–	–	–	10.970
Antizipative Passiva	18.372	–	–	–	18.372
Sonstige Verbindlichkeiten	75.588	–	–	–	75.588
Einlösbare, partizipierende Anteile	11.080.716	–	–	–	11.080.716
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	11.189.725	–	–	–	11.189.725
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	523.979	–	–	–	523.979
Sonstige Verbindlichkeiten	41.863	–	–	–	41.863
Einlösbare, partizipierende Anteile	438.759.735	–	–	–	438.759.735
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	439.325.577	–	–	–	439.325.577

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 2023	Gesamt
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	4.487	–	–	4.487
Optionen	57.989	34.281	110.202	–	202.472
Terminkontrakte (Forwards)	2.342.044	6.360.495	–	–	8.702.539
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.400.033	6.399.263	110.202	–	8.909.498

Verbindlichkeiten

Antizipative Passiva	77.963	–	–	–	77.963
Sonstige Verbindlichkeiten	289.216	–	–	–	289.216
Einlösbare, partizipierende Anteile	16.994.689	–	–	–	16.994.689
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	19.761.901	6.399.263	110.202	–	26.271.366

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	764.360	–	–	764.360
Optionen	8.372	–	–	–	8.372
Swaps	–	83.769	–	881.054	964.823
Terminkontrakte (Forwards)	69.642.698	–	–	–	69.642.698
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	69.651.070	848.129	–	881.054	71.380.253

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	129.659	–	–	–	129.659
Margen auf Derivatkontrakte	1.193.722	–	–	–	1.193.722
Antizipative Passiva	123.820	–	–	–	123.820
Sonstige Verbindlichkeiten	11.436	–	–	–	11.436
Einlösbare, partizipierende Anteile	94.159.520	–	–	–	94.159.520
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	165.269.227	848.129	–	881.054	166.998.410

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.593.474	–	–	–	1.593.474
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.593.474	–	–	–	1.593.474

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	404	–	–	–	404
Antizipative Passiva	349.390	–	–	–	349.390
Sonstige Verbindlichkeiten	9.567.164	–	–	–	9.567.164
Einlösbare, partizipierende Anteile	416.636.356	–	–	–	416.636.356
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	428.146.788	–	–	–	428.146.788

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 2023	Gesamt
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	11.438.242	–	–	–	11.438.242
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	11.438.242	–	–	–	11.438.242
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	74	–	–	–	74
Antizipative Passiva	655.205	–	–	–	655.205
Sonstige Verbindlichkeiten	4.748.887	–	–	–	4.748.887
Einlösbare, partizipierende Anteile	804.519.905	–	–	–	804.519.905
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	821.362.313	–	–	–	821.362.313
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	297.759	–	–	297.759
Terminkontrakte (Forwards)	15.426.646	3.065.521	–	–	18.492.167
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	15.426.646	3.363.280	–	–	18.789.926
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	58.885	–	–	–	58.885
Einlösbare, partizipierende Anteile	60.653.405	–	–	–	60.653.405
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	76.138.936	3.363.280	–	–	79.502.216
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	3.150.027	–	–	3.150.027
Swaps	–	–	–	4.750.096	4.750.096
Terminkontrakte (Forwards)	2.694.786	1.159.071	–	–	3.853.857
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.694.786	4.309.098	–	4.750.096	11.753.980
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	713.228	–	–	–	713.228
Sonstige Verbindlichkeiten	4.244.809	–	–	–	4.244.809
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.114.260.032	–	–	–	1.114.260.032
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.121.912.855	4.309.098	–	4.750.096	1.130.972.049

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 2023	Gesamt
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	76.772	–	–	76.772
Terminkontrakte (Forwards)	149.033	94.196	–	–	243.229
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	149.033	170.968	–	–	320.001
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	4.800	–	–	–	4.800
Antizipative Passiva	18.921	–	–	–	18.921
Einlösbare, partizipierende Anteile	35.272.822	–	–	–	35.272.822
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	35.445.576	170.968	–	–	35.616.544

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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 2022 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 2022	Gesamt
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	3.639.286	–	–	3.639.286
Optionen	364.760	315.958	14.517	–	695.235
Swaps	–	–	–	10.541.178	10.541.178
Terminkontrakte (Forwards)	351.557.389	20.223.927	–	–	371.781.316
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	351.922.149	24.179.171	14.517	10.541.178	386.657.015
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	508.227	–	–	–	508.227
Margen auf Derivatkontrakte	68.994	–	–	–	68.994
Antizipative Passiva	197.599	–	–	–	197.599
Sonstige Verbindlichkeiten	3.746.627	–	–	–	3.746.627
Einlösbare, partizipierende Anteile	335.180.316	–	–	–	335.180.316
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	691.623.912	24.179.171	14.517	10.541.178	726.358.778

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Futures	1.554	47.428	–	–	48.982
Swaps	5.362.788	–	–	–	5.362.788
Terminkontrakte (Forwards)	10.981.192	–	–	–	10.981.192
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.345.534	47.428	–	–	16.392.962
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	307	–	–	–	307
Margen auf Derivatkontrakte	22.880	–	–	–	22.880
Antizipative Passiva	203.416	–	–	–	203.416
Sonstige Verbindlichkeiten	3.408.986	–	–	–	3.408.986
Einlösbare, partizipierende Anteile	139.786.504	–	–	–	139.786.504
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	159.767.627	47.428	–	–	159.815.055
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	14.768	–	–	14.768
Swaps	–	5.613	7.613.180	1.208.574	8.827.367
Terminkontrakte (Forwards)	109.603.033	–	–	–	109.603.033
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	109.603.033	20.381	7.613.180	1.208.574	118.445.168
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	3.114	–	–	–	3.114
Margen auf Derivatkontrakte	165.356	–	–	–	165.356
Antizipative Passiva	66.011	–	–	–	66.011
Sonstige Verbindlichkeiten	4.179.174	–	–	–	4.179.174
Einlösbare, partizipierende Anteile	113.142.193	–	–	–	113.142.193
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	227.158.881	20.381	7.613.180	1.208.574	236.001.016
BNY Mellon Asian Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	8.064	–	–	–	8.064
Antizipative Passiva	30.027	–	–	–	30.027
Einlösbare, partizipierende Anteile	18.778.990	–	–	–	18.778.990
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	18.817.081	–	–	–	18.817.081

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	10.664	–	–	–	10.664
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	10.664	–	–	–	10.664
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	6.701	–	–	–	6.701
Antizipative Passiva	103.875	–	–	–	103.875
Sonstige Verbindlichkeiten	8.044	–	–	–	8.044
Einlösbare, partizipierende Anteile	43.544.220	–	–	–	43.544.220
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	43.673.504	–	–	–	43.673.504
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.873.175	–	–	–	1.873.175
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.873.175	–	–	–	1.873.175
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	69.375	–	–	–	69.375
Sonstige Verbindlichkeiten	131.301	–	–	–	131.301
Einlösbare, partizipierende Anteile	40.968.820	–	–	–	40.968.820
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	43.042.671	–	–	–	43.042.671
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	308.117	–	–	–	308.117
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	308.117	–	–	–	308.117
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	110.302	–	–	–	110.302
Sonstige Verbindlichkeiten	907.053	–	–	–	907.053
Einlösbare, partizipierende Anteile	39.894.419	–	–	–	39.894.419
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	41.219.891	–	–	–	41.219.891

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	32.078	1.047.031	1.509	–	1.080.618
Swaps	–	–	35.659	47.527	83.186
Terminkontrakte (Forwards)	34.883	15.697.502	–	–	15.732.385
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	66.961	16.744.533	37.168	47.527	16.896.189
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	1.676	–	–	–	1.676
Margen auf Derivatkontrakte	616.410	–	–	–	616.410
Antizipative Passiva	17.650	–	–	–	17.650
Sonstige Verbindlichkeiten	103.573	–	–	–	103.573
Einlösbare, partizipierende Anteile	23.339.106	–	–	–	23.339.106
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	24.145.376	16.744.533	37.168	47.527	40.974.604
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.210.269	–	–	–	2.210.269
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.210.269	–	–	–	2.210.269
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	595.325	–	–	595.325
Terminkontrakte (Forwards)	4.936	–	–	–	4.936
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.936	595.325	–	–	600.261
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	343.774	–	–	–	343.774
Einlösbare, partizipierende Anteile	555.576.067	–	–	–	555.576.067
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	555.924.777	595.325	–	–	556.520.102
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	205.626.328	–	–	–	205.626.328
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	205.626.328	–	–	–	205.626.328
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	1.197	–	–	–	1.197
Antizipative Passiva	91.412	–	–	–	91.412
Sonstige Verbindlichkeiten	48.132	–	–	–	48.132
Einlösbare, partizipierende Anteile	178.903.236	–	–	–	178.903.236
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	384.670.305	–	–	–	384.670.305

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	24.305	–	–	24.305
Terminkontrakte (Forwards)	47.446.052	–	–	–	47.446.052
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	47.446.052	24.305	–	–	47.470.357
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	34.663	–	–	–	34.663
Antizipative Passiva	21.204	–	–	–	21.204
Sonstige Verbindlichkeiten	41.742	–	–	–	41.742
Einlösbare, partizipierende Anteile	46.542.724	–	–	–	46.542.724
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	94.086.385	24.305	–	–	94.110.690
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	110.805	–	–	110.805
Terminkontrakte (Forwards)	206.392.420	–	–	–	206.392.420
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	206.392.420	110.805	–	–	206.503.225
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	238.912	–	–	–	238.912
Sonstige Verbindlichkeiten	27.682.906	–	–	–	27.682.906
Einlösbare, partizipierende Anteile	948.814.250	–	–	–	948.814.250
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.183.128.488	110.805	–	–	1.183.239.293
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	261.068.159	–	–	–	261.068.159
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	261.068.159	–	–	–	261.068.159
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	10.494	–	–	–	10.494
Antizipative Passiva	561.195	–	–	–	561.195
Sonstige Verbindlichkeiten	17.036.379	–	–	–	17.036.379
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.417.476.467	–	–	–	1.417.476.467
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.696.152.694	–	–	–	1.696.152.694

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	5.591	–	–	5.591
Terminkontrakte (Forwards)	63.273.543	–	–	–	63.273.543
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	63.273.543	5.591	–	–	63.279.134
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	32	–	–	–	32
Margen auf Derivatkontrakte	104.233	–	–	–	104.233
Antizipative Passiva	290.284	–	–	–	290.284
Sonstige Verbindlichkeiten	374.475	–	–	–	374.475
Einlösbare, partizipierende Anteile	352.246.309	–	–	–	352.246.309
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	416.288.876	5.591	–	–	416.294.467
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	10.234	–	–	10.234
Terminkontrakte (Forwards)	1.523.826	–	–	–	1.523.826
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.523.826	10.234	–	–	1.534.060
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	36.614	–	–	–	36.614
Sonstige Verbindlichkeiten	102.822	–	–	–	102.822
Einlösbare, partizipierende Anteile	24.246.898	–	–	–	24.246.898
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	25.910.160	10.234	–	–	25.920.394
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.458.919	3.654.210	–	–	5.113.129
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.458.919	3.654.210	–	–	5.113.129
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	89.955	–	–	–	89.955
Sonstige Verbindlichkeiten	99.039	–	–	–	99.039
Einlösbare, partizipierende Anteile	25.263.639	–	–	–	25.263.639
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	26.911.552	3.654.210	–	–	30.565.762

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	2.363	–	–	2.363
Terminkontrakte (Forwards)	1.357.741	3.038.279	–	–	4.396.020
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.357.741	3.040.642	–	–	4.398.383

Verbindlichkeiten

Antizipative Passiva	8.876	–	–	–	8.876
Einlösbare, partizipierende Anteile	24.491.950	–	–	–	24.491.950
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	25.858.567	3.040.642	–	–	28.899.209

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	47.614	–	–	47.614
Terminkontrakte (Forwards)	39.453.175	11.796.701	–	–	51.249.876
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	39.453.175	11.844.315	–	–	51.297.490

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	30.884	–	–	–	30.884
Antizipative Passiva	62.064	–	–	–	62.064
Einlösbare, partizipierende Anteile	38.253.080	–	–	–	38.253.080
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	77.799.203	11.844.315	–	–	89.643.518

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	940.665	–	–	940.665
Swaps	–	–	–	42.467	42.467
Terminkontrakte (Forwards)	13.467.575	–	–	–	13.467.575
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	13.467.575	940.665	–	42.467	14.450.707

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	148	–	–	–	148
Antizipative Passiva	201.665	–	–	–	201.665
Sonstige Verbindlichkeiten	434.815	–	–	–	434.815
Einlösbare, partizipierende Anteile	176.583.489	–	–	–	176.583.489
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	190.687.692	940.665	–	42.467	191.670.824

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 2022	Gesamt
BNY Mellon European Credit Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	72.043	–	–	72.043
Optionen	–	15.904	–	–	15.904
Swaps	–	–	–	14.684	14.684
Terminkontrakte (Forwards)	190.381	–	–	–	190.381
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	190.381	87.947	–	14.684	293.012
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	4	–	–	–	4
Antizipative Passiva	12.733	–	–	–	12.733
Sonstige Verbindlichkeiten	537.082	–	–	–	537.082
Einlösbare, partizipierende Anteile	43.864.621	–	–	–	43.864.621
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	44.604.821	87.947	–	14.684	44.707.452
BNY Mellon Food Innovation Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	2.304	–	–	–	2.304
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.926.984	–	–	–	1.926.984
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.929.288	–	–	–	1.929.288
BNY Mellon Future Earth Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	21.733	–	–	–	21.733
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	21.733	–	–	–	21.733
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	1.426	–	–	–	1.426
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.683.423	–	–	–	1.683.423
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.706.582	–	–	–	1.706.582
BNY Mellon Future Life Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	1.716	–	–	–	1.716
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.102.066	–	–	–	2.102.066
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.103.782	–	–	–	2.103.782

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Global Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	92.838	–	–	92.838
Terminkontrakte (Forwards)	53.558.820	145.456.615	–	–	199.015.435
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	53.558.820	145.549.453	–	–	199.108.273
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	150.911	–	–	–	150.911
Margen auf Derivatkontrakte	303.373	–	–	–	303.373
Antizipative Passiva	348.469	–	–	–	348.469
Sonstige Verbindlichkeiten	6.346.222	–	–	–	6.346.222
Einlösbare, partizipierende Anteile	408.355.513	–	–	–	408.355.513
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	469.063.308	145.549.453	–	–	614.612.761
BNY Mellon Global Credit Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.212.847	–	–	1.212.847
Optionen	350.737	302.350	–	–	653.087
Swaps	–	–	–	3.373.387	3.373.387
Terminkontrakte (Forwards)	194.802.604	782.690	–	–	195.585.294
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	195.153.341	2.297.887	–	3.373.387	200.824.615
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	950.423	–	–	–	950.423
Margen auf Derivatkontrakte	507.229	–	–	–	507.229
Antizipative Passiva	100.042	–	–	–	100.042
Sonstige Verbindlichkeiten	1.418.786	–	–	–	1.418.786
Einlösbare, partizipierende Anteile	384.749.177	–	–	–	384.749.177
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	582.878.998	2.297.887	–	3.373.387	588.550.272
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	9.804.276	166.626.604	–	–	176.430.880
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	9.804.276	166.626.604	–	–	176.430.880
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	6	–	–	–	6
Margen auf Derivatkontrakte	213.548	–	–	–	213.548
Antizipative Passiva	284.587	–	–	–	284.587
Sonstige Verbindlichkeiten	4.462	–	–	–	4.462
Einlösbare, partizipierende Anteile	345.001.062	–	–	–	345.001.062
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	355.307.941	166.626.604	–	–	521.934.545

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	54.565	–	–	–	54.565
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	54.565	–	–	–	54.565
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	67.814	–	–	–	67.814
Sonstige Verbindlichkeiten	3.921	–	–	–	3.921
Einlösbare, partizipierende Anteile	35.345.994	–	–	–	35.345.994
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	35.472.294	–	–	–	35.472.294
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.802.156	–	–	–	1.802.156
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.802.156	–	–	–	1.802.156
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	5.660	–	–	–	5.660
Antizipative Passiva	740.414	–	–	–	740.414
Sonstige Verbindlichkeiten	812.275	–	–	–	812.275
Einlösbare, partizipierende Anteile	535.733.690	–	–	–	535.733.690
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	539.094.195	–	–	–	539.094.195
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	24.427.369	–	–	–	24.427.369
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	24.427.369	–	–	–	24.427.369
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	116.391	–	–	–	116.391
Sonstige Verbindlichkeiten	1.416.004	–	–	–	1.416.004
Einlösbare, partizipierende Anteile	109.883.243	–	–	–	109.883.243
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	135.843.007	–	–	–	135.843.007
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	3.709.297	–	–	–	3.709.297
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.709.297	–	–	–	3.709.297
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	158.209	–	–	–	158.209
Sonstige Verbindlichkeiten	83.700	–	–	–	83.700
Einlösbare, partizipierende Anteile	122.260.526	–	–	–	122.260.526
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	126.211.732	–	–	–	126.211.732

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 2022
BNY Mellon Global Leaders Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	105.395	–	–	–	105.395
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	105.395	–	–	–	105.395
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	51.971	–	–	–	51.971
Sonstige Verbindlichkeiten	163	–	–	–	163
Einlösbare, partizipierende Anteile	46.497.437	–	–	–	46.497.437
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	46.654.966	–	–	–	46.654.966
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	46.570	–	–	–	46.570
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	46.570	–	–	–	46.570
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	64.602	–	–	–	64.602
Sonstige Verbindlichkeiten	5.085	–	–	–	5.085
Einlösbare, partizipierende Anteile	27.108.214	–	–	–	27.108.214
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	27.224.471	–	–	–	27.224.471
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	8.472.229	–	–	8.472.229
Optionen	1.714.333	1.709.439	6.437.355	–	9.861.127
Terminkontrakte (Forwards)	88.772.264	235.282.163	–	–	324.054.427
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	90.486.597	245.463.831	6.437.355	–	342.387.783
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	3.130.555	–	–	–	3.130.555
Antizipative Passiva	1.882.054	–	–	–	1.882.054
Sonstige Verbindlichkeiten	19.390.789	–	–	–	19.390.789
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.105.183.114	–	–	–	2.105.183.114
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.220.073.109	245.463.831	6.437.355	–	2.471.974.295

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Futures	–	219.868	–	–	219.868
Optionen	41.649	49.815	184.837	–	276.301
Terminkontrakte (Forwards)	13.145.305	6.428.153	–	–	19.573.458
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	13.186.954	6.697.836	184.837	–	20.069.627
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	49.884	–	–	–	49.884
Sonstige Verbindlichkeiten	453.917	–	–	–	453.917
Einlösbare, partizipierende Anteile	60.348.549	–	–	–	60.348.549
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	74.039.304	6.697.836	184.837	–	80.921.977
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.257.323	–	–	1.257.323
Optionen	278.855	277.650	1.063.034	–	1.619.539
Terminkontrakte (Forwards)	216.025.535	34.299.941	–	–	250.325.476
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	216.304.390	35.834.914	1.063.034	–	253.202.338
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	378.864	–	–	–	378.864
Sonstige Verbindlichkeiten	2.481.664	–	–	–	2.481.664
Einlösbare, partizipierende Anteile	346.537.616	–	–	–	346.537.616
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	565.702.534	35.834.914	1.063.034	–	602.600.482
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	369.518.407	158.588.346	–	–	528.106.753
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	369.518.407	158.588.346	–	–	528.106.753
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	368.851	–	–	–	368.851
Sonstige Verbindlichkeiten	669.277	–	–	–	669.277
Einlösbare, partizipierende Anteile	535.281.260	–	–	–	535.281.260
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	905.837.795	158.588.346	–	–	1.064.426.141

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	2.134.557	1.228.732	–	–	3.363.289
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.134.557	1.228.732	–	–	3.363.289
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	6.344	–	–	–	6.344
Einlösbare, partizipierende Anteile	25.829.316	–	–	–	25.829.316
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	27.970.217	1.228.732	–	–	29.198.949
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Terminkontrakte (Forwards)	7.363.504.467	–	–	–	7.363.504.467
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	7.363.504.467	–	–	–	7.363.504.467
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	22.406.460	–	–	–	22.406.460
Sonstige Verbindlichkeiten	46.061.021	–	–	–	46.061.021
Einlösbare, partizipierende Anteile	23.358.895.122	–	–	–	23.358.895.122
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	30.790.867.070	–	–	–	30.790.867.070
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	16.030.824	–	–	–	16.030.824
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.030.824	–	–	–	16.030.824
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	53	–	–	–	53
Antizipative Passiva	1.357.776	–	–	–	1.357.776
Sonstige Verbindlichkeiten	452.202	–	–	–	452.202
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.151.824.392	–	–	–	1.151.824.392
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.169.665.247	–	–	–	1.169.665.247
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	30.375.993	–	–	–	30.375.993
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	30.375.993	–	–	–	30.375.993
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	605.116	–	–	–	605.116
Sonstige Verbindlichkeiten	819.527	–	–	–	819.527
Einlösbare, partizipierende Anteile	463.291.956	–	–	–	463.291.956
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	495.092.592	–	–	–	495.092.592

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	70.372	–	–	–	70.372
Sonstige Verbindlichkeiten	71.564	–	–	–	71.564
Einlösbare, partizipierende Anteile	43.187.140	–	–	–	43.187.140
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	43.329.076	–	–	–	43.329.076
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	125.689	–	–	–	125.689
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	125.689	–	–	–	125.689
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	33.622	–	–	–	33.622
Einlösbare, partizipierende Anteile	23.206.685	–	–	–	23.206.685
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	23.365.996	–	–	–	23.365.996
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	63.005.261	102.835.856	–	–	165.841.117
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	63.005.261	102.835.856	–	–	165.841.117
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	212.339	–	–	–	212.339
Antizipative Passiva	185.221	–	–	–	185.221
Sonstige Verbindlichkeiten	13.064.430	–	–	–	13.064.430
Einlösbare, partizipierende Anteile	333.190.402	–	–	–	333.190.402
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	409.657.654	102.835.856	–	–	512.493.510
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	26.596	21.853.280	–	–	21.879.876
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	26.596	21.853.280	–	–	21.879.876
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	132.226	–	–	–	132.226
Antizipative Passiva	456.538	–	–	–	456.538
Sonstige Verbindlichkeiten	438	–	–	–	438
Einlösbare, partizipierende Anteile	393.085.139	–	–	–	393.085.139
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	393.700.937	21.853.280	–	–	415.554.217

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 2022	Gesamt
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	294.152	–	–	294.152
Optionen	54.985	–	266.784	–	321.769
Terminkontrakte (Forwards)	6.513.227	11.919.366	–	–	18.432.593
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.568.212	12.213.518	266.784	–	19.048.514

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	127.998	–	–	–	127.998
Antizipative Passiva	105.067	–	–	–	105.067
Sonstige Verbindlichkeiten	7.035	–	–	–	7.035
Einlösbare, partizipierende Anteile	87.957.570	–	–	–	87.957.570
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	94.765.882	12.213.518	266.784	–	107.246.184

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	51.598	–	–	51.598
Optionen	75.240	92.695	–	–	167.935
Swaps	–	–	–	135.318	135.318
Terminkontrakte (Forwards)	132.919.995	–	–	–	132.919.995
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	132.995.235	144.293	–	135.318	133.274.846

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	1.173.514	–	–	–	1.173.514
Margen auf Derivatkontrakte	6	–	–	–	6
Antizipative Passiva	80.339	–	–	–	80.339
Sonstige Verbindlichkeiten	58.410	–	–	–	58.410
Einlösbare, partizipierende Anteile	80.272.370	–	–	–	80.272.370
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	214.579.874	144.293	–	135.318	214.859.485

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	20.026.979	–	–	–	20.026.979
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	20.026.979	–	–	–	20.026.979

Verbindlichkeiten

Antizipative Passiva	322.601	–	–	–	322.601
Sonstige Verbindlichkeiten	2.882.079	–	–	–	2.882.079
Einlösbare, partizipierende Anteile	356.717.532	–	–	–	356.717.532
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	379.949.191	–	–	–	379.949.191

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 2022	Gesamt
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	16.945.393	–	–	–	16.945.393
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.945.393	–	–	–	16.945.393
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	570.952	–	–	–	570.952
Sonstige Verbindlichkeiten	277.460	–	–	–	277.460
Einlösbare, partizipierende Anteile	890.378.161	–	–	–	890.378.161
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	908.171.966	–	–	–	908.171.966
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	2.446.524	–	–	2.446.524
Optionen	–	302.166	–	–	302.166
Terminkontrakte (Forwards)	1.111.940	–	–	–	1.111.940
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.111.940	2.748.690	–	–	3.860.630
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	838.858	–	–	–	838.858
Antizipative Passiva	506.015	–	–	–	506.015
Sonstige Verbindlichkeiten	1.937.820	–	–	–	1.937.820
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.009.263.725	–	–	–	1.009.263.725
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.013.658.358	2.748.690	–	–	1.016.407.048
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	37.543	–	–	37.543
Terminkontrakte (Forwards)	56.668	–	–	–	56.668
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	56.668	37.543	–	–	94.211
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	83.864	–	–	–	83.864
Antizipative Passiva	19.290	–	–	–	19.290
Sonstige Verbindlichkeiten	17.429	–	–	–	17.429
Einlösbare, partizipierende Anteile	25.869.822	–	–	–	25.869.822
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	26.047.073	37.543	–	–	26.084.616

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

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 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	1	3
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	4	4
BNY Mellon Asian Income Fund	2	2
BNY Mellon Asian Opportunities Fund	2	1
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	4	1
BNY Mellon Brazil Equity Fund	3	1
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	1	1
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	4	3
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	2	4
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	3	3
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	4	2
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	1	2
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	3	4
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	3	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	3	3
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	1	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	1	1
BNY Mellon Euroland Bond Fund	2	2
BNY Mellon European Credit Fund	1	1
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Food Innovation Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Future Earth Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Future Life Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Global Bond Fund	4	3
BNY Mellon Global Credit Fund	4	2
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	4	3
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund	3	3
BNY Mellon Global Equity Income Fund	4	1
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	4	3
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	1	2
BNY Mellon Global Leaders Fund	3	4
BNY Mellon Global Opportunities Fund	2	2
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	2	1
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	2	2
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	2	3
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	1	1
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	1	1
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	2	3
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	2	1
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	1	1
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	2	1
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund*	k. A.	1
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	3	4
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	1	1
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*	1	1

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	3	3
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	1	1
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	3	4
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	3	4
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*	2	k. A.
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	3	2
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund	2	1

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

ANZAHL DER ANTEILSINHABER

Die Gesellschaft hatte am Ende des aktuellen Geschäftsjahres und des vorangegangenen 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 Anteilsinhaber unterliegen. Das Ziel der Fonds bei der Kapitalverwaltung besteht darin, seine Fähigkeit zur Unternehmensfortführung zu bewahren, um Erträge für die Anteilsinhaber und Vorteile für sonstige Interessengruppen zu liefern und eine solide Kapitalbasis zu erhalten und so die Entwicklung der Anlagetätigkeit der Fonds zu unterstützen.

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Die in Stufe 3 eingestuften 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 2023 bewertet werden.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	12.762.503	208.758.938	–	221.521.441
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	19.514.034	–	19.514.034
	Credit Default Swaps	–	1.367.500	–	1.367.500
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.942.977	–	4.942.977
	Futures	3.012.146	–	–	3.012.146
	Zinsswaps	–	5.402.639	–	5.402.639
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	16.320.122	921.583	17.241.705
	Optionen	–	18.023	–	18.023
	Total Return Swaps	–	492.970	–	492.970
	Finanzielle Vermögenswerte	15.774.649	256.817.203	921.583	273.513.435
	Credit Default Swaps	–	(4.071.099)	–	(4.071.099)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(6.580.113)	–	(6.580.113)
	Futures	(6.392.397)	–	–	(6.392.397)
	Zinsswaps	–	(1.434.617)	–	(1.434.617)
	Optionen	–	(43.833)	–	(43.833)
	Total Return Swaps	–	(3.208.824)	–	(3.208.824)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(6.392.397)	(15.338.486)	–	(21.730.883)
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	11.114.148	11.980.863	–	23.095.011
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.213.024	–	1.213.024
	Terminkontrakte (Forwards)	–	153.062	–	153.062
	Futures	5.951	–	–	5.951
	Total Return Swaps	–	198.736	–	198.736
	Finanzielle Vermögenswerte	11.120.099	13.545.685	–	24.665.784
	Credit Default Swaps	–	(645.574)	–	(645.574)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.103)	–	(1.103)
	Futures	(226.228)	–	–	(226.228)
	Total Return Swaps	–	(64.378)	–	(64.378)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(226.228)	(711.055)	–	(937.283)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	23.568.397	5.322.628	–	28.891.025
	Einlagezertifikate	10.841.107	–	–	10.841.107
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	6.126.086	–	6.126.086
	Commercial Paper	–	19.060.597	–	19.060.597
	Aktien-Swaps	–	305.858	–	305.858
	Terminkontrakte (Forwards)	–	203.879	–	203.879
	Total Return Swaps	–	7.582.410	–	7.582.410
	Finanzielle Vermögenswerte	34.409.504	38.601.458	–	73.010.962
	Aktien-Swaps	–	(6.064.496)	–	(6.064.496)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(447.135)	–	(447.135)
	Futures	(151.101)	–	–	(151.101)
	Total Return Swaps	–	(288.342)	–	(288.342)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(151.101)	(6.799.973)	–	(6.951.074)
BNY Mellon Asian Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	26.821.094	2.505.619	–	29.326.713
	Finanzielle Vermögenswerte	26.821.094	2.505.619	–	29.326.713
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	35.678.858	–	–	35.678.858
	Finanzielle Vermögenswerte	35.678.858	–	–	35.678.858
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	35.048.185	–	–	35.048.185
	Terminkontrakte (Forwards)	–	469.249	–	469.249
	Finanzielle Vermögenswerte	35.048.185	469.249	–	35.517.434
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(6.437)	–	(6.437)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(6.437)	–	(6.437)
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	36.514.131	5.752.601	–	42.266.732
	Terminkontrakte (Forwards)	–	85.682	–	85.682
	Finanzielle Vermögenswerte	36.514.131	5.838.283	–	42.352.414
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.388)	–	(3.388)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.388)	–	(3.388)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	23.740.707	–	–	23.740.707
	Credit Default Swaps	–	216.043	–	216.043
	Aktien-Swaps	–	166.243	–	166.243
	Terminkontrakte (Forwards)	–	175.806	–	175.806
	Futures	431.727	–	–	431.727
	Finanzielle Vermögenswerte	24.172.434	558.092	–	24.730.526
	Credit Default Swaps	–	(151.510)	–	(151.510)
	Aktien-Swaps	–	(400.853)	–	(400.853)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(166.325)	–	(166.325)
	Futures	(475.439)	–	–	(475.439)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(475.439)	(718.688)	–	(1.194.127)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	17.817.573	–	–	17.817.573
	Aktien	199.970.707	–	–	199.970.707
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.687	–	1.687
	Futures	457.572	–	–	457.572
	Optionen	940.950	–	–	940.950
	Finanzielle Vermögenswerte	219.186.802	1.687	–	219.188.489
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(6)	–	(6)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(6)	–	(6)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	208.800.464	–	208.800.464
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.968.548	–	3.968.548
	Futures	166	–	–	166
	Finanzielle Vermögenswerte	166	212.769.012	–	212.769.178
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.133.320)	–	(1.133.320)
	Futures	(9)	–	–	(9)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(9)	(1.133.320)	–	(1.133.329)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	71.869.799	–	71.869.799
	Credit Default Swaps	–	19.397	–	19.397
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.540.720	–	1.540.720
	Futures	287.984	–	–	287.984
	Finanzielle Vermögenswerte	287.984	73.429.916	–	73.717.900
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(495.643)	–	(495.643)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Forts.

	USD	USD	USD	USD
Futures	(195.100)	–	–	(195.100)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(195.100)	(495.643)	–	(690.743)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	788.406.193	–	788.406.193
Terminkontrakte (Forwards)	–	7.946.106	–	7.946.106
Futures	165.012	–	–	165.012
Finanzielle Vermögenswerte	165.012	796.352.299	–	796.517.311
Terminkontrakte (Forwards)	–	(20.473)	–	(20.473)
Futures	(4)	–	–	(4)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(4)	(20.473)	–	(20.477)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	1.419.592.807	–	1.419.592.807
Terminkontrakte (Forwards)	–	15.203.497	–	15.203.497
Futures	1.338	–	–	1.338
Finanzielle Vermögenswerte	1.338	1.434.796.304	–	1.434.797.642
Terminkontrakte (Forwards)	–	(158.760)	–	(158.760)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(158.760)	–	(158.760)

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	8.890.470	257.235.707	–	266.126.177
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	4.685.000	–	4.685.000
Terminkontrakte (Forwards)	–	3.465.182	–	3.465.182
Finanzielle Vermögenswerte	8.890.470	265.385.889	–	274.276.359
Terminkontrakte (Forwards)	–	(867.508)	–	(867.508)
Futures	(341.085)	–	–	(341.085)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(341.085)	(867.508)	–	(1.208.593)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	2.210.611	20.716.809	–	22.927.420
Terminkontrakte (Forwards)	–	11.746	–	11.746
Futures	231.801	–	–	231.801
Finanzielle Vermögenswerte	2.442.412	20.728.555	–	23.170.967
Terminkontrakte (Forwards)	–	(38.471)	–	(38.471)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Forts.					
		USD	USD	USD	USD
	Futures	(40.407)	–	–	(40.407)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(40.407)	(38.471)	–	(78.878)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	27.672.900	–	27.672.900
	Terminkontrakte (Forwards)	–	555.293	–	555.293
	Finanzielle Vermögenswerte	–	28.228.193	–	28.228.193
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(329.474)	–	(329.474)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(329.474)	–	(329.474)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	1.352.119	20.866.372	–	22.218.491
	Terminkontrakte (Forwards)	–	350.030	–	350.030
	Futures	96.294	–	–	96.294
	Finanzielle Vermögenswerte	1.448.413	21.216.402	–	22.664.815
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(293.362)	–	(293.362)
	Futures	(12.012)	–	–	(12.012)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(12.012)	(293.362)	–	(305.374)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	443.062	25.806.729	–	26.249.791
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.554.238	–	2.554.238
	Terminkontrakte (Forwards)	–	753.322	–	753.322
	Futures	252.339	–	–	252.339
	Finanzielle Vermögenswerte	695.401	29.114.289	–	29.809.690
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(435.811)	–	(435.811)
	Futures	(21.687)	–	–	(21.687)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(21.687)	(435.811)	–	(457.498)
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	25.038.467	148.850.555	–	173.889.022
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.345.587	–	2.345.587
	Terminkontrakte (Forwards)	–	263.162	–	263.162
	Futures	1.187.842	–	–	1.187.842
	Zinsswaps	–	1.108.919	–	1.108.919
	Finanzielle Vermögenswerte	26.226.309	152.568.223	–	178.794.532
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(27.826)	–	(27.826)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Futures	(1.305.355)	–	–	(1.305.355)
	Zinsswaps	–	(174.375)	–	(174.375)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.305.355)	(202.201)	–	(1.507.556)
BNY Mellon European Credit Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	570.621	55.268.749	–	55.839.370
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.349.380	–	1.349.380
	Credit Default Swaps	–	106.853	–	106.853
	Terminkontrakte (Forwards)	–	55.225	–	55.225
	Futures	4.574	–	–	4.574
	Finanzielle Vermögenswerte	575.195	56.780.207	–	57.355.402
	Credit Default Swaps	–	(106.853)	–	(106.853)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(11.878)	–	(11.878)
	Futures	(103.192)	–	–	(103.192)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(103.192)	(118.731)	–	(221.923)
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund*					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	26.155.553	620.789	26.776.342
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.317.282	–	1.317.282
	Credit Default Swaps	–	15.621	–	15.621
	Terminkontrakte (Forwards)	–	54.658	–	54.658
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	2.962.666	–	2.962.666
	Finanzielle Vermögenswerte	–	30.505.780	620.789	31.126.569
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(131.197)	–	(131.197)
	Zinsswaps	–	(264.588)	–	(264.588)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(395.785)	–	(395.785)
BNY Mellon Global Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	172.415.476	303.430.552	–	475.846.028
	Terminkontrakte (Forwards)	–	9.533.527	–	9.533.527
	Futures	1.787.205	–	–	1.787.205
	Optionen	139.766	–	–	139.766
	Finanzielle Vermögenswerte	174.342.447	312.964.079	–	487.306.526
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(12.193.375)	–	(12.193.375)
	Futures	(1.881.824)	–	–	(1.881.824)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.881.824)	(12.193.375)	–	(14.075.199)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Credit Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	184.532.580	718.363.863	–	902.896.443
	Organismen für gemeinsame Anlagen	77.342.549	–	–	77.342.549
	Credit Default Swaps	–	6.258.930	–	6.258.930
	Terminkontrakte (Forwards)	–	12.944.059	–	12.944.059
	Futures	2.183.148	–	–	2.183.148
	Zinsswaps	–	338.311	–	338.311
	Optionen	–	13.743	–	13.743
	Total Return Swaps	–	4.178.144	–	4.178.144
	Finanzielle Vermögenswerte	264.058.277	742.097.050	–	1.006.155.327
	Credit Default Swaps	–	(9.461.735)	–	(9.461.735)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(9.074.585)	–	(9.074.585)
	Futures	(3.701.085)	–	–	(3.701.085)
	Zinsswaps	–	(27.325)	–	(27.325)
	Optionen	–	(57.146)	–	(57.146)
	Total Return Swaps	–	(794.718)	–	(794.718)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.701.085)	(19.415.509)	–	(23.116.594)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	30.079.098	128.090.346	–	158.169.444
	Organismen für gemeinsame Anlagen	10.994.630	5.126.696	–	16.121.326
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.219.834	–	5.219.834
	Futures	890.224	–	–	890.224
	Optionen	45.391	–	–	45.391
	Finanzielle Vermögenswerte	42.009.343	138.436.876	–	180.446.219
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(7.309.334)	–	(7.309.334)
	Futures	(1.980.425)	–	–	(1.980.425)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.980.425)	(7.309.334)	–	(9.289.759)
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	21.124.414	–	–	21.124.414
	Terminkontrakte (Forwards)	–	21.529	–	21.529
	Finanzielle Vermögenswerte	21.124.414	21.529	–	21.145.943
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(218)	–	(218)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(218)	–	(218)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	419.005.929	12.362.031	–	431.367.960
	Terminkontrakte (Forwards)	–	421.153	–	421.153
	Finanzielle Vermögenswerte	419.005.929	12.783.184	–	431.789.113
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.573)	–	(3.573)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.573)	–	(3.573)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	109.954.685	–	109.954.685
	Aktien	13.713	–	–	13.713
	Terminkontrakte (Forwards)	–	977.638	–	977.638
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	1.695.020	–	1.695.020
	Finanzielle Vermögenswerte	13.713	112.627.343	–	112.641.056
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(354.649)	–	(354.649)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(354.649)	–	(354.649)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	94.720.703	–	–	94.720.703
	Terminkontrakte (Forwards)	–	376.927	–	376.927
	Finanzielle Vermögenswerte	94.720.703	376.927	–	95.097.630
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(8.536)	–	(8.536)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(8.536)	–	(8.536)
BNY Mellon Global Leaders Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	67.768.309	–	–	67.768.309
	Terminkontrakte (Forwards)	–	49.129	–	49.129
	Finanzielle Vermögenswerte	67.768.309	49.129	–	67.817.438
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.564)	–	(4.564)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(4.564)	–	(4.564)
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	30.131.610	–	–	30.131.610
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.519	–	7.519
	Finanzielle Vermögenswerte	30.131.610	7.519	–	30.139.129
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(6)	–	(6)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(6)	–	(6)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	229.308.042	203.180.308	175.246	432.663.596
	Organismen für gemeinsame Anlagen	15.212.508	29.258.134	–	44.470.642
	Aktien	502.910.216	–	–	502.910.216
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	61.018.855	–	61.018.855
	Börsengehandelte Rohstoffe	16.422.634	–	–	16.422.634
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	4.935.120	–	–	4.935.120
	Terminkontrakte (Forwards)	–	14.876.438	–	14.876.438
	Futures	3.822.453	–	–	3.822.453
	Optionen	18.455.072	2.438.973	–	20.894.045
	P-Notes	–	6.168.698	–	6.168.698
	Optionsscheine	–	109.726.198	–	109.726.198
	Finanzielle Vermögenswerte	791.066.045	426.667.604	175.246	1.217.908.895
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	(3.491.894)	–	–	(3.491.894)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.894.675)	–	(4.894.675)
	Futures	(343.300)	–	–	(343.300)
	Optionen	(10.053.481)	(1.077.458)	–	(11.130.939)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(13.888.675)	(5.972.133)	–	(19.860.808)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	9.827.985	5.007.650	–	14.835.635
	Organismen für gemeinsame Anlagen	485.357	852.489	–	1.337.846
	Aktien	16.116.242	–	–	16.116.242
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.952.835	–	1.952.835
	Börsengehandelte Rohstoffe	526.140	–	–	526.140
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	162.514	–	–	162.514
	Terminkontrakte (Forwards)	–	420.606	–	420.606
	Futures	133.478	–	–	133.478
	Optionen	590.904	73.264	–	664.168
	P-Notes	–	214.821	–	214.821
	Optionsscheine	–	3.540.357	–	3.540.357
	Finanzielle Vermögenswerte	27.842.620	12.062.022	–	39.904.642
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	(114.959)	–	–	(114.959)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(87.423)	–	(87.423)
	Futures	(11.293)	–	–	(11.293)
	Optionen	(322.851)	(32.366)	–	(355.217)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(449.103)	(119.789)	–	(568.892)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	51.684.536	32.499.856	28.635	84.213.027
	Organismen für gemeinsame Anlagen	2.779.587	4.616.247	–	7.395.834
	Aktien	91.667.845	–	–	91.667.845
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	11.222.943	–	11.222.943
	Börsengehandelte Rohstoffe	3.093.582	–	–	3.093.582
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	937.040	–	–	937.040
	Terminkontrakte (Forwards)	–	735.250	–	735.250
	Futures	720.098	–	–	720.098
	Optionen	3.590.072	491.775	–	4.081.847
	P-Notes	–	1.188.862	–	1.188.862
	Optionsscheine	–	20.093.714	–	20.093.714
	Finanzielle Vermögenswerte	154.472.760	70.848.647	28.635	225.350.042
	Börsengehandelte Rohstoffoptionen	(663.000)	–	–	(663.000)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.575.014)	–	(4.575.014)
	Futures	(65.341)	–	–	(65.341)
	Optionen	(1.925.514)	(217.250)	–	(2.142.764)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.653.855)	(4.792.264)	–	(7.446.119)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	723.701.332	–	723.701.332
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	18.330.775	–	18.330.775
	Credit Default Swaps	–	153.283	–	153.283
	Terminkontrakte (Forwards)	–	12.673.474	–	12.673.474
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	9.450.696	–	9.450.696
	Finanzielle Vermögenswerte	–	764.309.560	–	764.309.560
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(14.541.434)	–	(14.541.434)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(14.541.434)	–	(14.541.434)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	5.194.834	2.300.295	–	7.495.129
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	506.797	–	506.797
	Aktien	17.888.002	–	–	17.888.002
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.003.989	–	1.003.989
	Börsengehandelte Rohstoffe	601.476	–	–	601.476
	Terminkontrakte (Forwards)	–	658.916	–	658.916
	Finanzielle Vermögenswerte	23.684.312	4.469.997	–	28.154.309
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(88.838)	–	(88.838)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(88.838)	–	(88.838)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
		JPY	JPY	JPY	JPY
	Aktien	17.366.092.000	–	–	17.366.092.000
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.287.476	–	4.287.476
	Finanzielle Vermögenswerte	17.366.092.000	4.287.476	–	17.370.379.476
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(159.429.964)	–	(159.429.964)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(159.429.964)	–	(159.429.964)
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund*					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	20.537.937	–	–	20.537.937
	Finanzielle Vermögenswerte	20.537.937	–	–	20.537.937
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	1.442.267.513	–	–	1.442.267.513
	Terminkontrakte (Forwards)	–	17.133	–	17.133
	Finanzielle Vermögenswerte	1.442.267.513	17.133	–	1.442.284.646
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(298.865)	–	(298.865)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(298.865)	–	(298.865)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	411.027.688	–	–	411.027.688
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.020.241	–	4.020.241
	Finanzielle Vermögenswerte	411.027.688	4.020.241	–	415.047.929
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(63.717)	–	(63.717)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(63.717)	–	(63.717)
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	47.263.865	244.530	–	47.508.395
	Finanzielle Vermögenswerte	47.263.865	244.530	–	47.508.395
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	55.264.176	266.140.870	–	321.405.046
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.956.116	–	7.956.116
	Futures	1.690.990	–	–	1.690.990
	Optionen	84.423	–	–	84.423
	Finanzielle Vermögenswerte	57.039.589	274.096.986	–	331.136.575
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(7.250.684)	–	(7.250.684)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts.

	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	(3.794.690)	–	–	(3.794.690)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.794.690)	(7.250.684)	–	(11.045.374)

BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund

	USD	USD	USD	USD
Aktien	10.687.036	–	–	10.687.036
Terminkontrakte (Forwards)	–	1.793	–	1.793
Finanzielle Vermögenswerte	10.687.036	1.793	–	10.688.829
Terminkontrakte (Forwards)	–	(31)	–	(31)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(31)	–	(31)

BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*

	USD	USD	USD	USD
Aktien	432.751.590	–	–	432.751.590
Finanzielle Vermögenswerte	432.751.590	–	–	432.751.590

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	2.487.429	2.627.268	–	5.114.697
Organismen für gemeinsame Anlagen	407.371	643.876	–	1.051.247
Aktien	6.893.233	–	–	6.893.233
Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	647.788	–	647.788
Börsengehandelte Rohstoffe	752.570	–	–	752.570
Börsengehandelte Rohstoffoptionen	71.005	–	–	71.005
Terminkontrakte (Forwards)	–	332.221	–	332.221
Futures	31.236	–	–	31.236
Optionen	249.714	33.718	–	283.432
P-Notes	–	92.066	–	92.066
Optionsscheine	–	1.509.718	–	1.509.718
Finanzielle Vermögenswerte	10.892.558	5.886.655	–	16.779.213
Börsengehandelte Rohstoffoptionen	(50.208)	–	–	(50.208)
Terminkontrakte (Forwards)	–	(150.856)	–	(150.856)
Futures	(4.487)	–	–	(4.487)
Optionen	(137.368)	(14.896)	–	(152.264)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(192.063)	(165.752)	–	(357.815)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	3.823.991	80.507.863	–	84.331.854
	Organismen für gemeinsame Anlagen	5.283.804	–	–	5.283.804
	Credit Default Swaps	–	756.979	–	756.979
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.534.086	–	1.534.086
	Futures	6.008	–	–	6.008
	Zinsswaps	–	179.392	–	179.392
	Optionen	–	3.654	–	3.654
	Total Return Swaps	–	502.139	–	502.139
	Finanzielle Vermögenswerte	9.113.803	83.484.113	–	92.597.916
	Credit Default Swaps	–	(830.110)	–	(830.110)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.490.085)	–	(1.490.085)
	Futures	(764.360)	–	–	(764.360)
	Zinsswaps	–	(50.944)	–	(50.944)
	Optionen	–	(8.372)	–	(8.372)
	Total Return Swaps	–	(83.769)	–	(83.769)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(764.360)	(2.463.280)	–	(3.227.640)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	402.243.881	–	–	402.243.881
	Terminkontrakte (Forwards)	–	433.056	–	433.056
	Finanzielle Vermögenswerte	402.243.881	433.056	–	402.676.937
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(7.227)	–	(7.227)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(7.227)	–	(7.227)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	782.179.775	–	782.179.775
	Terminkontrakte (Forwards)	–	16.790.816	–	16.790.816
	Finanzielle Vermögenswerte	–	798.970.591	–	798.970.591
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(102.853)	–	(102.853)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(102.853)	–	(102.853)
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	56.019.919	–	56.019.919
	Terminkontrakte (Forwards)	–	19.803	–	19.803
	Futures	371.569	–	–	371.569
	Finanzielle Vermögenswerte	371.569	56.039.722	–	56.411.291
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(704.216)	–	(704.216)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2023

Responsible Horizons EM Debt Impact Fund* Forts.

	USD	USD	USD	USD
Futures	(297.759)	–	–	(297.759)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(297.759)	(704.216)	–	(1.001.975)

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	–	1.062.741.757	–	1.062.741.757
Credit Default Swaps	–	2.030.204	–	2.030.204
Terminkontrakte (Forwards)	–	381.116	–	381.116
Futures	42.156	–	–	42.156
Total Return Swaps	–	1.759.489	–	1.759.489
Finanzielle Vermögenswerte	42.156	1.066.912.566	–	1.066.954.722
Credit Default Swaps	–	(4.750.096)	–	(4.750.096)
Terminkontrakte (Forwards)	–	(26.854)	–	(26.854)
Futures	(3.150.027)	–	–	(3.150.027)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.150.027)	(4.776.950)	–	(7.926.977)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	693.451	33.649.530	–	34.342.981
Terminkontrakte (Forwards)	–	37.745	–	37.745
Futures	16.433	–	–	16.433
Finanzielle Vermögenswerte	709.884	33.687.275	–	34.397.159
Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.165)	–	(2.165)
Futures	(76.772)	–	–	(76.772)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(76.772)	(2.165)	–	(78.937)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2022 bewertet wurden:

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	112.858.557	134.471.741	189.783	247.520.081
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	30.778.339	–	30.778.339
	Credit Default Swaps	–	1.585.390	–	1.585.390
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.245.520	–	4.245.520
	Futures	8.645.531	–	–	8.645.531
	Zinsswaps	–	307.210	–	307.210
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	17.438.646	1.313.810	18.752.456
	Optionen	–	203.611	–	203.611
	Total Return Swaps	–	721.117	–	721.117
	Finanzielle Vermögenswerte	121.504.088	189.751.574	1.503.593	312.759.255
	Credit Default Swaps	–	(5.123.041)	–	(5.123.041)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.505.261)	–	(10.505.261)
	Futures	(3.639.286)	–	–	(3.639.286)
	Zinsswaps	–	(5.418.137)	–	(5.418.137)
	Optionen	–	(695.235)	–	(695.235)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.639.286)	(21.741.674)	–	(25.380.960)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	27.956.268	–	–	27.956.268
	Einlagenzertifikate	49.728.405	–	–	49.728.405
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	14.879.864	–	14.879.864
	Commercial Paper	–	23.876.979	–	23.876.979
	Aktien	4.319.140	–	23.683	4.342.823
	Aktienindex-Swaps	–	699.487	–	699.487
	Aktien-Swaps	–	7.644.714	–	7.644.714
	Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)	–	8.531.753	–	8.531.753
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.901.979	–	3.901.979
	Futures	229.901	–	–	229.901
	Finanzielle Vermögenswerte	82.233.714	59.534.776	23.683	141.792.173
	Aktienindex-Swaps	–	(986.965)	–	(986.965)
	Aktien-Swaps	–	(4.375.823)	–	(4.375.823)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(151.729)	–	(151.729)
	Futures	(48.982)	–	–	(48.982)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(48.982)	(5.514.517)	–	(5.563.499)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	20.607.725	41.007.219	–	61.614.944
	Einlagenzertifikate	8.982.252	–	–	8.982.252
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	9.456.426	–	9.456.426
	Commercial Paper	–	35.417.576	–	35.417.576
	Aktien-Swaps	–	6.107.176	–	6.107.176
	Terminkontrakte (Forwards)	–	54.537	–	54.537
	Futures	242.348	–	–	242.348
	Vorzugsanleihen	–	775.405	–	775.405
	Total Return Swaps	–	1.750.005	–	1.750.005
	Finanzielle Vermögenswerte	29.832.325	94.568.344	–	124.400.669
	Credit Default Swaps	–	(5.441)	–	(5.441)
	Aktien-Swaps	–	(1.571.228)	–	(1.571.228)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.909.441)	–	(1.909.441)
	Futures	(14.768)	–	–	(14.768)
	Total Return Swaps	–	(7.250.698)	–	(7.250.698)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(14.768)	(10.736.808)	–	(10.751.576)
BNY Mellon Asian Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	243.212	–	–	243.212
	Aktien	16.474.986	1.699.324	–	18.174.310
	Finanzielle Vermögenswerte	16.718.198	1.699.324	–	18.417.522
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	42.360.317	–	–	42.360.317
	Finanzielle Vermögenswerte	42.360.317	–	–	42.360.317
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	38.837.719	–	–	38.837.719
	Terminkontrakte (Forwards)	–	206.672	–	206.672
	Finanzielle Vermögenswerte	38.837.719	206.672	–	39.044.391
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(13.091)	–	(13.091)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(13.091)	–	(13.091)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	32.841.492	5.956.343	–	38.797.835
	Terminkontrakte (Forwards)	–	26.041	–	26.041
	Finanzielle Vermögenswerte	32.841.492	5.982.384	–	38.823.876
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.058)	–	(1.058)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.058)	–	(1.058)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	20.968.150	–	–	20.968.150
	Credit Default Swaps	–	15.440	–	15.440
	Aktien-Swaps	–	119.577	–	119.577
	Terminkontrakte (Forwards)	–	202.904	–	202.904
	Futures	553.131	–	–	553.131
	Finanzielle Vermögenswerte	21.521.281	337.921	–	21.859.202
	Credit Default Swaps	–	(47.527)	–	(47.527)
	Aktien-Swaps	–	(35.659)	–	(35.659)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(201.075)	–	(201.075)
	Futures	(1.080.618)	–	–	(1.080.618)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.080.618)	(284.261)	–	(1.364.879)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	49.486.621	–	–	49.486.621
	Aktien	465.708.480	–	–	465.708.480
	Terminkontrakte (Forwards)	–	812	–	812
	Optionen	603.500	–	–	603.500
	Finanzielle Vermögenswerte	515.798.601	812	–	515.799.413
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(33)	–	(33)
	Futures	(595.325)	–	–	(595.325)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(595.325)	(33)	–	(595.358)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	175.772.867	–	175.772.867
	Credit Default Swaps	–	23.296	–	23.296
	Terminkontrakte (Forwards)	–	785.200	–	785.200
	Finanzielle Vermögenswerte	–	176.581.363	–	176.581.363
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.087.854)	–	(3.087.854)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.087.854)	–	(3.087.854)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	46.015.986	–	46.015.986
	Credit Default Swaps	–	36.702	–	36.702
	Terminkontrakte (Forwards)	–	230.438	–	230.438
	Futures	21.434	–	–	21.434
	Finanzielle Vermögenswerte	21.434	46.283.126	–	46.304.560
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(716.228)	–	(716.228)
	Futures	(24.305)	–	–	(24.305)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(24.305)	(716.228)	–	(740.533)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	925.376.833	1.010.765	926.387.598
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.226.961	–	1.226.961
	Futures	63.206	–	–	63.206
	Finanzielle Vermögenswerte	63.206	926.603.794	1.010.765	927.677.765
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.309.099)	–	(3.309.099)
	Futures	(110.805)	–	–	(110.805)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(110.805)	(3.309.099)	–	(3.419.904)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	1.374.551.131	127.832	1.374.678.963
	Credit Default Swaps	–	153.178	–	153.178
	Aktien	5.755	–	–	5.755
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.655.050	–	4.655.050
	Finanzielle Vermögenswerte	5.755	1.379.359.359	127.832	1.379.492.946
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(3.999.065)	–	(3.999.065)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.999.065)	–	(3.999.065)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	320.690.915	–	320.690.915
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	17.750.000	–	17.750.000
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.845.949	–	1.845.949
	Futures	61.869	–	–	61.869
	Finanzielle Vermögenswerte	61.869	340.286.864	–	340.348.733
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.970.512)	–	(1.970.512)
	Futures	(5.591)	–	–	(5.591)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(5.591)	(1.970.512)	–	(1.976.103)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	21.546.301	–	21.546.301
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.256	–	5.256
	Futures	53.410	–	–	53.410
	Finanzielle Vermögenswerte	53.410	21.551.557	–	21.604.967
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(12.781)	–	(12.781)
	Futures	(10.234)	–	–	(10.234)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(10.234)	(12.781)	–	(23.015)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	23.257.560	233.654	23.491.214
	Terminkontrakte (Forwards)	–	142.171	–	142.171
	Finanzielle Vermögenswerte	–	23.399.731	233.654	23.633.385
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(95.817)	–	(95.817)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(95.817)	–	(95.817)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	22.376.718	182.875	22.559.593
	Terminkontrakte (Forwards)	–	57.037	–	57.037
	Futures	48.405	–	–	48.405
	Finanzielle Vermögenswerte	48.405	22.433.755	182.875	22.665.035
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(81.275)	–	(81.275)
	Futures	(2.363)	–	–	(2.363)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.363)	(81.275)	–	(83.638)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	31.289.952	295.051	31.585.003
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	3.737.054	–	3.737.054
	Terminkontrakte (Forwards)	–	61.556	–	61.556
	Futures	123.744	–	–	123.744
	Finanzielle Vermögenswerte	123.744	35.088.562	295.051	35.507.357
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(844.024)	–	(844.024)
	Futures	(47.614)	–	–	(47.614)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(47.614)	(844.024)	–	(891.638)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	34.914.542	131.093.263	–	166.007.805
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.165.146	–	2.165.146
	Terminkontrakte (Forwards)	–	857.087	–	857.087
	Futures	766.719	–	–	766.719
	Finanzielle Vermögenswerte	35.681.261	134.115.496	–	169.796.757
	Credit Default Swaps	–	(42.467)	–	(42.467)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(86.989)	–	(86.989)
	Futures	(940.665)	–	–	(940.665)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(940.665)	(129.456)	–	(1.070.121)
BNY Mellon European Credit Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	41.102.943	–	41.102.943
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.215.130	–	1.215.130
	Credit Default Swaps	–	36.589	–	36.589
	Terminkontrakte (Forwards)	–	100.878	–	100.878
	Futures	141.369	–	–	141.369
	Optionen	–	20.085	–	20.085
	Finanzielle Vermögenswerte	141.369	42.475.625	–	42.616.994
	Credit Default Swaps	–	(14.684)	–	(14.684)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(11.771)	–	(11.771)
	Futures	(72.043)	–	–	(72.043)
	Optionen	–	(15.904)	–	(15.904)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(72.043)	(42.359)	–	(114.402)
BNY Mellon Food Innovation Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	1.868.610	–	–	1.868.610
	Finanzielle Vermögenswerte	1.868.610	–	–	1.868.610
BNY Mellon Future Earth Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	1.613.275	–	–	1.613.275
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	33.011	–	33.011
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.730	–	2.730
	Finanzielle Vermögenswerte	1.613.275	35.741	–	1.649.016
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(104)	–	(104)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(104)	–	(104)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Future Life Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.038.664	–	–	2.038.664
	Finanzielle Vermögenswerte	2.038.664	–	–	2.038.664
BNY Mellon Global Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	170.486.473	225.199.351	–	395.685.824
	Terminkontrakte (Forwards)	–	9.740.353	–	9.740.353
	Futures	1.538.359	–	–	1.538.359
	Finanzielle Vermögenswerte	172.024.832	234.939.704	–	406.964.536
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(7.331.433)	–	(7.331.433)
	Futures	(92.838)	–	–	(92.838)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(92.838)	(7.331.433)	–	(7.424.271)
BNY Mellon Global Credit Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	107.303.840	253.874.676	–	361.178.516
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	8.241.218	–	8.241.218
	Credit Default Swaps	–	1.804.766	–	1.804.766
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.565.148	–	3.565.148
	Futures	2.219.011	–	–	2.219.011
	Zinsswaps	–	244.045	–	244.045
	Optionen	–	199.158	–	199.158
	Finanzielle Vermögenswerte	109.522.851	267.929.011	–	377.451.862
	Credit Default Swaps	–	(3.373.387)	–	(3.373.387)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.921.723)	–	(1.921.723)
	Futures	(1.212.847)	–	–	(1.212.847)
	Optionen	–	(653.087)	–	(653.087)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.212.847)	(5.948.197)	–	(7.161.044)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	60.769.752	245.461.338	–	306.231.090
	Organismen für gemeinsame Anlagen	9.708.869	9.688.021	–	19.396.890
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.092.971	–	4.092.971
	Futures	1.167.528	–	–	1.167.528
	Finanzielle Vermögenswerte	71.646.149	259.242.330	–	330.888.479
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(8.388.906)	–	(8.388.906)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(8.388.906)	–	(8.388.906)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	34.350.482	–	–	34.350.482
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.967	–	6.967
	Finanzielle Vermögenswerte	34.350.482	6.967	–	34.357.449
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(257)	–	(257)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(257)	–	(257)
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	506.094.524	16.872.825	–	522.967.349
	Terminkontrakte (Forwards)	–	152.005	–	152.005
	Finanzielle Vermögenswerte	506.094.524	17.024.830	–	523.119.354
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.308)	–	(5.308)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(5.308)	–	(5.308)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	104.961.726	–	104.961.726
	Aktien	19.131	–	–	19.131
	Terminkontrakte (Forwards)	–	325.072	–	325.072
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	1.759.120	–	1.759.120
	Finanzielle Vermögenswerte	19.131	107.045.918	–	107.065.049
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(565.872)	–	(565.872)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(565.872)	–	(565.872)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	121.297.674	–	–	121.297.674
	Terminkontrakte (Forwards)	–	169.662	–	169.662
	Finanzielle Vermögenswerte	121.297.674	169.662	–	121.467.336
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(55.727)	–	(55.727)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(55.727)	–	(55.727)
BNY Mellon Global Leaders Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	45.847.495	–	–	45.847.495
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.607	–	6.607
	Finanzielle Vermögenswerte	45.847.495	6.607	–	45.854.102
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(989)	–	(989)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(989)	–	(989)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	26.325.484	–	–	26.325.484
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.548	–	2.548
	Finanzielle Vermögenswerte	26.325.484	2.548	–	26.328.032
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(307)	–	(307)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(307)	–	(307)

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	233.514.794	344.180.481	–	577.695.275
Organismen für gemeinsame Anlagen	62.887.334	34.467.060	–	97.354.394
Aktien	817.886.691	–	–	817.886.691
Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	172.845.094	–	172.845.094
Börsengehandelte Rohstoffe	91.154.512	–	–	91.154.512
Terminkontrakte (Forwards)	–	23.546.268	–	23.546.268
Futures	23.815.255	–	–	23.815.255
Optionen	18.713.558	–	–	18.713.558
P-Notes	–	28.642.266	–	28.642.266
Optionsscheine	–	159.696.576	–	159.696.576
Finanzielle Vermögenswerte	1.247.972.144	763.377.745	–	2.011.349.889
Terminkontrakte (Forwards)	–	(7.204.631)	–	(7.204.631)
Futures	(8.472.229)	–	–	(8.472.229)
Optionen	(9.861.127)	–	–	(9.861.127)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(18.333.356)	(7.204.631)	–	(25.537.987)

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

	GBP	GBP	GBP	GBP
Anleihen	10.004.165	8.557.926	–	18.562.091
Organismen für gemeinsame Anlagen	1.724.581	1.013.925	–	2.738.506
Aktien	22.279.760	–	–	22.279.760
Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	3.976.980	–	3.976.980
Börsengehandelte Rohstoffe	2.643.462	–	–	2.643.462
Terminkontrakte (Forwards)	–	1.037.076	–	1.037.076
Futures	670.945	–	–	670.945
Optionen	538.395	–	–	538.395
P-Notes	–	815.250	–	815.250
Optionsscheine	–	4.114.500	–	4.114.500
Finanzielle Vermögenswerte	37.861.308	19.515.657	–	57.376.965
Terminkontrakte (Forwards)	–	(608.741)	–	(608.741)
Futures	(219.868)	–	–	(219.868)
Optionen	(276.301)	–	–	(276.301)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(496.169)	(608.741)	–	(1.104.910)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	59.622.511	42.562.588	–	102.185.099
	Organismen für gemeinsame Anlagen	10.666.317	4.124.210	–	14.790.527
	Aktien	135.713.306	–	–	135.713.306
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	23.380.605	–	23.380.605
	Börsengehandelte Rohstoffe	15.972.949	–	–	15.972.949
	Terminkontrakte (Forwards)	–	811.455	–	811.455
	Futures	3.968.295	–	–	3.968.295
	Optionen	3.078.593	–	–	3.078.593
	P-Notes	–	8.345.860	–	8.345.860
	Optionsscheine	–	23.917.826	–	23.917.826
	Finanzielle Vermögenswerte	229.021.971	103.142.544	–	332.164.515
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(18.323.199)	–	(18.323.199)
	Futures	(1.257.323)	–	–	(1.257.323)
	Optionen	(1.619.539)	–	–	(1.619.539)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.876.862)	(18.323.199)	–	(21.200.061)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	495.609.216	–	495.609.216
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	21.060.000	–	21.060.000
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.616.361	–	3.616.361
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	10.067.485	–	10.067.485
	Finanzielle Vermögenswerte	–	530.353.062	–	530.353.062
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(28.018.215)	–	(28.018.215)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(28.018.215)	–	(28.018.215)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	5.545.494	2.059.228	–	7.604.722
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	573.205	–	573.205
	Aktien	14.918.457	–	–	14.918.457
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.057.639	–	1.057.639
	Börsengehandelte Rohstoffe	529.735	–	–	529.735
	Terminkontrakte (Forwards)	–	142.246	–	142.246
	Finanzielle Vermögenswerte	20.993.686	3.832.318	–	24.826.004
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(132.984)	–	(132.984)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(132.984)	–	(132.984)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
		JPY	JPY	JPY	JPY
	Aktien	22.922.870.700	–	–	22.922.870.700
	Terminkontrakte (Forwards)	–	7.278.763	–	7.278.763
	Finanzielle Vermögenswerte	22.922.870.700	7.278.763	–	22.930.149.463
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(205.976.575)	–	(205.976.575)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(205.976.575)	–	(205.976.575)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	1.131.284.137	–	–	1.131.284.137
	Terminkontrakte (Forwards)	–	77.797	–	77.797
	Finanzielle Vermögenswerte	1.131.284.137	77.797	–	1.131.361.934
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(163.798)	–	(163.798)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(163.798)	–	(163.798)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	447.361.129	–	–	447.361.129
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.732.480	–	1.732.480
	Finanzielle Vermögenswerte	447.361.129	1.732.480	–	449.093.609
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(309.404)	–	(309.404)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(309.404)	–	(309.404)
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	42.513.027	296.503	–	42.809.530
	Finanzielle Vermögenswerte	42.513.027	296.503	–	42.809.530
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	22.922.291	–	–	22.922.291
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.454	–	3.454
	Finanzielle Vermögenswerte	22.922.291	3.454	–	22.925.745
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.754)	–	(1.754)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.754)	–	(1.754)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	63.480.088	241.141.956	–	304.622.044
	Terminkontrakte (Forwards)	–	14.690.440	–	14.690.440
	Futures	1.150.143	–	–	1.150.143
	Finanzielle Vermögenswerte	64.630.231	255.832.396	–	320.462.627
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.570.305)	–	(2.570.305)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(2.570.305)	–	(2.570.305)
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	377.972.893	3.501.756	–	381.474.649
	Terminkontrakte (Forwards)	–	321.530	–	321.530
	Finanzielle Vermögenswerte	377.972.893	3.823.286	–	381.796.179
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.198.028)	–	(1.198.028)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.198.028)	–	(1.198.028)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	11.795.482	14.716.368	–	26.511.850
	Organismen für gemeinsame Anlagen	47.828	4.498.738	–	4.546.566
	Aktien	32.702.601	–	–	32.702.601
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	5.986.524	–	5.986.524
	Börsengehandelte Rohstoffe	4.068.812	–	–	4.068.812
	Terminkontrakte (Forwards)	–	635.186	–	635.186
	Futures	972.959	–	–	972.959
	Optionen	595.942	–	–	595.942
	P-Notes	–	2.411.345	–	2.411.345
	Optionsscheine	–	4.811.568	–	4.811.568
	Finanzielle Vermögenswerte	50.183.624	33.059.729	–	83.243.353
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(343.366)	–	(343.366)
	Futures	(294.152)	–	–	(294.152)
	Optionen	(321.769)	–	–	(321.769)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(615.921)	(343.366)	–	(959.287)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	12.754.439	65.271.215	489.564	78.515.218
	Credit Default Swaps	–	282.538	–	282.538
	Terminkontrakte (Forwards)	–	149.653	–	149.653
	Futures	1.211.995	–	–	1.211.995
	Optionen	–	133.035	–	133.035
	Finanzielle Vermögenswerte	13.966.434	65.836.441	489.564	80.292.439
	Credit Default Swaps	–	(135.318)	–	(135.318)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.304.824)	–	(2.304.824)
	Futures	(51.598)	–	–	(51.598)
	Optionen	–	(167.935)	–	(167.935)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(51.598)	(2.608.077)	–	(2.659.675)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	330.164.419	–	–	330.164.419
	Terminkontrakte (Forwards)	–	12.209	–	12.209
	Vorzugsanleihen	–	11.269.328	–	11.269.328
	Finanzielle Vermögenswerte	330.164.419	11.281.537	–	341.445.956
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(326.608)	–	(326.608)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(326.608)	–	(326.608)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	850.601.635	–	850.601.635
	Terminkontrakte (Forwards)	–	4.916.513	–	4.916.513
	Finanzielle Vermögenswerte	–	855.518.148	–	855.518.148
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(104.789)	–	(104.789)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(104.789)	–	(104.789)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	977.261.709	–	977.261.709
	Credit Default Swaps	–	678.462	–	678.462
	Terminkontrakte (Forwards)	–	508.510	–	508.510
	Futures	3.176.525	–	–	3.176.525
	Optionen	–	381.608	–	381.608
	Finanzielle Vermögenswerte	3.176.525	978.830.289	–	982.006.814
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(68.756)	–	(68.756)
	Futures	(2.446.524)	–	–	(2.446.524)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2022
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund Forts.					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Optionen	–	(302.166)	–	(302.166)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.446.524)	(370.922)	–	(2.817.446)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen EUR	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR	Gesamt EUR
Anfangssaldo	189.783	1.313.810	1.503.593
Käufe	–	–	–
Verkäufe	–	(387.684)	(387.684)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(189.783)	(3.985)	(193.768)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte Gewinne	–	7.377	7.377
Nicht realisierte Verluste	–	(7.935)	(7.935)
Schlussaldo	–	921.583	921.583

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund*

Einzelheiten	Aktien GBP	Gesamt GBP
Anfangssaldo	23.683	23.683
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 Verluste	(1.219.379)	(1.219.379)
Nicht realisierte Gewinne	1.195.696	1.195.696
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	1.010.765	1.010.765
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(1.010.765)	(1.010.765)
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	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Schlusssaldo	–	–

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	127.832	127.832
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(127.832)	(127.832)
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	–	–
Schlusssaldo	–	–

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	233.654	233.654
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(233.654)	(233.654)
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	–	–
Schlusssaldo	–	–

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	182.875	182.875
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(182.875)	(182.875)
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	–	–
Schlusssaldo	–	–

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	295.051	295.051
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Anleihen USD	Gesamt USD
Einzelheiten		
Übertragungen aus Stufe 3	(295.051)	(295.051)
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	–	–
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Floating Rate Credit Fund

	Anleihen EUR	Gesamt EUR
Einzelheiten		
Anfangssaldo	–	–
Käufe	604.760	604.760
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	16.029	16.029
Schlussaldo	620.789	620.789

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	Anleihen EUR	Gesamt EUR
Einzelheiten		
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	1.142.262	1.142.262
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	(967.016)	(967.016)
Schlussaldo	175.246	175.246

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

	Anleihen USD	Gesamt USD
Einzelheiten		
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	179.896	179.896
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	(151.261)	(151.261)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Schlussaldo	28.635	28.635

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	489.564	489.564
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(489.564)	(489.564)
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	–	–
Schlussaldo	–	–

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen EUR	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR	Gesamt EUR
Anfangssaldo	372.797	2.182.910	2.555.707
Käufe	–	–	–
Verkäufe	(191.318)	(771.682)	(963.000)
Übertragungen in Stufe 3	1.045.561	–	1.045.561
Übertragungen aus Stufe 3	(368.943)	–	(368.943)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte (Verluste)/Gewinne	(366.426)	17.045	(349.381)
Nicht realisierte Verluste	(301.888)	(114.463)	(416.351)
Schlussaldo	189.783	1.313.810	1.503.593

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

Einzelheiten	Aktien GBP	Gesamt GBP
Anfangssaldo	23.683	23.683
Käufe	–	–
Verkäufe	(115)	(115)
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	115	115
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlussaldo	23.683	23.683

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(353.600)	(353.600)
Übertragungen in Stufe 3	1.383.315	1.383.315
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	(13.286)	(13.286)
Nicht realisierte Verluste	(5.664)	(5.664)
Schlusssaldo	1.010.765	1.010.765

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	11.281	11.281
Käufe	34.763	34.763
Verkäufe	(39.520)	(39.520)
Übertragungen in Stufe 3	134.263	134.263
Übertragungen aus Stufe 3	(12.691)	(12.691)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Verluste	(1.042)	(1.042)
Nicht realisierte Gewinne	778	778
Schlusssaldo	127.832	127.832

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(2.480.139)	(2.480.139)
Übertragungen in Stufe 3	5.323.713	5.323.713
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	(3.567.936)	(3.567.936)
Nicht realisierte Gewinne	958.016	958.016
Schlusssaldo	233.654	233.654

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(427.718)	(427.718)
Übertragungen in Stufe 3	1.178.068	1.178.068
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	(333.549)	(333.549)
Nicht realisierte Verluste	(233.926)	(233.926)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Schlussssaldo	182.875	182.875

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(726.566)	(726.566)
Übertragungen in Stufe 3	2.783.626	2.783.626
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	(1.216.076)	(1.216.076)
Nicht realisierte Verluste	(545.933)	(545.933)
Schlussssaldo	295.051	295.051

BNY Mellon European Credit Fund

Einzelheiten	Anleihen EUR	Gesamt EUR
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(139.409)	(139.409)
Übertragungen in Stufe 3	145.535	145.535
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	(6.126)	(6.126)
Schlussssaldo	–	–

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(1.418.318)	(1.418.318)
Übertragungen in Stufe 3	1.603.313	1.603.313
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	(108.614)	(108.614)
Nicht realisierte Verluste	(76.381)	(76.381)
Schlussssaldo	–	–

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund

Einzelheiten	Aktien USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	21.039	21.039
Verkäufe	(67.001)	(67.001)
Übertragungen in Stufe 3	870.050	870.050

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund

Einzelheiten	Aktien USD	Gesamt USD
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	24.109	24.109
Nicht realisierte Verluste	(848.197)	(848.197)
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	1.288.479	1.288.479
Käufe	482.211	482.211
Verkäufe	(1.590.132)	(1.590.132)
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	(167.835)	(167.835)
Nicht realisierte Verluste	(12.723)	(12.723)
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	8.929.100	8.929.100
Käufe	4.613.749	–	4.613.749
Verkäufe	(4.591.985)	(8.906.789)	(13.498.774)
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	(21.764)	(619.371)	(641.135)
Nicht realisierte Gewinne	–	597.060	597.060
Schlussaldo	–	–	–

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

Einzelheiten	Aktien EUR	Gesamt EUR
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(90.372)	(90.372)
Übertragungen in Stufe 3	515.030	515.030
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	21.695	21.695
Nicht realisierte Verluste	(446.353)	(446.353)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

Einzelheiten	Aktien EUR	Gesamt EUR
Schlusssaldo	–	–

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	349.685	349.685
Käufe	464.364	464.364
Verkäufe	(334.796)	(334.796)
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	(15.204)	(15.204)
Nicht realisierte Gewinne	25.515	25.515
Schlusssaldo	489.564	489.564

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	3.160.000	3.160.000
Käufe	–	–
Verkäufe	(3.160.000)	(3.160.000)
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	–	–
Schlusssaldo	–	–

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

Zum 31. Dezember 2023 oder 31. Dezember 2022 bestanden keine Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

18. HAFTUNGSTRENNUNG

Die Gesellschaft macht von den Bestimmungen zur Haftungstrennung in Section 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 IM GESCHÄFTSJAHR

Am 5. Januar 2023 wurde der Nachtrag des BNY Mellon Asian Income Fund aktualisiert, um einer Registrierung in Hongkong Rechnung zu tragen.

Der Responsible Horizons EM Debt Impact Fund wurde am 24. Januar 2023 aufgelegt.

Am 2. Februar 2023 wurde der BNY Mellon Future Food Fund in BNY Mellon Food Innovation Fund umbenannt und modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu berücksichtigen.

Am 2. Februar 2023 wurde Newton Investment Management North America LLC zum Unteranlageverwalter für die folgenden Teilfonds ernannt:

- BNY Mellon Asian Opportunities Fund
- BNY Mellon Global Bond Fund
- BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund
- BNY Mellon Global Equity Income Fund
- BNY Mellon Global Opportunities Fund

Darüber hinaus wurde Newton Investment Management Limited zum Unteranlageverwalter für die folgenden Teilfonds ernannt:

- BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund
- BNY Mellon Mobility Innovation Fund
- BNY Mellon Small Cap Euroland Fund
- BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

Mit Wirkung vom 8. Februar 2023 trat Gerald Rehn als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurück.

Mit Wirkung vom 9. Februar 2023 wurde Sarah Cox zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft bestellt.

Am 23. Februar 2023 wurde der BNY Mellon Global Equity Fund in BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund umbenannt und modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu berücksichtigen.

Am 1. März 2023 löste Newton Investment Management Japan Ltd. BNY Mellon Asset Management Japan Limited als Anlageverwalter des BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund ab.

Am 1. März 2023 wurde der Nachtrag des BNY Mellon U.S. Equity Income Fund aktualisiert, um eine Registrierung in Taiwan zu berücksichtigen.

Greg Brisk trat am 2. März 2023 als Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft zurück.

Am 10. April 2023 wurden der BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund und der BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Fund modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu ermöglichen.

Der BNY Mellon Blockchain Innovation Fund wurde am 4. Mai 2023 in Hongkong registriert.

Mit Wirkung vom 1. Juni 2023 trat Udo Goebel als Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft zurück.

Der BNY Mellon Floating Rate Credit Fund wurde am 26. Juni 2023 aufgelegt.

Der BNY Mellon Long-Term European Equity Fund wurde am 17. Juli 2023 aufgelegt.

Mit Wirkung vom 30. August 2023 wurden Ben Goldsbrough und Sandeep Sumal zu Verwaltungsratsmitgliedern der Verwaltungsgesellschaft ernannt.

Mit Wirkung vom 30. August 2023 wurde Sandeep Sumal zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft bestellt.

Am 26. September 2023 wurde die Zulassung des BNY Mellon Asia Rising Stars Fund, des BNY Mellon Dynamic Total Return Fund und des BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund von der Zentralbank widerrufen.

Der BNY Mellon Absolute Return Equity Fund wurde am 9. Oktober 2023 geschlossen.

19. WICHTIGE EREIGNISSE IM GESCHÄFTSJAHR Forts.

Am 11. Oktober 2023 wurde dem Prospekt der Gesellschaft der Zusatz III hinzugefügt, um Änderungen zu berücksichtigen, darunter die Aufnahme von Sandeep Sumal als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und der Wechsel des Referenzwerts für den BNY Mellon Mobility Innovation Fund.

Am 13. Oktober 2023 wurden die SFDR-Anhänge für alle SFDR-Teilfonds gemäß Artikel 8 und 9 aktualisiert.

Der BNY Mellon Food Innovation Fund, der BNY Mellon Future Earth Fund und der BNY Mellon Future Life Fund wurden am 10. November 2023 geschlossen.

Am 24. November 2023 wurden der BNY Mellon Global Credit Fund, der BNY Mellon Global Equity Income Fund und der BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund modifiziert, um eine Registrierung als SFDR-Artikel-6 statt als SFDR-Artikel-8 zu ermöglichen.

Der BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund wurde am 8. Dezember 2023 geschlossen.

Der BNY Mellon Absolute Return Credit Fund wurde am 11. Dezember 2023 aufgelegt.

Am 21. Dezember 2023 wurde der Nachtrag für den Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund geändert, um den Nachhaltigkeitsprozess des Teilfonds zu aktualisieren.

Am 21. Dezember 2023 wurden die Nachträge für den BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund und den BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund geändert, um die Registrierung in Hongkong zu ermöglichen.

Außer den vorgenannten Ereignissen sind im Geschäftsjahr keine weiteren wichtigen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft eingetreten.

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Claire Cawley wurde mit Wirkung vom 1. Januar 2024 zur Vorsitzenden des Verwaltungsrats ernannt. Sie löste David Dillon ab.

Die Gesellschaft gab am 2. Januar 2024 und am 2. April 2024 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	Klasse R (Inc)	EUR	0,5862	0,5472
	Klasse T (Hedged)	USD	0,6879	0,6556
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	0,6249	0,6239
	Klasse W (Acc)	EUR	0,6661	0,6311
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,7247	0,6881
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,1405	1,1010
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,0669
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	EUR	–	0,0661
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0010	–
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0012	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0014	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0014	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0014	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0012	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0013	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0013	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0013	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0013	–
BNY Mellon Asian Income Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0115	0,0119

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse A (Inc)	USD	0,0066	0,0067
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0085	0,0087
	Klasse B (Acc)	USD	0,0097	0,0098
	Klasse C (Acc)	USD	0,0106	0,0107
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0085	0,0088
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0096	0,0099
	Klasse W (Inc)	USD	0,0077	0,0077
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0103	0,0104
BNY Mellon Asian Opportunities Fund				
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0012	–
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund				
	Klasse B (Acc)	USD	0,0026	–
	Klasse B (Acc)	SGD	0,0039	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0053	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0139	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0144	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0073	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0055	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0045	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0050	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,0040	–
	Klasse K (Acc)	USD	0,0040	–
	Klasse K (Acc)	EUR	0,0042	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0116	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0062	–
BNY Mellon Brazil Equity Fund				
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0233	–
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0292	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0290	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0221	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0395	–
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0319	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0315	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0317	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0304	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0310	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0315	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0060	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0302	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0309	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0319	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,0305	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0312	–
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0082	–
	Klasse A (Inc)	USD	0,0130	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0168	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0130	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0142	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0104	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0205	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0189	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0152	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0116	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0290	–
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0184	0,0188
	Klasse A (Inc)	USD	0,0156	0,0157
	Klasse C (Acc)	USD	0,0184	0,0189
	Klasse C (Inc)	USD	0,0156	0,0157
	Klasse E (Acc)	USD	0,0143	0,0191
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0173	0,0181
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0179	0,0188
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0152	0,0157
	Sterling E (Inc) (Hedged) (M)	GBP	0,0061	0,0059
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0171	0,0179
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0145	0,0149
	Klasse W (Acc)	USD	0,0187	0,0190
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0138	0,0197
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0173	0,0181
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,1721	0,1895
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,1697	0,1868
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0179	0,0187
	Klasse W (Inc)	USD	0,0157	0,0157
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0146	0,0150
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0151	0,0156
	Klasse X (Acc)	USD	0,0186	0,0191
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0104	0,0103
	Klasse E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0014	0,0116
	Klasse E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0014	0,0116
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0111	0,0113
	Klasse W (Acc)	USD	0,0110	0,0109
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0102	0,0103
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,0129	0,0131
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0199	0,0194
	Klasse C (Acc)	USD	0,0200	0,0195
	Klasse C (Inc)	USD	0,0159	0,0152
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0174	0,0173
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0172	0,0172
	Klasse N (Acc)^	HKD	–	0,1321
	Klasse N (Acc)	USD	0,0175	0,0171
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	0,0165	0,0164
	Klasse N (Inc)^	HKD	–	0,1321
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0050	0,0046
	Klasse W (Acc)	USD	0,0201	0,0196
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0146	0,0203

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0173	0,0173
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0192	0,0192
	Klasse W (Inc)	USD	0,0161	0,0154
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0160	0,0157
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0190	0,0187
	Klasse X (Acc)	JPY	2,1506	2,2424
	Klasse X (Acc)	USD	0,0204	0,0199
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	1,8303	1,8799
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0196	0,0196
	Klasse X (Inc)	USD	0,0174	0,0166
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0155	0,0152
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0161	0,0160
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0174	0,0175
	Klasse C (Acc)	USD	0,0239	0,0241
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0209	0,0216
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0222	0,0230
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0203	0,0209
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0199	0,0205
	Klasse K (Acc)	USD	0,0234	0,0236
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	0,0206	0,0212
	Klasse L (Acc)	USD	0,0236	0,0239
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	0,0208	0,0215
	Klasse L (Inc)	USD	0,0183	0,0181
	Klasse L (Inc) (Hedged)	EUR	0,0171	0,0173
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0207	0,0214
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,0156	0,0158
	Klasse W (Acc)	USD	0,0241	0,0243
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0156	0,0220
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0212	0,0219
	Klasse W (Inc)	USD	0,0181	0,0179
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0140	0,0142
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0174	0,0176
	Klasse X (Acc)	USD	0,0198	0,0200
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0220	0,0228
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0167	0,0170
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,6022	2,6420
	Klasse G (Inc)	USD	0,9129	0,9059
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0508	1,1385
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0596	1,0954
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,8514	0,9124
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8291	0,8477
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,5687	1,6242
	Klasse X	USD	2,3163	2,3437
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund				
	Klasse C (Inc)	USD	0,0099	0,0100
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0137	0,0143
	Klasse X (Inc)	USD	0,0143	0,0145

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0097	0,0058
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0143	0,0086
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0232	0,0141
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0248	0,0155
	Klasse C (Inc)	USD	0,0109	0,0067
	Sterling C (Acc)	GBP	0,0377	0,0238
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0171	0,0106
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,0175	0,0114
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0129	0,0082
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0135	0,0086
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0138	0,0087
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0102	0,0066
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0176	0,0158
	Klasse X (Inc)	USD	0,0139	0,0122
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0179	0,0173
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0134	0,0130
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0161	0,0159
	Klasse W (Acc)	USD	0,0184	0,0177
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0157	0,0155
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0164	0,0162
	Klasse X (Acc)	USD	0,0191	0,0185
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0048	0,0048
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0055	0,0054
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0066	0,0066
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0055	0,0055
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0058	0,0059
BNY Mellon European Credit Fund				
	Klasse W (Acc)	EUR	0,5701	0,6789
	Klasse X	EUR	0,8673	1,0078
BNY Mellon Floating Rate Credit Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0162	0,0161
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0187	0,0188
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0193	0,0189
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0182	0,0192
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	0,0124
	Sterling E (Inc) (Hedged)^	GBP	–	0,0125
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0183	0,0182
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0188	0,0183
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0177	0,0186
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0180	0,0176
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0198	0,0199
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0195	0,0192
BNY Mellon Global Bond Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0007	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse C	USD	0,0314	–
	Klasse C (Inc)	USD	0,0060	0,0054
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0183	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,0107	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0139	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0133	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0128	–
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0113	–
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0113	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,0148	–
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	EUR	0,0110	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0128	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0122	–
BNY Mellon Global Credit Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0295	–
	Klasse A (Inc) (Q)	USD	0,0097	0,0100
	Klasse C (Acc)	USD	0,0209	–
	Klasse C (Inc)	USD	0,0209	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0322	–
	Klasse H (Inc) (Hedged) (Q)	SGD	0,0094	0,0100
	Klasse I (Acc) (Hedged)	CHF	0,0199	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)	CHF	0,0199	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0349	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0206	–
	Sterling I (Acc) (Hedged)	GBP	0,0207	–
	Sterling I (Inc) (Hedged)	GBP	0,0207	–
	Klasse K (Acc)	USD	0,0359	–
	Klasse K (Inc)	USD	0,0355	–
	Klasse K (Acc) (Hedged)	AUD	0,0045	–
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	0,0348	–
	Klasse K (Inc) (M)	USD	0,0036	0,0039
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	0,0349	–
	Sterling K (Inc) (Hedged)	GBP	0,0349	–
	Klasse L (Acc)	USD	0,0377	–
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	0,0370	–
	Klasse L (Inc)	USD	0,0372	–
	Klasse L (Inc) (Hedged)	EUR	0,0365	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0367	–
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,0372	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0471	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0376	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0359	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0216	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,0204	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0211	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	SGD	–	0,0002
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0430	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0212	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0544	–
	Klasse X (Acc)	JPY	4,9420	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0521	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	3,6590	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0126	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0126	–
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0093	0,0087
	Klasse C	USD	0,0143	0,0136
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0123	0,0119
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0076	0,0073
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,0105	0,0102
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	0,0100	0,0097
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0086	0,0083
	Klasse W	USD	0,0131	0,0125
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0087	0,0106
	Klasse W (Hedged)	EUR	–	0,0108
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0094	0,0091
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0121	0,0118
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	1,1457	1,1545
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	1,0285	1,0239
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,0120	0,0115
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0110	0,0104
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0112	0,0110
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0103	0,0100
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund				
	Klasse C (Acc)	USD	0,0069	–
	Klasse C (Inc)	USD	0,0055	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0153	–
	Klasse E (Acc)	CHF	0,0125	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0125	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0089	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0086	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0098	–
BNY Mellon Global Equity Income Fund				
	Klasse A	EUR	0,0191	0,0254
	Klasse A (Inc)	USD	0,0095	0,0123
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0088	0,0117
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0133	0,0175
	Klasse B	USD	0,0175	0,0229
	Klasse B	EUR	0,0192	0,0256
	Klasse B (Inc)	USD	0,0117	0,0152
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0138	0,0183
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0145	0,0189
	Klasse C (Inc)	USD	0,0124	0,0162
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0140	0,0186
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0153	0,0201
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0097	0,0129
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0072	0,0097
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	AUD	–	0,0003
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	CAD	–	0,0003
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,0003
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	SGD	–	0,0003
	Klasse J (Inc) (Hedged)^	AUD	–	0,0003

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse J (Inc) (Hedged)^	CAD	–	0,0003
	Klasse J (Inc) (Hedged)^	EUR	–	0,0003
	Klasse J (Inc) (Hedged)^	SGD	–	0,0003
	Klasse W	USD	0,0149	0,0195
	Klasse W	EUR	0,0178	0,0238
	Klasse W (Acc)	CHF	0,0061	0,0086
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0080	0,0108
	Klasse W (Inc)	USD	0,0107	0,0139
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0127	0,0169
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0190	0,0250
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0136	0,0178
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0125	0,0164
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0143	0,0191
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0084	0,0109
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0087	0,0116
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0085	0,0111
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				
	Klasse C (Inc)	USD	0,0135	0,0135
	Klasse W (Acc)	USD	0,0194	0,0199
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0170	0,0180
	Klasse X (Inc)	USD	0,0144	0,0146
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,0122	0,0127
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0106	0,0108
	Klasse A (Inc)	USD	0,0083	0,0084
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0086	0,0089
	Klasse B (Acc)	SGD	0,0129	0,0134
	Klasse B (Acc)	USD	0,0109	0,0111
	Klasse B (Inc)	USD	0,0085	0,0086
	Klasse B (Inc)	SGD	0,0107	0,0111
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0044	0,0038
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0045	0,0040
	Klasse E (Inc)	USD	0,0089	0,0091
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0093	0,0096
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0080	0,0083
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0091	0,0095
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0071	0,0073
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,0132	0,0137
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	0,0110	0,0113
	Klasse W (Acc)	USD	0,0113	0,0116
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0097	0,0101
	Klasse W (Inc)	USD	0,0088	0,0089
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0076	0,0078
BNY Mellon Global Leaders Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0070	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0053	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0081	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0031	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0001	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0177	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0187	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0029	–
BNY Mellon Global Opportunities Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0111	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				
	Klasse A	EUR	0,0205	–
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0165	–
	Klasse C	EUR	0,0290	–
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0230	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0223	–
	Klasse G (Inc)	EUR	0,0212	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	0,0161	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	0,0164	–
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	0,0156	–
	Klasse W	EUR	0,0300	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0229	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0227	–
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0264	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)				
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0066	–
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0065	–
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0125	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0172	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0151	–
	Sterling X (Acc)	GBP	0,0292	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)				
	Klasse A	USD	0,0290	–
	Klasse C	USD	0,0395	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0287	–
	Klasse W	USD	0,0360	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0311	–
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0163	0,0168
	Klasse A (Inc)	USD	0,0121	0,0123
	Klasse C (Acc)	USD	0,0185	0,0191
	Klasse G (Acc)	USD	0,0166	0,0171
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0127	0,0140
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0139	0,0146
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0104	0,0108
	Klasse I (Acc) (Hedged)	CHF	0,0141	0,0156
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0158	0,0166
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0114	0,0118
	Sterling L (Acc) (Hedged)^	GBP	–	0,0115
	Sterling L (Inc) (Hedged)^	GBP	–	0,0115
	Klasse W (Acc)	USD	0,0197	0,0203
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0154	0,0171
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0164	0,0173
	Klasse W (Inc)	USD	0,0139	0,0141
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0119	0,0123

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0180	0,0190
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0129	0,0134
	Klasse X (Acc)	USD	0,0224	0,0230
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0190	0,0200
	Klasse Y (Acc)	USD	0,0225	0,0231
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	0,0206	0,0217
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0168	0,0174
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0146	0,0148
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0169	0,0179
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0134	0,0140
BNY Mellon Global Unconstrained Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0193	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0295	–
BNY Mellon Long-Term European Equity Fund				
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0001	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0001	–
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0001	–
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				
	Klasse W	EUR	0,0063	–
	Klasse W	USD	0,0053	–
	Klasse W (Hedged)	USD	0,0069	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0215	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	0,0032	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0050	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0067	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0063	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0119	–
	Sterling X	GBP	0,0300	–
BNY Mellon Mobility Innovation Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0066	–
	Klasse E (Acc)	CHF	0,0065	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0070	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0065	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0068	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0059	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0022	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0015	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0021	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0017	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0023	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0021	–
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund				
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0260	–
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0093	0,0084
	Klasse A (Acc)	USD	0,0090	0,0080
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0088	0,0079
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0123	0,0114

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0112	0,0110
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0107	0,0099
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0086	0,0082
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0115	0,0106
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0105	0,0102
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0119	0,0107
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0114	0,0106
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0101	0,0093
	Klasse W (Inc) (Hedged)	USD	0,0117	0,0104
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0106	0,0097
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0131	0,0122
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0113	0,0105
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0105	0,0097
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,0112	0,0100
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund				
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0035	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0040	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0100	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0096	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0089	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0098	–
	Sterling E (Inc)	GBP	0,0089	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0098	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0067	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0065	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0060	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0066	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0060	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0066	–
BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0076	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0077	–
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0130	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0231	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0247	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0192	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0205	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0196	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0208	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0201	–
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0146	0,0135
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0164	0,0159
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0069	0,0062
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0095	0,0086
	Klasse A (Inc)	USD	0,0064	0,0057
	Klasse B (Inc)	USD	0,0081	0,0073

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
	Klasse C (Acc)	USD	0,0067	0,0061
	Klasse C (Inc)	USD	0,0090	0,0081
	Klasse E (Inc)	USD	0,0093	0,0083
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0093	0,0085
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0107	0,0097
	Sterling E (Inc)	GBP	0,0092	0,0083
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0082	0,0075
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0066	0,0060
	Klasse W (Acc)	USD	0,0107	0,0096
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0099	0,0090
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0060	0,0054
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0067	0,0061
	Klasse W (Inc)	USD	0,0092	0,0082
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0062	0,0057
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0090	0,0081
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0187	–
	Klasse A (Inc)	USD	0,0170	–
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0027	0,0026
	Klasse C (Acc)	USD	0,0230	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0222	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0181	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0201	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0181	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0192	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0163	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0155	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0177	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0232	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0200	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0184	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0200	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0183	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,0158	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0161	–
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0032	0,0032
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0178	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	0,0164	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,0172	–
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0154	0,0151
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0146	0,0155
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0149	0,0150
	Klasse G (Acc)	USD	0,0143	0,0139
	Klasse G (Inc)	USD	0,0137	0,0132
	Klasse W (Acc)	USD	0,0149	0,0145
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0144	0,0145
	Klasse W (Inc)	USD	0,0144	0,0139
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0139	0,0137
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0145	0,0146
	Klasse X (Acc)	USD	0,0163	0,0159

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	2. Januar 2024	2. April 2024
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0047	0,0055
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0058	0,0067
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0061	0,0070
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0059	0,0068
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0053	0,0081
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0070	0,0079
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0063	0,0072
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0061	0,0064
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0067	0,0067
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0071	0,0071
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0075	0,0073
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0073	0,0073
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0067	0,0067
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	0,0558	0,0744
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0069	0,0069
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0061	0,0081
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0073	0,0072
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0071	0,0071
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0073	0,0073
	Klasse X (Acc) (Hedged)	NOK	0,0641	0,0856
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	0,0078	0,0076
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0076	0,0076

^{*} Die Anteilsklasse wurde im ersten Quartal 2024 aufgelegt.

Die Gesellschaft gab am 4. Januar 2024 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Anteilsklasse	währung	4. Januar 2024
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0100
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0122
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0034
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0069
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0059
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0921
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0909
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0173
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0067

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Die Gesellschaft gab am 1. Februar 2024 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Anteilsklasse	währung	1. Februar 2024
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			
	Sterling E (Inc) (Hedged) (M)	GBP	0,0066
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund			
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0053
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,7417
BNY Mellon Global Credit Fund			
	Klasse K (Inc) (M)	USD	0,0045
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0023
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0024
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund			
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0029
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0032

Die Gesellschaft gab am 1. März 2024 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Anteilsklasse	währung	1. März 2024
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			
	Sterling E (Inc) (Hedged) (M)	GBP	0,0063
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund			
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0048
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,6349
BNY Mellon Global Credit Fund			
	Klasse K (Inc) (M)	USD	0,0034
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0038
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0040
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund			
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0029
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0035

Am 2. April 2024 wurde der Nachtrag für den BNY Mellon Absolute Return Bond geändert, um einige Klarstellungen vorzunehmen.

Am 2. April 2024 wurden der BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund und der BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund modifiziert, um eine Registrierung als SFDR-Artikel-6 statt als SFDR-Artikel-8 zu ermöglichen.

Nach Ablauf des Berichtszeitraums hat es keine Ereignisse gegeben, die nach Auffassung der Verwaltungsratsmitglieder und der Verwaltungsgesellschaft eine Auswirkung auf den Abschluss für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr hätten haben können.

21. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Jahresabschluss wurde am 23. April 2024 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	27.906.000	27.863.739	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Jun-2023	39.383.000	39.253.884
Spain Government Bond 0.800% 30-Jul-2029	27.220.000	23.879.539	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	34.000.000	33.640.559
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Jun-2023	22.383.000	22.275.323	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	27.906.000	28.450.507
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	19.000.000	18.764.174	Spain Government Bond 0.800% 30-Jul-2029	27.220.000	23.622.333
Korea Treasury Bond 4.250% 10-Dec-2032	24.800.000.000	18.637.167	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Mar-2023	21.370.000	21.298.330
Korea Treasury Bond 3.250% 10-Mar-2053	21.450.000.000	14.270.152	Korea Treasury Bond 4.250% 10-Dec-2032	24.800.000.000	18.294.646
New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	22.600.000	12.323.359	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-May-2023	17.500.000	17.416.560
Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.375% 18-Jul-2038	9.746.000	9.773.341	Bundesobligation (Zero Coupon) 0.000% 14-Apr-2023	17.000.000	16.966.880
Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Jun-2041	1.280.000.000	7.704.069	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	12.834.059	16.317.615
ING Groep NV FRN 4.750% 23-May-2034	7.200.000	7.139.016	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2023	15.000.000	14.971.868
Mizuho Financial Group Inc 'emtn' 4.416% 20-May-2033	5.810.000	5.810.000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.375% 18-Jul-2038	9.746.000	9.911.720
La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 5.500% 05-Mar-2034	5.600.000	5.591.009	New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	18.800.000	9.716.690
Japan Government Thirty Year Bond 1.200% 20-Jun-2053	879.850.000	5.212.335	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Jun-2041	1.280.000.000	8.044.833
Heineken NV 'EMTN' 4.125% 23-Mar-2035	4.701.000	4.670.914	Korea Treasury Bond 3.125% 10-Sep-2052	11.000.000.000	7.346.831
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Apr-2023	4.598.000	4.575.293	ING Groep NV FRN 4.750% 23-May-2034	7.200.000	7.152.053
UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	5.965.000	4.365.730	Korea Treasury Bond 3.250% 10-Mar-2053	11.310.000.000	7.057.871
JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	4.583.000	4.261.867	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2023	5.826.000	5.825.649
Kering SA 'EMTN' 3.625% 05-Sep-2031	3.900.000	3.869.229	Mizuho Financial Group Inc 'emtn' 4.416% 20-May-2033	5.810.000	5.756.519
Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	3.808.000	3.795.624	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 5.500% 05-Mar-2034	5.700.000	5.604.918
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	3.771.000	3.552.531	Heineken NV 'EMTN' 4.125% 23-Mar-2035	4.701.000	4.772.896

BNY Mellon Absolute Return Credit Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse GBP
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Apr-2024	2.750.000	2.509.581	Insight Liquidity Funds Plc – ILF EUR Liquidity Fund	17.148	1.720.185
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-May-2024	2.750.000	2.498.744	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Apr-2024	1.390.000	1.254.386
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	2.500.000	2.491.390			
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Feb-2024	2.500.000	2.482.504			
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Mar-2024	2.500.000	2.475.402			
Insight Liquidity Funds Plc – ILF EUR Liquidity Fund	17.148	1.720.000			
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	945.246	1.234.736			
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.300% 19-May-2053	420.000	399.895			
Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	434.000	384.470			
UBS Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	410.000	374.113			
JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	407.000	372.111			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.750% 14-Sep-2029	460.000	370.658			
European Union 2.750% 04-Feb-2033	365.000	362.567			
Bank of Cyprus Plc 'EMTN' FRN 7.375% 25-Jul-2028	345.000	354.919			
Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	400.000	346.396			
Ryder System Inc 6.600% 01-Dec-2033	340.000	337.099			
Bank of Nova Scotia/The FRN 3.625% 27-Oct-2081	475.000	325.972			
Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	300.000	316.386			
mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	300.000	314.760			
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.625% 24-Feb-2043	300.000	314.226			
AA Bond Co Ltd 'eMTN' 8.450% 31-Jan-2028	261.000	311.803			
Sartorius Finance BV 4.500% 14-Sep-2032	300.000	307.014			
Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 3.375% 22-Nov-2032	300.000	300.513			
Permanent TSB Group Holdings Plc FRN 6.625% 25-Apr-2028	285.000	298.227			
PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.037% 28-Oct-2033	291.000	272.870			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Oct-2023	15.428.000	15.371.119	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jan-2023	17.000.000	17.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Oct-2023	14.000.000	13.961.207	Insight Liquidity Funds PLC – ILF GBP Liquidity Fund	16.977.356	16.977.356
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Sep-2023	12.000.000	11.960.538	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Oct-2023	15.428.000	15.421.357
United Kingdom Gilt 0.125% 31-Jan-2023	9.000.000	8.982.540	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Oct-2023	14.000.000	13.979.892
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Sep-2023	6.000.000	5.953.571	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Sep-2023	12.000.000	12.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Oct-2023	5.570.000	5.550.049	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.125% 31-Jan-2023	9.000.000	9.000.000
Insight Liquidity Funds PLC – ILF GBP Liquidity Fund	4.019.345	4.019.345	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jan-2023	6.000.000	6.000.000
Lloyds Bank Plc 4.000% 11-Apr-2023 CD	4.000.000	4.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Sep-2023	6.000.000	6.000.000
Danske Bank A/S 3.920% 11-Apr-2023 CD	4.000.000	4.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Oct-2023	5.570.000	5.556.413
Danske Bank A/S 4.500% 11-Jul-2023 CD	4.000.000	4.000.000	Paccar Financial Europe BV (Zero Coupon) 0.000% 27-Sep-2023 CP	4.000.000	4.000.000
Lloyds Bank Plc 4.440% 26-Jun-2023	4.000.000	4.000.000	Lloyds Bank Plc 4.440% 26-Jun-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Sumitomo Mitsui Banking Corp 5.100% 15-Sep-2023 CD	4.000.000	4.000.000	UBS AG 2.900% 26-Apr-2023 CD	4.000.000	4.000.000
UBS AG 2.900% 26-Apr-2023 CD	4.000.000	3.995.782	Lloyds Bank Plc CTF DEP (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023 CD	4.000.000	4.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 2.250% 07-Sep-2023	4.000.000	3.994.520	Sumitomo Mitsui Banking Corp 5.100% 15-Sep-2023 Cd	4.000.000	4.000.000
Nederlandse Waterschapsbank (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2023	4.000.000	3.992.076	Sumitomo Trust And Banking London (Zero Coupon) 0.000% 15-Mar-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Paccar Financial Europe BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2023	4.000.000	3.989.749	Sumitomo Mitsui Banking Corp (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Mizuho Bank LTD CA Branch (Zero Coupon) 0.000% 22-Jun-2023 CD	4.000.000	3.989.180	Nederlandse Waterschapsbank (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2023 CP	4.000.000	4.000.000
Kingdom of Belgium (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023 CP	4.000.000	3.988.428	Nordea Bank ABP (Zero Coupon) 0.000% 24-May-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Landwirtschaftliche Rentenbank (Zero Coupon) 0.000% 28-Feb-2023 CP	4.000.000	3.988.313	Barclays Bank Plc Bishopsgate (Zero Coupon) 0.000% 06-Apr-2023 CP	4.000.000	4.000.000
Municipality Finance Plc (Zero Coupon) 0.000% 09-Feb-2023 CP	4.000.000	3.988.212	KBC Bank NV (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Municipal Housing Finance (Zero Coupon) 0.000% 21-Aug-2023 CP	4.000.000	3.988.069			
Landwirtschaftliche Rentenbank (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2023 CP	4.000.000	3.986.504			
Sumitomo Mitsui BKG Corp Brussels (Zero Coupon) 0.000% 12-Jun-2023 CD	4.000.000	3.984.281			
Nederlandse Waterschapsbank (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2023 CP	4.000.000	3.981.613			
MUFG Bank LTD (Zero Coupon) 0.000% 22-Jun-2023 CD	4.000.000	3.981.141			
Sumitomo Mitsui BKG Corp Brussels (Zero Coupon) 0.000% 11-May-2023 CD	4.000.000	3.980.728			
Nordea Bank ABP (Zero Coupon) 0.000% 24-May-2023 CD	4.000.000	3.977.581			
BPCE (Zero Coupon) 0.000% 06-Mar-2023 CP	4.000.000	3.977.118			
Paccar Financial Europe BV (Zero Coupon) 0.000% 27-Sep-2023 CP	4.000.000	3.976.858			
Sumitomo Mitsui Banking (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2023 CD	4.000.000	3.974.431			
Banco Santander SA (Zero Coupon) 0.000% 22-Aug-2023 CD	4.000.000	3.966.721			
KBC Bank NV (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2023 CD	4.000.000	3.963.891			
Mizuho Bank LTD CA Branch (Zero Coupon) 0.000% 06-Apr-2023 CD	4.000.000	3.963.065			
Barclays Bank Plc Bishopsgate (Zero Coupon) 0.000% 06-Apr-2023 CP	4.000.000	3.960.933			
Abu Dhabi Commercial Bank (Zero Coupon) 0.000% 22-May-2023 CP	4.000.000	3.958.420			
Sumitomo Trust And Banking London (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023 CD	4.000.000	3.956.224			
Banco Santander SA (Zero Coupon) 0.000% 07-Nov-2023 CD	4.000.000	3.953.132			
Banque Postale (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2023 CP	4.000.000	3.914.587			
Banque Federative du Credit Mutuel (Zero Coupon) 0.000% 08-Aug-2023 CD	4.000.000	3.911.738			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 25-Jan-2023	9.500.000	9.491.883	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2023	17.500.000	17.500.000
Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 30-Jan-2023	8.000.000	7.994.590	European Union Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2023	15.700.000	15.700.000
European Stability Mechanism Treasury (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2023	7.000.000	6.985.481	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 25-Jan-2023	11.500.000	11.499.674
French Republic Government Bond OAT (Zero Coupon) 0.000% 25-Feb-2024	5.700.000	5.626.610	Austrian Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	10.500.000	10.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Nov-2023	5.500.000	5.496.077	Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 30-Jan-2023	8.000.000	8.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 11-May-2023	5.500.000	5.483.096	Netherlands DSL 7.500% 15-Jan-2023	7.500.000	7.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jul-2023	5.500.000	5.468.191	European Stability Mechanism Treasury (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2023	7.000.000	7.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	5.100.000	5.094.503	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	59.203	5.800.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 11-Oct-2023	5.000.000	4.958.453	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 11-May-2023	5.500.000	5.500.000
Erste Group Bank AG (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2023 CP	4.000.000	3.998.734	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jul-2023	5.500.000	5.500.000
BNG Bank N.V. (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023 CP	4.000.000	3.997.286	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Nov-2023	5.500.000	5.500.000
Colgate Palmolive Company (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2023 CP	4.000.000	3.997.062	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	5.100.000	5.100.000
Colgate Palmolive Company (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2023 CP	4.000.000	3.997.062	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 11-Oct-2023	5.000.000	5.000.000
BNG Bank NV (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023 CP	4.000.000	3.996.836	BMW Finance NV (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2023 CP	4.000.000	4.000.000
Colgate Palmolive Company (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2023 CP	4.000.000	3.996.488	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023	4.000.000	4.000.000
BNG Bank N.V. (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2023 CP	4.000.000	3.996.301	Sumitomo Mitsui Banking Brussels (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2023 CD	4.000.000	4.000.000
Colgate Palmolive Company (Zero Coupon) 0.000% 02-Mar-2023 CP	4.000.000	3.996.270	BNG Bank N.V. (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023	4.000.000	4.000.000
Landwirtschaftliche Rentenbank (Zero Coupon) 0.000% 13-Feb-2023 CP	4.000.000	3.996.124	Colgate Palmolive Company (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2023 CP	4.000.000	4.000.000
Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	4.000.000	3.995.555	Kommunalbanken AS (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2023 CP	4.000.000	4.000.000
BNG Bank N.V. (Zero Coupon) 0.000% 15-Mar-2023 CP	4.000.000	3.994.454	Credit Agricole Corporate & Investment Bank (Zero Coupon) 0.000% 06-Feb-2023 CD	4.000.000	4.000.000

BNY Mellon Asian Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	50.000	891.193	Insurance Australia Group Ltd	178.444	670.663
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	19.973	881.811	DBS Group Holdings Ltd	16.600	401.647
Tata Consultancy Services Ltd	20.053	811.376	Elite Material Co Ltd	41.000	398.116
ITC Ltd	124.199	659.718	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	8.298	380.973
Link REIT (Units) (REIT)	114.820	623.771	United Overseas Bank Ltd	13.700	294.180
DBS Group Holdings Ltd	24.600	594.303	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	306.341	278.825
Insurance Australia Group Ltd	141.790	519.382	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	15.000	263.657
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.277.200	516.656	By-health Co Ltd	82.717	263.502
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	2.063.300	515.386	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	47.900	225.491
AIA Group Ltd	47.200	464.985	ITEQ Corp	74.000	212.458
Singapore Technologies Engineering Ltd	160.000	441.750	ITC Ltd GDR	35.086	195.457
Woodside Energy Group Ltd	18.665	440.380	Link REIT (Units) (REIT)	28.100	172.669
MediaTek Inc	17.000	398.913	Hanon Systems	17.393	114.732
National Australia Bank Ltd	21.615	393.025	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	15.000	102.369
United Overseas Bank Ltd	17.200	363.703	CLP Holdings Ltd	13.000	100.421
CLP Holdings Ltd	48.000	359.725	National Australia Bank Ltd	5.317	99.803
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	56.500	356.771	Singapore Technologies Engineering Ltd	33.900	93.842
KT Corp	14.595	356.551	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	357.300	90.802
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	995.300	352.084	MediaTek Inc	3.000	87.811
Venture Corp Ltd	31.400	338.611	Meridian Energy Ltd	25.936	87.138
Advantech Co Ltd	27.000	311.042	Venture Corp Ltd	8.300	84.000
Sonic Healthcare Ltd	15.773	298.185	Dexus (REIT)	16.509	80.872
Chroma ATE Inc	43.000	295.313	Advantech Co Ltd	6.000	67.020
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	7.300	283.091	Transurban Group	7.238	64.633
Dexus (REIT)	54.548	280.836	SK Telecom Co Ltd	1.686	62.681
SK Telecom Co Ltd	7.065	259.910	Infosys Ltd ADR	3.425	58.346
Macquarie Korea Infrastructure Fund	25.851	241.001	Tata Consultancy Services Ltd	1.206	55.018
Transurban Group	23.320	213.955			
BHP Group Ltd	6.885	209.208			
Singapore Exchange Ltd	28.900	204.267			
Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	71.100	195.168			
ASMPT Ltd	19.000	183.136			
Meridian Energy Ltd	54.022	173.541			
Elite Material Co Ltd	20.000	162.821			
Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	34.700	162.180			
Spark New Zealand Ltd	46.678	144.396			

BNY Mellon Asian Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Samsung Electronics Co Ltd	15.046	786.632	Meituan '144A'	98.574	1.199.747
ASM International NV	1.916	663.349	By-health Co Ltd	412.343	1.169.200
Infosys Ltd	37.387	626.908	SK Hynix Inc	15.215	1.102.848
Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	111.219	598.724	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	54.000	916.783
Sungrow Power Supply Co Ltd	42.800	590.841	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	134.500	851.388
Chroma ATE Inc	92.000	575.342	Godrej Consumer Products Ltd	57.308	712.164
Sunresin New Materials Co Ltd	71.700	565.492	Maruti Suzuki India Ltd	6.054	659.982
Meituan '144A'	27.800	547.986	ASML Holding NV	1.004	653.240
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.108.300	470.129	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	172.000	616.702
NetEase Inc	24.200	434.557	Samsung Electronics Co Ltd	11.945	602.014
Tencent Holdings Ltd	9.700	415.069	Samsung SDI Co Ltd	1.271	595.494
Pidilite Industries Ltd	12.697	385.244	PB Fintech Ltd	65.215	581.540
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	40.600	373.294	Tencent Holdings Ltd	12.900	572.800
Lam Research Corp	566	363.779	Yum China Holdings Inc	9.639	569.122
Prudential Plc	32.575	350.714	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	125.064	527.429
Proya Cosmetics Co Ltd 'A'	25.300	346.334	Info Edge India Ltd	10.008	518.800
Zomato Ltd	356.584	336.409	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	10.500	516.276
Yum China Holdings Inc	6.228	294.262	Tata Consultancy Services Ltd	11.926	494.479
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	43.098	289.610	Housing Development Finance Corp Ltd	14.429	458.163
Titan Co Ltd	9.372	277.843	Titan Co Ltd	11.986	453.613
ICICI Bank Ltd	25.412	266.247	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	102.600	451.940
Voltronic Power Technology Corp	5.000	228.770	Sea Ltd ADR	10.683	438.872
MakeMyTrip Ltd	5.510	218.693	HDFC Bank Ltd	22.127	429.126
Allkern Ltd	32.565	216.694	Delta Electronics Inc	40.000	398.417
Kingdee International Software Group Co Ltd	143.000	199.059	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	45.700	397.159
AIA Group Ltd	19.000	195.903	AIA Group Ltd	39.200	394.566
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	526.900	188.062	Asian Paints Ltd	10.787	357.545
HDFC Bank Ltd	9.604	185.757	ASM International NV	866	351.795
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	20.300	160.664	OZ Minerals Ltd	19.579	347.888
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8.000	144.140	NetEase Inc	17.600	314.243
Vitasoy International Holdings Ltd	100.000	143.906	MakeMyTrip Ltd	5.510	232.651
Hindustan Unilever Ltd	4.627	141.721	Sungrow Power Supply Co Ltd	13.400	208.550
Samsung SDI Co Ltd	232	134.692			

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

All Purchases	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Microsoft Corp	6.439	2.142.680	NVIDIA Corp	4.526	1.843.045
JPMorgan Chase & Co	8.569	1.156.366	SAP SE	11.443	1.648.081
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2.429	883.092	Salesforce Inc	5.909	1.292.955
Capgemini SE	4.369	821.831	ASX Ltd	30.594	1.212.463
Centene Corp	10.364	719.855	Nasdaq Inc	23.240	1.169.137
Block Inc	12.536	714.478	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.418	1.149.861
Sony Group Corp	7.400	667.928	Swiss Life Holding AG	1.488	979.870
Mastercard Inc	1.474	547.238	AP Moller - Maersk A/S - Class B	494	966.795
Globant SA	2.656	464.093	Signature Bank/New York NY	10.986	874.347
GXO Logistics Inc	8.466	446.953	Funko Inc - Class A	72.912	827.949
Wolters Kluwer NV	3.582	437.847	Siemens AG ADR	10.559	789.578
PayPal Holdings Inc	6.339	403.084	Alphabet Inc - Class A	5.682	765.959
Signature Bank/New York NY	1.671	244.234	Block Inc	11.162	730.155
National Bank Holdings Corp	6.536	237.837	Enphase Energy Inc	3.117	729.667
WisdomTree Inc	40.081	229.500	Microsoft Corp	1.862	672.666
Daimler Truck Holding AG	6.758	226.375	Accenture Plc - Class A	2.109	671.411
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.570	166.404	Universal Music Group NV	19.581	538.594
Accenture Plc - Class A	600	162.165	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	5.803	528.661
Zurich Insurance Group AG	335	156.132	Globant SA	2.758	527.772
Siemens AG ADR	1.543	144.619	Starbucks Corp	5.348	502.612
SBI Holdings Inc	5.200	116.393	Kering SA	1.049	442.674
			GXO Logistics Inc	7.393	436.409
			HYBE Co Ltd	2.396	420.008
			WisdomTree Inc	61.529	418.290
			Enel SpA	58.837	374.298
			Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	768	311.084
			Mercedes-Benz Group AG	4.415	303.179
			Mastercard Inc	734	303.060
			SBI Holdings Inc	13.300	283.612
			Centene Corp	3.690	266.129
			JPMorgan Chase & Co	1.625	256.036

BNY Mellon Brazil Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Centrais Eletricas Brasileiras SA	174.509	1.112.968	Banco do Brasil SA	212.460	1.585.591
Banco Bradesco SA ADR	323.000	1.084.150	Banco BTG Pactual SA (Units)	181.284	1.059.264
BRF SA	530.541	988.160	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	347.533	965.439
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	212.683	586.399	Santos Brasil Participacoes SA	548.600	917.426
Itausa SA - Preference	288.300	540.020	Banco Bradesco SA ADR	339.500	901.925
Banco BTG Pactual SA (Units)	105.156	528.074	Centrais Eletricas Brasileiras SA - Preference	100.959	656.785
Vibra Energia SA	153.548	524.531	BRF SA	316.328	655.678
BB Seguridade Participacoes SA	74.102	475.355	Vale SA	43.200	642.630
Marfrig Global Foods SA	319.781	471.750	Itausa SA - Preference	356.600	634.330
Vale SA	32.200	457.474	Allos SA	140.205	587.271
Suzano SA	46.800	454.956	Embraer SA ADR	36.600	559.809
Bradespar SA - Preference	87.700	445.272	Suzano SA	57.800	553.229
Banco Bradesco SA - Preference	136.600	440.388	Bradespar SA - Preference	108.100	530.576
3R PETROLEUM OLEO E GAS SA	67.519	418.442	Banco Bradesco SA - Preference	158.525	503.638
Santos Brasil Participacoes SA	223.100	409.453	Vibra Energia SA	131.500	450.121
Gerdau SA ADR	70.500	381.632	YDUQS Participacoes SA	127.402	415.377
Sendas Distribuidora S/A	143.308	377.240	TIM SA/Brazil	138.700	398.083
Gerdau SA - Preference	67.900	339.704	Sendas Distribuidora S/A ADR	27.020	382.626
TIM SA/Brazil	112.400	328.871	Gerdau SA ADR	78.100	367.996
Vale SA ADR - Class B	18.100	293.782	BB Seguridade Participacoes SA	55.600	359.939
Sendas Distribuidora S/A ADR	16.900	289.612	Gerdau SA - Preference	64.000	326.339
YDUQS Participacoes SA	74.600	248.629	Sendas Distribuidora S/A	113.600	308.580
AES Brasil Energia SA	108.700	244.607	Marfrig Global Foods SA	204.234	307.053
Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	41.600	240.515	Centrais Eletricas Brasileiras SA	41.500	299.283
Marfrig Global Foods SA	143.600	229.949	AES Brasil Energia SA	134.100	289.271
Allos SA	49.800	224.881	Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	51.200	265.677
Embraer SA	51.700	201.035	BR Malls Participacoes SA	134.254	210.891
Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	238.751	191.419	Itau Unibanco Holding SA - Preference	36.900	200.827
Telefonica Brasil SA	18.600	176.466	Atacadao SA	87.200	198.232
Atacadao SA	70.700	170.993	Light S/A	389.979	194.377
Embraer SA ADR	10.550	145.635	3R PETROLEUM OLEO E GAS SA	30.656	191.332
			Embraer SA	46.800	191.151
			Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	244.200	188.261

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2024	5.068.000	4.965.528	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	6.827.000	6.759.394
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	4.300.000	4.186.627	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Mar-2023	3.310.000	3.310.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	3.427.000	3.388.012	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Sep-2023	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Sep-2023	3.000.000	2.950.697	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Aug-2023	3.000.000	2.987.850
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2023	2.981.000	2.942.276	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2023	2.981.000	2.981.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Aug-2023	3.000.000	2.937.033	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	2.900.000	2.898.366
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Nov-2023	2.437.000	2.402.846	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	2.700.000	2.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Oct-2023	2.300.000	2.250.482	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Nov-2023	2.437.000	2.437.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2024	2.300.000	2.243.092	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Oct-2023	2.300.000	2.300.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Feb-2024	2.300.000	2.242.451	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2023	2.200.000	2.197.924
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2023	2.200.000	2.152.773	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Jun-2023	2.000.000	1.980.859	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Aug-2023	2.000.000	1.972.002	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2023	2.000.000	1.971.508	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	2.000.000	1.964.511	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	2.000.000	1.960.371	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2023	2.000.000	1.957.956	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2023	2.000.000	1.955.578	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	2.000.000	1.955.368	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Oct-2023	2.000.000	2.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Oct-2023	2.000.000	1.954.411	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2023	2.000.000	1.999.854
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2024	2.000.000	1.949.109	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2023	2.000.000	1.999.511
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Mar-2024	2.000.000	1.948.501	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Jun-2023	2.000.000	1.993.589
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Apr-2024	2.000.000	1.948.297	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Aug-2023	2.000.000	1.979.396
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	2.000.000	1.948.292	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Mar-2024	2.000.000	1.948.244			

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2023	22.000.000	21.538.528	Apple Inc	169.617	31.746.270
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2023	6.000.000	5.908.169	Microsoft Corp	84.108	28.811.463
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	6.000.000	5.893.534	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2023	22.000.000	21.853.723
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	6.000.000	5.881.112	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	18.000.000	18.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	6.000.000	5.866.104	Amazon.com Inc	100.996	13.230.273
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2023	6.000.000	5.865.894	NVIDIA Corp	28.294	12.406.320
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Aug-2023	6.000.000	5.865.194	Alphabet Inc - Class A	67.363	8.433.006
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Oct-2023	6.000.000	5.863.234	Tesla Inc	30.509	7.775.223
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2024	5.500.000	5.400.777	Alphabet Inc	60.788	7.623.698
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2024	5.500.000	5.393.739	Meta Platforms Inc - Class A	25.392	7.544.840
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2024	5.060.000	4.931.246	Berkshire Hathaway Inc - Class B	20.583	7.076.402
Apple Inc	25.912	4.708.940	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	6.000.000	6.000.000
Microsoft Corp	13.200	4.340.750	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2023	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	4.000.000	3.896.585	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Feb-2024	3.500.000	3.410.005	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	3.000.000	2.996.599	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	3.000.000	2.983.447	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	3.000.000	2.972.523	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Aug-2023	6.000.000	5.992.654
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Apr-2024	3.000.000	2.922.446	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	6.000.000	5.985.021
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Mar-2024	3.000.000	2.922.366	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2023	6.000.000	5.982.428
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	3.000.000	2.919.010	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	6.000.000	5.979.860
Amazon.com Inc	17.714	2.234.898	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Oct-2023	6.000.000	5.977.584
NVIDIA Corp	4.542	1.818.626	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	6.000.000	5.975.521
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	6.000.000	5.973.726
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2023	6.000.000	5.970.741

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	957.000	956.225	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	887.000	855.464
Olympus Water US Holding Corp '144A' 9.750% 15-Nov-2028	777.000	777.767	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	796.000	756.463
Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Mar-2172	700.000	748.833	Sands China Ltd 5.375% 08-Aug-2025	770.000	752.529
Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	639.000	638.788	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Mar-2172	700.000	750.863
Tenneco Inc '144A' 8.000% 17-Nov-2028	750.000	637.500	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	579.000	563.843
CVR Energy Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2029	632.000	632.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 9.750% 15-Nov-2028	565.000	559.418
Enova International Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2028	574.000	568.593	Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	529.000	533.502
Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	550.000	549.835	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	570.000	525.560
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	570.000	544.197	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Sep-2030	610.000	519.263
Adams Homes Inc '144A' 9.250% 15-Oct-2028	531.000	531.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 06-Mar-2030	488.000	500.525
Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	530.000	530.000	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	502.000	485.383
CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	540.000	525.617	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	491.000	485.357
CNX Resources Corp '144A' 7.375 % 15-Jan-2031	500.000	496.760	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	500.000	453.002
Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 06-Mar-2030	488.000	488.860	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 9.250% 01-Jul-2031	446.000	443.042
Burford Capital Global Finance LLC '144A' 9.250% 01-Jul-2031	488.000	481.246	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	357.000	433.655
Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	500.000	478.275	Sprint LLC 7.625% 15-Feb-2025	400.000	412.976
Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jan-2029	477.000	477.325	VistaJet Malta Finance PLC / Vista Management Holding Inc '144A' 9.500% 01-Jun-2028	423.000	398.600
Brinker International Inc '144A' 8.250% 15-Jul-2030	475.000	475.000	TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026	390.000	387.261
American Airlines Inc/Advantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	474.167	466.556	Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	395.000	384.980
VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc '144A' 9.500% 01-Jun-2028	468.000	463.311	Occidental Petroleum Corp 8.500 % 15-Jul-2027	350.000	379.908

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
American Express Co FRN 5.625% 28-Jul-2034	630.000	630.000	Charles Schwab Corp/The FRN 6.136% 24-Aug-2034	600.000	610.266
Charles Schwab Corp/The FRN 6.136% 24-Aug-2034	620.000	620.000	Assured Guaranty US Holdings Inc 6.125% 15-Sep-2028	600.000	599.790
Assured Guaranty US Holdings Inc 6.125% 15-Sep-2028	620.000	616.664	American Express Co FRN 5.625% 28-Jul-2034	600.000	598.518
Wells Fargo & Co 'GMTN' FRN 5.557% 25-Jul-2034	475.000	475.000	American Honda Finance Corp 'GMTN' 5.850% 04-Oct-2030	470.000	469.304
American Honda Finance Corp 'GMTN' 5.850% 04-Oct-2030	470.000	469.469	Wells Fargo & Co 'GMTN' FRN 5.557% 25-Jul-2034	450.000	448.881
Xcel Energy Inc 5.450% 15-Aug-2033	470.000	469.375	Norfolk Southern Corp 5.050% 01-Aug-2030	450.000	446.945
Norfolk Southern Corp 5.050% 01-Aug-2030	470.000	469.041	Prologis LP 5.125% 15-Jan-2034	450.000	445.329
Darden Restaurants Inc 6.300% 10-Oct-2033	470.000	466.809	BMW US Capital LLC 'REGS' 5.150% 11-Aug-2033	450.000	443.349
BMW US Capital LLC 'REGS' 5.150% 11-Aug-2033	450.000	449.235	Darden Restaurants Inc 6.300% 10-Oct-2033	450.000	441.264
McDonald's Corp 4.950% 14-Aug-2033	450.000	448.808	Xcel Energy Inc 5.450% 15-Aug-2033	450.000	439.740
Prologis LP 5.125% 15-Jan-2034	450.000	448.389	McDonald's Corp 4.950% 14-Aug-2033	450.000	436.187
Daimler Truck Finance North America LLC '144A' 5.500% 20-Sep-2033	450.000	447.336	Daimler Truck Finance North America LLC '144A' 5.500% 20-Sep-2033	440.000	435.622
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 5.441% 22-Feb-2034	440.000	440.054	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 5.441% 22-Feb-2034	390.000	381.281
JPMorgan Chase & Co FRN 5.350% 01-Jun-2034	405.000	404.191	Simon Property Group LP 5.500% 08-Mar-2033	380.000	377.543
Simon Property Group LP 5.500% 08-Mar-2033	400.000	395.644	Lockheed Martin Corp 4.750% 15-Feb-2034	350.000	344.760
Athene Holding Ltd 5.875% 15-Jan-2034	400.000	392.696	Estee Lauder Cos Inc/The 4.650% 15-May-2033	350.000	341.727
PNC Financial Services Group Inc/The FRN 6.875% 20-Oct-2034	350.000	353.587	Athene Holding Ltd 5.875% 15-Jan-2034	350.000	341.709
TTX Co '144A' 5.750% 22-Nov-2033	350.000	350.805	Entergy Mississippi LLC 5.000% 01-Sep-2033	340.000	337.730
Entergy Mississippi LLC 5.000% 01-Sep-2033	350.000	349.801	Southern California Gas Co 5.200% 01-Jun-2033	340.000	336.296
Estee Lauder Cos Inc/The 4.650% 15-May-2033	350.000	349.640	Honeywell International Inc 4.500% 15-Jan-2034	340.000	335.128

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	45.218.000	43.388.614	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	28.936.000	31.050.682
Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	26.219.000	24.052.806	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	22.599.000	21.906.751
Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	20.312.000	18.871.642	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	23.334.000	21.210.046
Newell Brands Inc 5.200 % 01-Apr-2026	17.585.000	16.692.276	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	21.523.000	20.917.210
Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	16.075.000	15.631.096	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	17.046.000	20.745.017
Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	15.355.000	15.475.970	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	20.270.000	19.614.854
Kohl's Corp 4.625% 01-May-2031	21.171.000	15.015.599	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	16.670.000	16.508.378
Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	15.384.000	14.128.075	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	16.659.000	15.439.237
Perrigo Finance Unlimited Co 4.650 % 15-Jun-2030	14.630.000	12.970.326	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	16.289.000	15.415.976
Southwestern Energy Co 5.700 % 23-Jan-2025	11.844.000	11.739.317	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	15.997.000	15.350.175
Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	10.765.000	11.555.601	Sands China Ltd 5.375% 08-Aug-2025	14.817.000	14.521.142
Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	12.864.000	11.306.755	Brinker International Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2024	13.942.000	13.609.445
United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	11.484.000	10.584.510	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	13.544.000	13.394.809
Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	10.415.000	10.450.879	Perrigo Finance Unlimited Co 4.650 % 15-Jun-2030	15.190.000	13.266.219
Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	10.051.000	9.794.916	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	13.480.000	12.465.503
Brandywine Operating Partnership LP 3.950% 15-Nov-2027	11.510.000	9.656.795	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	14.250.000	11.950.313
Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	10.001.000	9.584.208	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	13.417.000	11.877.818
UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	10.267.000	9.296.287	Office Properties Income Trust 4.250% 15-May-2024	11.592.000	10.819.563
Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	15.666.000	8.866.249	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	10.858.000	10.763.194
EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	9.468.000	8.821.069	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	10.410.000	9.966.547

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	5.893.000	5.881.340	Sands China Ltd 5.375% 08-Aug-2025	6.704.000	6.566.617
Tenneco Inc '144A' 8.000% 17-Nov-2028	5.507.000	4.661.273	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	6.070.000	5.771.407
Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	4.570.000	4.615.523	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	5.864.000	5.655.850
Ford Motor Credit Co LLC	4.493.000	4.524.939	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	5.001.000	4.806.771
Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	4.463.000	4.128.162	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 06-Mar-2030	4.493.000	4.543.245
Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 10.500% 15-Feb-2028	4.051.000	4.047.284	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	4.238.000	4.517.906
TransDigm Inc '144A' 6.750% 15-Aug-2028	3.895.000	3.906.026	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	3.546.000	4.301.572
Cloud Software Group Inc '144A' 9.000% 30-Sep-2029	4.572.000	3.889.667	Sprint LLC 7.625% 15-Feb-2025	2.970.000	3.058.273
CVR Energy Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2029	3.831.000	3.831.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	2.979.000	3.017.951
Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	3.879.000	3.752.214	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	2.682.000	2.931.495
Venture Global LNG Inc '144A' 8.125% 01-Jun-2028	3.549.000	3.539.225	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	2.970.000	2.697.451
Enova International Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2028	3.511.000	3.477.926	Sprint LLC 7.625% 01-Mar-2026	2.433.000	2.565.686
Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.875% 15-Aug-2026	3.461.000	3.466.204	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	2.551.500	2.504.799
United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	3.615.000	3.446.605	Sands China Ltd 4.300% 08-Jan-2026	2.643.000	2.487.743
DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	3.366.000	3.441.344	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	2.523.000	2.458.955
Venture Global LNG Inc '144A' 9.500% 01-Feb-2029	3.272.000	3.309.587	Ford Motor Credit Co LLC 6.950 % 06-Mar-2026	2.426.000	2.437.515
Adams Homes Inc '144A' 9.250% 15-Oct-2028	3.282.000	3.282.000	Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	2.430.000	2.361.540
Ball Corp 6.000% 15-Jun-2029	3.119.000	3.118.866	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	2.480.000	2.330.667
American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	3.100.000	3.051.330	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	3.033.000	2.301.673
Olympus Water US Holding Corp '144A' 9.750% 15-Nov-2028	3.050.000	3.050.812	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 10.500% 15-Feb-2028	2.296.000	2.259.451

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	179.869.544	179.869.544	Sands China Ltd 5.375% 08-Aug-2025	192.934.544	192.934.544
HDFC Bank Ltd/Gandhinagar 'EMTN' 5.686% 02-Mar-2026	15.000.000	15.000.000	Sands China Ltd 5.650% 08-Aug-2028	15.000.000	15.082.775
United States Treasury Note/Bond 3.875% 15-May-2043	8.300.000	7.073.729	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	7.740.000	6.884.907
Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	4.870.000	4.599.442	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Apr-2030	4.800.000	4.457.496
Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	4.550.000	4.549.171	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 06-Mar-2030	5.000.000	4.173.624
United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	4.800.000	4.358.047	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	4.000.000	3.973.560
Multibank Inc 'REGS' 7.750% 03-Feb-2028	3.422.000	3.387.301	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	4.000.000	3.910.500
United States Treasury Note/Bond 3.625% 15-Feb-2053	3.250.000	3.014.747	Sprint LLC 7.625% 15-Feb-2025	5.530.000	3.757.338
Standard Chartered Plc '144A' FRN 6.301% 09-Jan-2029	3.000.000	3.000.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	4.000.000	3.722.505
First Abu Dhabi Bank PJSC FRN 6.320% 04-Apr-2034	3.000.000	3.000.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	3.550.000	3.559.215
Türkiye Sinai Kalkınma Bankası AS 'REGS' 9.375% 19-Oct-2028	3.000.000	2.984.550	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	3.500.000	3.448.050
Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	3.000.000	2.852.602	Sprint LLC 7.625% 01-Mar-2026	3.500.000	3.423.557
OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN 8.750% 15-May-2033	2.800.000	2.783.676	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	4.000.000	3.231.096
Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	2.800.000	2.765.588	Sands China Ltd 4.300% 08-Jan-2026	3.929.000	3.159.695
Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	3.151.500	2.694.151	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	3.200.000	3.145.500
ORLEN SA 'EMTN' 4.750% 13-Jul-2030	2.500.000	2.677.047	Ford Motor Credit Co LLC 6.950 % 06-Mar-2026	4.107.000	3.108.793
Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN 3.343% 02-Oct-2031	3.000.000	2.671.308	Triumph Group Inc '144A' 9.000% 15-Mar-2028	4.000.000	3.088.200
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	2.800.000	2.639.474	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	3.200.000	3.068.180
First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 15-Oct-2027	2.700.000	2.566.500	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	3.000.000	3.043.910
Limak Iskenderun Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036	2.699.162	2.388.758	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 10.500% 15-Feb-2028	3.061.000	3.038.313

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	2.310.000	2.273.152	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	2.310.000	2.278.766
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	1.825.000	1.749.218	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	1.825.000	1.781.000
United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	1.561.700	1.437.320	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	1.420.000	1.408.814
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	1.420.000	1.406.080	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	1.050.000	1.040.645
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	1.050.000	1.026.137	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	950.000	942.910
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	975.000	933.867	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	975.000	892.959
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Sep-2023	950.000	929.259	Qatar Government International Bond 'REGS' 4.817% 14-Mar-2049	900.000	840.838
Türkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	650.000	646.347	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	775.000	635.228
United States Treasury Note/Bond 3.125% 15-Aug-2025	650.000	632.330	Philippine Government International Bond 4.625% 17-Jul-2028	525.000	530.250
Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	775.000	625.400	Mexico Government International Bond 4.400% 12-Feb-2052	672.000	518.838
Saudi Government International Bond 'REGS' 5.000% 18-Jan-2053	600.000	557.868	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	500.000	489.245
Indonesia Government International Bond 3.850% 15-Oct-2030	550.000	519.750	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	500.000	482.609
Philippine Government International Bond 4.625% 17-Jul-2028	525.000	516.758	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	450.000	445.072
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	500.000	486.885	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	550.000	421.850
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Oct-2023	450.000	442.865	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	440.000	416.680
Romanian Government International Bond 'REGS' 5.000% 27-Sep-2026	400.000	436.993	Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	400.000	406.500
CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	400.000	400.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 7.750% 18-Apr-2035	400.000	401.000
Hazine Mustesartiligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 8.509% 14-Jan-2029	400.000	400.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS' 5.950% 14-Jan-2031	400.000	400.100
Bahrain Government International Bond 'REGS' 7.750% 18-Apr-2035	400.000	400.000	Colombia Government International Bond 7.500% 02-Feb-2034	400.000	399.800
Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	400.000	399.992	Brazilian Government International Bond 6.000% 20-Oct-2033	400.000	394.522
Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS' 5.950% 14-Jan-2031	400.000	397.068	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 7.300% 13-Nov-2054	400.000	390.520
Gaci First Investment Co 4.750% 14-Feb-2030	400.000	395.780	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	400.000	383.750
Brazilian Government International Bond 6.000% 20-Oct-2033	400.000	395.396	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	400.000	364.600
MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	400.000	395.196	Perusahaan Listrik Negara PT 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042	400.000	359.000
Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	400.000	395.084	Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	350.000	351.400
Colombia Government International Bond 7.500% 02-Feb-2034	400.000	391.982	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	400.000	349.218
Costa Rica Government International Bond 'REGS' 7.300% 13-Nov-2054	400.000	379.152			
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 'REGS' 4.600% 02-Nov-2047	400.000	353.400			
Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	350.000	349.549			
Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	1.162.578	346.049			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	38.018.039	1.934.700	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	1.410.000	1.396.073
Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	25.000.000	1.410.402	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	23.253.995	1.137.045
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	1.410.000	1.387.508	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2025	5.762.000	1.131.119
Republic of Poland Government Bond 7.500% 25-Jul-2028	3.550.000	975.920	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	6.150.000	892.074
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	860.000	851.569	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	860.000	853.368
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	15.600.000	821.309	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	5.560.000	811.629
Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	327.000.000	769.032	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	302.580.000	755.224
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	750.000	732.936	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	979.850.000	749.759
Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	956.000.000	716.143	Mexican Bonos 8.000% 31-Jul-2053	14.868.600	742.248
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	3.851.000	701.091	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	750.000	734.207
Republic of Poland Government Bond 1.750% 25-Apr-2032	4.225.000	685.185	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	2.643.000.000	595.190
Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	2.590.000	603.913	Republic of Poland Government Bond 1.750% 25-Apr-2032	3.063.000	585.247
Romania Government Bond 5.000% 12-Feb-2029	2.700.000	545.002	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	331.890.000	554.321
Mexican Bonos 8.000% 31-Jul-2053	10.735.000	526.151	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	8.076.045	507.514
Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	3.445.700.000	483.910	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	475.000	458.416
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	475.000	454.751	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2029	2.208.000	440.071
Türkiye Government Bond 31.080% 08-Nov-2028	10.961.000	403.764	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	8.311.300	436.046
Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	15.083.000	370.843	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	8.907.923	398.600
Czech Republic Government Bond 5.500% 12-Dec-2028	7.000.000	320.797	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	8.700.000	379.625
Dominican Republic International Bond 'REGS' 11.250% 15-Sep-2035	17.750.000	313.327	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	6.613.800	345.806
Republic of Poland Government Bond 6.000% 25-Oct-2033	1.200.000	308.157	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	8.751.487	341.861
Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	1.390.000	292.273	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	1.580.000	319.916
Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	6.000.000	290.747	Romania Government Bond 5.000% 12-Feb-2029	1.605.000	315.790
Czech Republic Government Bond 4.500% 11-Nov-2032	6.770.000	284.271	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	6.000.000	313.900
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2029	1.500.000	283.464	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2033	1.625.000	286.532
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	285.000.000	279.699	Republic of Poland Government Bond 6.000% 25-Oct-2033	1.200.000	276.079
Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2027	126.250.000	278.520	Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	1.200.000	267.135
Türkiye Government Bond 12.600% 01-Oct-2025	11.000.000	270.508	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	107.000.000	250.023
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2033	1.625.000	262.080	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	3.495.000.000	227.136
Republic of South Africa Government Bond 8.250% 31-Mar-2032	5.750.000	259.282	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	1.199.000	223.942
Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Apr-2040	3.517.000.000	247.055	Dominican Republic International Bond 'REGS' 11.250% 15-Sep-2035	9.750.000	182.923
Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	113.750.000	221.020	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	1.410.000	1.396.073
Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	7.800.000	217.442	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	23.253.995	1.137.045
China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	1.340.000	215.065			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	2.000.000	1.958.391	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Aug-2023	2.000.000	1.968.180
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	1.575.000	1.542.926	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	7.439.000	1.392.167
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	1.400.000	1.349.134	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	1.375.000	1.340.429
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Mar-2024	1.375.000	1.333.294	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	1.150.000	1.135.270
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2023	1.150.000	1.131.656	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	1.000.000	982.889
Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	17.900.000	1.006.636	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	19.950.000	968.091
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2023	1.000.000	976.899	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-May-2024	950.000	915.117
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	700.000	693.138	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	700.000	694.712
Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	285.000.000	670.258	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	909.280.000	693.754
Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	738.000.000	553.913	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	265.000.000	660.276
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	11.794.208	550.587	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	650.000	634.884
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2025	2.675.000	520.469	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	311.310.000	521.480
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2033	2.690.000	431.490	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2033	2.690.000	474.321
CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	400.000	400.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	8.000.000	408.570
Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	400.000	399.992	Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	400.000	406.500
Turkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	400.000	397.752	Turkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	400.000	406.190
Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS' 5.950% 14-Jan-2031	400.000	397.068	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS' 5.950% 14-Jan-2031	400.000	401.550
Brazilian Government International Bond 6.000% 20-Oct-2033	400.000	395.396	Brazilian Government International Bond 6.000% 20-Oct-2033	400.000	394.522
MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	400.000	395.196	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	595.000	392.148
Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	400.000	395.084	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 7.300% 13-Nov-2054	400.000	390.520
Costa Rica Government International Bond 'REGS' 7.300% 13-Nov-2054	400.000	379.152	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	400.000	364.600
Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	1.590.000	369.682			
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	1.825.000	350.235			
Export-Import Bank of India 'REGS' 5.500% 18-Jan-2033	350.000	349.549			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	25.163.550	25.163.550	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	26.346.366	26.346.366
Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	370.000.000	870.159	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2025	9.693.000	1.835.430
Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	1.006.000.000	755.698	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	20.807.300	1.003.817
Mexican Bonos 5.000% 06-Mar-2025	14.200.000	688.779	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	22.559.700	998.197
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	3.449.000	618.926	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	1.282.850.000	980.844
Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 1.700% 02-Mar-2031	700.000	577.500	Hungary Government Bond 4.500% 23-Mar-2028	347.660.000	868.314
Turkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	550.000	546.909	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	14.825.032	835.976
Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	525.000	524.990	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	468.700.000	789.925
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	500.000	500.000	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	800.000	711.418
Romania Government Bond 8.000% 29-Apr-2030	1.980.000	460.088	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	700.000	666.540
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	9.200.000	453.383	Qatar Government International Bond 'REGS' 4.817% 14-Mar-2049	700.000	659.278
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Apr-2024	450.000	442.691	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9.761% 01-Jan-2029	3.300.000	650.633
Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	500.000	405.450	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	9.639.000.000	629.567
CSN Resources SA 'REGS' 8.875% 05-Dec-2030	400.000	400.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	750.000	628.091
Saudi Government International Bond 'REGS' 4.750% 18-Jan-2028	400.000	398.612	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 1.700% 02-Mar-2031	700.000	593.044
Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS' 5.950% 14-Jan-2031	400.000	397.068	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	11.100.000	560.163
Brazilian Government International Bond 6.000% 20-Oct-2033	400.000	395.396	Turkiye Government International Bond 9.375% 14-Mar-2029	550.000	555.958
MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.875% 01-May-2034	400.000	395.196	Mexico Government International Bond 6.338% 04-May-2053	525.000	532.938
Medco Maple Tree Pte Ltd 'REGS' 8.960% 27-Apr-2029	400.000	395.084	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031	550.000	520.421
Turkiye Government International Bond 9.375% 19-Jan-2033	400.000	390.552	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	9.200.000	465.397

BNY Mellon Euroland Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Dec-2023	20.100.000	19.860.303	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Dec-2023	20.100.000	19.926.666
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	12.130.000	11.959.590	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	12.130.000	11.962.601
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.800% 15-Apr-2026	9.600.000	9.672.484	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.800% 15-Apr-2026	7.840.000	7.914.085
Spain Government Bond '144A' 3.150% 30-Apr-2033	8.228.000	8.169.942	Spain Government Bond '144A' 0.700% 30-Apr-2032	8.380.000	7.101.770
Spain Government Bond '144A' 1.400% 30-Apr-2028	8.060.000	7.446.262	Sweden Government Bond 0.750% 12-May-2028	91.165.000	6.916.532
Sweden Government Bond 0.750% 12-May-2028	91.165.000	7.429.721	Spain Government Bond (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2028	7.766.000	6.738.833
Spain Government Bond (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2028	7.766.000	6.803.428	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	5.736.000	5.780.350
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	6.700.000	6.649.210	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	116.000.000	5.500.189
French Republic Government Bond OAT 3.500% 25-Nov-2033	6.475.000	6.574.068	Netherlands Government Bond '144A' 2.500% 15-Jul-2033	4.860.000	4.756.336
Republic of Austria Government Bond '144A' 2.900% 20-Feb-2033	6.200.000	6.019.847	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.500% 15-Jul-2028	5.687.000	4.747.876
Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	5.736.000	5.723.496	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.000% 15-Aug-2023	4.600.000	4.590.100
Netherlands Government Bond '144A' 2.500% 15-Jul-2033	4.860.000	4.765.959	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 2.500% 19-Nov-2025	4.500.000	4.419.990
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.000% 15-Aug-2023	4.600.000	4.587.240	Republic of Austria Government Bond '144A' 2.900% 20-Feb-2033	4.500.000	4.346.190
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.600% 01-Aug-2031	5.800.000	4.396.400	French Republic Government Bond OAT 0.500% 25-May-2025	4.500.000	4.281.885
Finland Government Bond '144A' 3.000% 15-Sep-2033	4.420.000	4.388.411	French Republic Government Bond OAT (Zero Coupon) 0.000% 25-Feb-2027	4.650.000	4.141.383
Spain Government Bond '144A' 0.700% 30-Apr-2032	3.940.000	3.490.347	Ireland Government Bond 0.200% 18-Oct-2030	4.075.000	3.382.067
French Republic Government Bond OAT '144A' 3.000% 25-May-2054	3.610.000	3.133.465	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.600% 01-Aug-2031	4.300.000	3.353.961
Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	530.000.000	2.641.468	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15-Feb-2027	3.400.000	3.143.504
French Republic Government Bond OAT '144A' 0.750% 25-May-2053	4.800.000	2.420.640	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2029	3.600.000	3.006.360
Netherlands Government Bond '144A' 2.000% 15-Jan-2054	2.740.000	2.320.214	Spain Government Bond (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2027	3.000.000	2.699.940
Bundesobligation 2.200% 13-Apr-2028	2.270.000	2.235.824	Spain Government Bond '144A' 1.400% 30-Jul-2028	2.800.000	2.600.976
			French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Feb-2028	2.780.000	2.476.313
			French Republic Government Bond OAT 3.500% 25-Nov-2033	2.345.000	2.402.215
			German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jan-2024	2.400.000	2.393.422
			Bundesobligation 2.200% 13-Apr-2028	2.270.000	2.253.870

BNY Mellon European Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Bundesobligation 2.200% 13-Apr-2028	2.720.000	2.688.522	Bundesobligation 2.200% 13-Apr-2028	2.720.000	2.675.213
Bundesobligation (Zero Coupon) 0.000% 10-Apr-2026	1.200.000	1.113.432	Bundesobligation (Zero Coupon) 0.000% 10-Apr-2026	1.200.000	1.118.064
Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	1.000.000	936.715	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	700.000	694.106
CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.000% 19-Jul-2029	700.000	706.191	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 5.750% 23-Aug-2033	600.000	605.172
BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Jun-2172	770.000	685.374	UBS Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	565.000	549.570
Credit Agricole SA 'EMTN' FRN 5.500% 28-Aug-2033	600.000	601.431	Verizon Communications Inc 4.750% 31-Oct-2034	520.000	540.458
Banco Santander SA 'EMTN' FRN 5.750% 23-Aug-2033	600.000	597.745	Credit Agricole SA FRN 0.625% 12-Jan-2028	600.000	531.318
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Mar-2024	575.000	568.853	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 4.250% 29-Mar-2029	500.000	499.929
Tesco Corporate Treasury Services PLC 'EMTN' 0.875% 29-May-2026	590.000	540.028	BPCE SA 'EMTN' 3.625% 17-Apr-2026	500.000	494.873
BPCE SA 'EMTN' 3.625% 17-Apr-2026	500.000	499.250	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	386.046	477.674
BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.125% 26-Sep-2032	500.000	496.930	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	470.000	474.883
Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 4.250% 29-Mar-2029	500.000	495.968	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	500.000	466.930
CaixaBank SA 'EMTN' FRN 6.125% 30-May-2034	500.000	494.093	Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	500.000	462.400
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	3.204	493.699	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	400.000	427.266
Infineon Technologies AG 0.625% 17-Feb-2025	500.000	474.655	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	404.000	414.532
HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.787% 10-Mar-2032	470.000	473.196	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.000% 19-Jul-2029	400.000	399.824
UBS Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	420.000	465.711	Permanent TSB Group Holdings PLC 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	400.000	399.082
JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	540.000	459.646	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	450.000	398.502
Heineken NV 'EMTN' 3.875% 23-Sep-2030	456.000	457.165	Engie SA 'EMTN' 4.000% 11-Jan-2035	400.000	396.100
Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.125% 10-Mar-2028	500.000	438.700	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.750% 01-Feb-2033	400.000	384.932

BNY Mellon Floating Rate Credit Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	73.173	7.267.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Liquidity Fund	60.069	5.988.011
Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	790.000	726.364	Banijay Entertainment SASU FRN 8.097% 25-Apr-2028	500.000	501.900
WP/AP Telecom Holdings IV B.V. Term Loan 0.000% 31-Mar-2029	508.333	504.470	Air France-KLM 'EMTN' 7.250% 31-May-2026	400.000	414.610
Ytinrete BidCo AB FRN 10.931% 12-Jul-2028	500.000	503.500	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	400.000	392.760
Banijay Entertainment SASU FRN 0.004% 25-Apr-2028	500.000	500.625	Aker ASA FRN 6.600% 22-Nov-2024	4.500.000	392.298
Albion Financing 3 S.a r.l. (Albion Financing LLC) 2023-B Incremental Euro Term Loan 0.000% 16-Aug-2026	500.000	497.500	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	400.000	388.758
Villa Dutch Bidco House of HR Group B.V. Term Loan 0.000% 03-Nov-2029	500.000	493.750	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 06-Mar-2030	400.000	379.974
Windsor Holdings III LLC Term Loan 8.345% 21-Jun-2030	500.000	492.500	Burger King France SAS 'REGS' FRN 8.475% 01-Nov-2026	375.000	378.750
Assemblin Group AB 'REGS' FRN 0.000% 05-Jul-2029	500.000	489.625	Cedacri Mergeco SPA 'REGS' FRN 8.424% 15-May-2028	375.000	360.000
Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Jun-2172	600.000	486.750	Avantor Funding Inc '144A' 3.875 % 15-Jul-2028	375.000	344.813
PEARLS (Netherlands) Bidco B.V. - Caldic BV EUR Term Loan 6.742% 26-Feb-2029	500.000	483.750	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' FRN 8.413% 15-Oct-2026	375.000	328.125
Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 10.000% 11-Oct-2028	400.000	462.464	Aker Solutions ASA FRN 7.720% 03-Jun-2024	3.000.000	256.562
Arconic Corp '144A' 0.000% 27-Jul-2030	500.000	460.832	ZF North America Capital Inc '144A' 6.875 % 14-Apr-2028	250.000	229.571
Avis Budget Finance Plc 'REGS' 7.250% 31-Jul-2030	450.000	449.750	Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	200.000	182.600
InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	500.000	443.125	GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV 'REGS' 8.500% 15-Jan-2031	136.000	159.578
Aker Horizons ASA FRN 7.070% 15-Aug-2025	5.000.000	414.911	Arsenal AIC Parent LLC '144A' 8.000% 01-Oct-2030	168.000	154.902
Benteler International AG '144A' 10.500% 15-May-2028	450.000	412.258	Assemblin Group AB 'REGS' FRN 8.964% 05-Jul-2029	100.000	101.091
Air France-KLM 'EMTN' 7.250% 31-May-2026	400.000	411.660	Ytinrete BidCo AB FRN 10.931% 12-Jul-2028	100.000	98.500
SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 9.500% 15-Jul-2028	400.000	409.000	Arconic Corp '144A' 9.856% 27-Jul-2030	1.250	1.132
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	450.000	400.815			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Food Innovation Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Roper Technologies Inc	98	42.763	BioMarin Pharmaceutical Inc	23.563	2.276.056
Zoetis Inc	237	39.920	ImmunoGen Inc	79.341	2.121.068
Reckitt Benckiser Group PLC	483	34.973	Crinetics Pharmaceuticals Inc	54.615	1.814.077
Danaher Corp	120	30.066	Eli Lilly & Co	3.667	1.736.530
Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	13	24.349	Sanofi SA ADR	31.845	1.529.824
AutoStore Holdings Ltd '144A'	16.412	23.638	Alnylam Pharmaceuticals Inc	8.225	1.529.531
Veolia Environnement SA	745	23.185	AstraZeneca PLC	10.943	1.474.782
Illumina Inc	93	17.359	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.806	1.436.033
Veralto Corp	207	16.047	Legend Biotech Corp ADR	20.756	1.373.752
Meituan '144A'	800	13.158	Danaher Corp	5.435	1.178.147
Novozymes A/S	195	9.904	Insmed Inc	42.140	1.146.041
TOMRA Systems ASA	587	9.678	Seagen Inc	6.019	1.124.005
Kubota Corp	400	6.092	Biogen Inc	4.076	1.064.786
Corteva Inc	98	5.592	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	25.593	1.054.119
Twist Bioscience Corp	293	5.252	Repligen Corp	6.483	1.025.443
DSM-Firmenich AG	44	4.584	Health Care Select Sector SPDR Fund - ETF	7.795	1.009.049
Kerry Group PLC	39	3.908	Gilead Sciences Inc	12.496	979.257
PepsiCo Inc	16	2.994	Rocket Pharmaceuticals Inc	33.758	888.361
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	751	2.920	Merck KGaA	4.338	838.545
Archer-Daniels-Midland Co	34	2.909	Cytokinetics Inc	23.697	809.770
			Sarepta Therapeutics Inc	8.905	784.260
			Bio-Techne Corp	10.285	736.467
			Pacific Biosciences of California Inc	89.783	729.703
			AbbVie Inc	4.705	714.845
			Denali Therapeutics Inc	32.994	707.174
			Moderna Inc	4.869	689.796
			Illumina Inc	5.341	672.566
			Keros Therapeutics Inc	18.733	670.990
			UCB SA	8.525	668.674
			Lonza Group AG	1.133	662.334
			Kymira Therapeutics Inc	21.480	639.171
			Ambrx Biopharma Inc	47.433	587.750
			uniQure NV	29.218	583.890
			10X Genomics Inc	12.828	565.724
			PTC Therapeutics Inc	17.850	529.291
			Intellia Therapeutics Inc	17.596	527.877
			IQVIA Holdings Inc	2.608	498.570
			Laboratory Corp of America Holdings	2.124	463.651

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Earth Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Greencoat UK Wind PLC/Funds	58.691	115.209	Greencoat UK Wind PLC/Funds	76.707	142.312
SSE PLC	3.094	64.258	Hubbell Inc - Class B	404	104.885
Dassault Systemes SE	1.430	58.128	Ingersoll Rand Inc	1.599	101.789
Danaher Corp	214	53.428	Trane Technologies PLC	457	89.357
Voltronic Power Technology Corp	1.000	53.272	Danaher Corp	443	87.980
Alcoa Corp	1.039	47.320	Voltronic Power Technology Corp	2.000	87.757
SolarEdge Technologies Inc	177	34.872	NextEra Energy Inc	1.358	77.241
Orsted AS '144A'	344	31.549	SSE PLC	3.626	72.554
Enphase Energy Inc	144	29.008	Novozymes A/S	1.438	70.611
Novozymes A/S	557	27.342	TE Connectivity Ltd	548	68.968
Vestas Wind Systems A/S	719	21.336	Dassault Systemes SE	1.430	61.360
Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	3.386	17.073	Deere & Co	161	60.461
Denso Corp	300	16.559	Toyota Industries Corp	800	57.327
MP Materials Corp	623	15.553	RWE AG	1.112	49.546
Ebara Corp	300	12.776	Infineon Technologies AG	1.370	42.748
WEG SA	1.597	11.961	Smurfit Kappa Group PLC	1.075	42.188
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	400	11.721	Neste Oyj	1.204	40.887
Samsung SDI Co Ltd	20	10.835	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	1.240	40.829
Aker Carbon Capture ASA	6.261	9.625	Samsung SDI Co Ltd	90	40.319
Albemarle Corp	35	7.462	Legrand SA	445	39.421
Greencoat UK Wind PLC/Funds	58.691	115.209	Albemarle Corp	237	36.005
			Darling Ingredients Inc	834	35.685
			Daikin Industries Ltd	200	35.231
			OZ Minerals Ltd	1.725	34.359
			WEG SA	4.852	32.072
			Vestas Wind Systems A/S	1.249	31.173
			Orsted AS '144A'	809	30.913
			Trimble Inc	728	30.658
			Alcoa Corp	1.039	29.561
			DSM BV	235	29.060
			LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	9.080	28.971
			Genuit Group PLC	6.993	23.505
			Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	3.386	22.359
			Kurita Water Industries Ltd	700	22.153
			Ecolab Inc	117	20.590
			Greencoat UK Wind PLC/Funds	76.707	142.312
			Hubbell Inc - Class B	404	104.885

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Life Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Restaurant Brands International Inc	1.953	133.214	Eli Lilly & Co	279	149.514
Gilead Sciences Inc	786	63.486	Restaurant Brands International Inc	1.953	132.850
Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	1.001	54.671	Boston Scientific Corp	2.279	118.334
BioMarin Pharmaceutical Inc	564	54.586	SCOR SE	2.921	79.855
UCB SA	547	49.920	Humana Inc	166	78.843
Ross Stores Inc	457	48.631	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	1.001	78.301
Voya Financial Inc	673	47.486	Novo Nordisk A/S	742	75.479
Grocery Outlet Holding Corp	1.537	47.354	Gilead Sciences Inc	964	74.574
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	5.735	43.140	Prudential PLC	6.183	73.695
Baxter International Inc	920	42.170	AIA Group Ltd	7.800	73.327
Medtronic PLC	453	38.447	MetLife Inc	1.034	73.102
Regeneron Pharmaceuticals Inc	46	35.716	Roche Holding AG	232	71.066
AbbVie Inc	237	35.672	Danaher Corp	335	70.629
iRhythm Technologies Inc	287	31.861	Johnson & Johnson	407	70.513
Chewy Inc - Class A	712	28.645	AbbVie Inc	496	69.790
Hermes International SCA	13	27.973	UnitedHealth Group Inc	138	69.707
Zoetis Inc	159	27.242	Becton Dickinson & Co	293	69.156
Merck & Co Inc	245	26.274	Zurich Insurance Group AG	146	68.133
Burlington Stores Inc	152	25.088	Regeneron Pharmaceuticals Inc	84	67.243
Inspire Medical Systems Inc	84	22.484	Dexcom Inc	660	66.874
Booking Holdings Inc	8	20.304	Intuitive Surgical Inc	228	65.634
Repligen Corp	104	18.771	Sanofi SA	692	63.638
Alkermes PLC	608	17.836	AstraZeneca PLC	474	61.021
Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	68	17.441	BioMarin Pharmaceutical Inc	716	60.930
ConvaTec Group PLC '144A'	5.736	16.453	Edwards Lifesciences Corp	738	56.325
Centene Corp	222	15.145	Ross Stores Inc	457	56.203
AstraZeneca PLC	106	14.979	EssilorLuxottica SA	268	49.830
SCOR SE	528	14.759	Alcon Inc	636	49.018
Evolent Health Inc - Class A	468	13.909	Cooper Cos Inc/The	136	48.200
Laboratory Corp of America Holdings	66	13.320	Zoetis Inc	271	46.403
Novo Nordisk A/S	73	13.065	Voya Financial Inc	673	45.894
EssilorLuxottica SA	68	12.735	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	5.735	43.683
Petco Health & Wellness Co Inc - Class A	1.226	12.699	Medtronic PLC	604	43.349
Becton Dickinson & Co	48	12.430	Merck & Co Inc	403	43.114
ICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	1.743	11.813	Booking Holdings Inc	14	42.420
			ICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	6.528	41.704
			Grocery Outlet Holding Corp	1.537	41.293
			Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	236	41.091
			UCB SA	547	40.734
			Chubb Ltd	193	37.167
			Alkermes PLC	1.432	37.142
			ResMed Inc	216	36.562
			Baxter International Inc	920	31.303

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	29.440.000	26.907.415	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	33.090.000	30.213.948
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.844% 31-Jan-2025	23.240.000	23.259.118	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	26.662.228	24.776.235
Denmark Government Bond 2.250% 15-Nov-2033	122.380.000	16.641.086	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.521% 31-Jan-2025	23.240.000	23.279.532
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	17.312.250	16.193.723	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	15.962.500	15.154.437
United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.538% 31-Jul-2025	16.040.000	16.027.459	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	18.347.600	14.344.472
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	2.689.000.000	13.269.683	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.768% 31-Jul-2024	14.320.000	14.307.616
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	13.877.600	11.412.262	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.538% 31-Jul-2025	12.400.000	12.392.240
United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	11.910.000	11.330.772	Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	1.795.500.000	11.263.776
Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	2.206.750.000	11.193.862	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	14.420.000	10.514.992
Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	1.929.800.000	11.096.307	Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029	77.160.000	9.648.820
Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	16.510.000	9.109.177	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	168.000.000	9.151.156
New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	17.170.000	8.682.943	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.598% 31-Jan-2024	8.980.000	8.977.765
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	8.101.456	8.665.980	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	174.000.000	8.952.227
Canada Housing Trust No 1 '144A' 0.950% 15-Jun-2025	12.440.000	8.476.437	United States Treasury Note/Bond 0.875% 30-Sep-2026	9.830.000	8.905.475
Norway Government Bond '144A' 1.750% 13-Mar-2025	91.270.000	8.404.679	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.298% 15-Mar-2027	11.460.000	8.436.719
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	6.493.000	7.755.904	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	17.110.000	8.019.457
Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	113.723.000.000	7.241.684	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	1.411.000.000	7.346.395
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	7.470.000	7.060.528	Japan Government Thirty Year Bond 1.000% 20-Mar-2052	1.035.500.000	6.951.342
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	130.000.000	6.940.279	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 5.489% 14-Apr-2026	5.300.000	5.293.575
United States Treasury Strip Principal (Zero Coupon) 0.000% 15-May-2043	15.490.000	6.289.878	Norway Government Bond '144A' 3.500% 06-Oct-2042	51.544.000	4.948.776
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	5.077.865	6.207.029	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	5.710.000	4.847.701
New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-May-2031	12.170.000	6.098.266	United Kingdom Gilt 3.750% 22-Oct-2053	4.220.000	4.712.137
Canada Housing Trust No 1 '144A' 3.800% 15-Jun-2027	7.700.000	5.759.794	International Bank for Reconstruction & Development FRN 5.773% 19-Aug-2027	4.630.000	4.646.205
Sweden Inflation Linked Bond 3.500% 01-Dec-2028	33.280.000	5.711.109	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	4.532.000	4.628.861
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jan-2031	5.798.953	5.291.421	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	4.593.779	4.544.970
United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	4.200.000	5.207.064	International Bank for Reconstruction & Development FRN 5.634% 22-Nov-2028	4.430.000	4.413.742
New Zealand Government Bond 1.750% 15-May-2041	12.130.000	4.942.324	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	5.570.000	4.292.734
United Kingdom Gilt 3.750% 22-Oct-2053	4.220.000	4.941.247	Spain Government Bond '144A' 2.550% 31-Oct-2032	4.190.000	4.048.655
Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	20.470.000	4.843.313	Indonesia Government International Bond 1.750% 24-Apr-2025	3.860.000	4.034.512
Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029	36.190.000	4.622.880			

BNY Mellon Global Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	416.721.947	416.721.947	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	424.963.164	424.963.164
iShares USD Corp Bond UCITS ETF	699.092	71.562.041	iShares USD Corp Bond UCITS ETF	225.566	21.820.984
United States Treasury Note/Bond 4.750% 15-Nov-2043	40.570.000	43.541.598	United States Treasury Note/Bond 3.250% 30-Jun-2027	20.047.300	19.516.958
United States Treasury Note/Bond 3.500% 31-Jan-2028	40.551.900	39.780.049	United States Treasury Note/Bond 3.000% 31-Jul-2024	18.980.000	18.648.978
United States Treasury Note/Bond 4.500% 15-Nov-2033	24.000.000	25.251.563	United States Treasury Note/Bond 4.000% 15-Dec-2025	17.825.700	17.617.442
iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF	197.336	25.165.856	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-May-2027	16.300.000	15.253.344
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-Aug-2028	26.385.000	24.583.399	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	10.310.000	11.079.084
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.700% 15-Aug-2032	17.000.000	17.895.289	United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028	9.610.800	8.853.641
United States Treasury Note/Bond 4.000% 15-Dec-2025	17.825.700	17.538.704	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.700% 15-Aug-2032	7.834.231	8.249.168
United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028	18.000.000	16.657.031	Waste Management Inc 4.875% 15-Feb-2034	8.280.000	8.017.855
BNI Finance BV 3.875% 01-Dec-2030	8.479.000	9.329.808	United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2027	8.250.000	7.585.639
Kering SA 'EMTN' 3.625% 05-Sep-2031	8.600.000	9.328.421	Mizuho Financial Group Inc 'emtn' 4.416% 20-May-2033	5.850.000	6.224.967
BPCE SA 'REGS' FRN 7.003% 19-Oct-2034	9.095.000	9.231.160	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 4.625% 03-May-2031	5.600.000	5.984.181
Leasys SpA 'EMTN' 4.625% 16-Feb-2027	8.416.000	9.169.157	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	5.930.000	5.763.377
Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 4.375% 03-May-2033	7.640.000	8.426.698	Heineken NV 'EMTN' 4.125% 23-Mar-2035	5.234.000	5.763.059
Waste Management Inc 4.875% 15-Feb-2034	8.280.000	8.155.966	Unilever Capital Corp 5.000% 08-Dec-2033	5.600.000	5.725.272
mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	7.400.000	8.034.185	Royal Bank of Canada 'GMTN' 5.000% 02-May-2033	5.490.000	5.223.680
International Distributions Services Plc 5.250% 14-Sep-2028	7.040.000	7.639.015	Goldman Sachs Group Inc/The 'eMTN' 1.250% 07-Feb-2029	5.400.000	4.948.226
Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 4.250% 05-Oct-2033	6.674.000	7.611.811	AT&T Inc 4.300% 18-Nov-2034	4.450.000	4.771.761
Banco Santander SA FRN 1.722% 14-Sep-2027	8.200.000	7.325.824	Bundesschatzanweisungen 0.400% 13-Sep-2024	4.500.000	4.746.188

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	16.240.000	15.327.769	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	16.644.900	15.819.188
iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF	145.300	12.654.837	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.095% 15-Mar-2027	19.915.000	14.885.799
United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	12.440.000	11.816.036	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	15.689.500	12.578.479
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.844% 31-Jan-2025	10.880.000	10.890.605	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.346% 31-Jan-2025	10.880.000	10.895.095
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	10.812.408	10.153.797	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	96.673	9.771.472
United Kingdom Gilt 2.000% 07-Sep-2025	7.100.000	8.512.302	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	8.351.135	8.790.334
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	1.702.000.000	8.405.855	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	11.720.000	8.774.445
United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	9.670.000	8.368.725	Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	11.590.000	8.400.608
Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.095% 15-Mar-2027	10.525.000	7.908.333	United Kingdom Gilt 2.000% 07-Sep-2025	7.100.000	8.282.418
United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	9.320.000	6.714.947	iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF	84.300	7.299.508
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	47.000.000	6.302.146	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	140.000.000	7.221.604
Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	11.470.000	6.300.420	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	6.978.598	6.933.671
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	5.153.003	6.270.665	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	8.000.000	6.921.998
iShares China CNY Bond UCITS ETF	1.110.000	5.737.879	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	7.247.967	6.749.801
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	119.000	5.484.928	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.614% 31-Jan-2024	6.730.000	6.728.119
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	4.834.843	5.144.114	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	5.279.972	6.474.951
Xtrackers USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	328.600	4.152.807	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	9.320.000	5.981.598
Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	865.600.000	3.919.785	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.768% 31-Jul-2024	5.980.000	5.971.772
Brazilian Government International Bond 5.000% 27-Jan-2045	4.880.000	3.822.998	Dexia Credit Local SA 0.500% 22-Jul-2023	4.400.000	5.652.243
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	3.287.318	3.612.922	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	126.070.000	5.633.621
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	67.000.000	3.585.920	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	1.030.000.000	5.362.562
Asian Development Bank 'GMTN' 4.000% 12-Jan-2033	3.460.000	3.555.911	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	119.000	5.267.186
Malaysia Government Bond 4.498% 15-Apr-2030	16.130.000	3.493.373	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.614% 19-Aug-2027	5.010.000	5.027.249
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	61.000	3.452.672	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 4.769% 14-Apr-2026	4.850.000	4.842.835
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	70.000.000	3.442.458	Denmark Government Bond 0.000% 15-Nov-2031	39.160.000	4.486.039
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	3.880.000	3.405.458	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	5.840.000	4.328.493
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	62.500.000	3.348.628	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	27.000.000	4.277.070
New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	6.170.000	3.205.292			
Norway Government Bond '144A' 1.750% 13-Mar-2025	34.830.000	3.199.561			
Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 30-Mar-2027	2.420.000	2.980.573			
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.750% 22-Mar-2034	2.318.518	2.875.278			
Japan Government Forty Year Bond 1.000% 20-Mar-2062	503.200.000	2.713.065			
United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.492% 31-Jul-2025	2.650.000	2.649.712			

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Samsung Electronics Co Ltd	26.536	1.408.257	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	112.000	1.982.250
Meituan '144A'	49.100	958.956	HDFC Bank Ltd	71.742	1.376.843
Tencent Holdings Ltd	18.600	835.850	Tencent Holdings Ltd	31.600	1.321.247
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	46.000	817.919	Meituan '144A'	103.093	1.277.141
ASM International NV	2.121	810.593	Tata Consultancy Services Ltd	27.719	1.189.765
HDFC Bank Ltd	37.333	743.666	Advantest Corp	19.600	1.153.805
XP Inc	39.279	737.741	Info Edge India Ltd	21.856	1.153.718
Sungrow Power Supply Co Ltd	47.400	676.045	ASML Holding NV	1.744	1.150.149
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	165.316	673.382	By-health Co Ltd	407.100	1.133.479
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.635.100	660.621	AIA Group Ltd	124.600	1.107.626
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.779.500	652.376	XP Inc	47.719	1.044.855
AIA Group Ltd	64.600	644.430	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	242.501	935.547
Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	106.822	617.222	Yum China Holdings Inc	18.343	925.138
Yum China Holdings Inc	10.948	595.427	Titan Co Ltd	22.919	901.898
Voltronic Power Technology Corp	12.000	582.166	Samsung Electronics Co Ltd	15.544	815.768
Lam Research Corp	888	576.054	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	137.000	789.944
Titan Co Ltd	16.684	551.976	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	91.100	789.688
Hindustan Unilever Ltd	16.335	499.624	Godrej Consumer Products Ltd	61.937	756.784
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	53.700	499.331	Hindustan Unilever Ltd	24.673	745.993
Pidlite Industries Ltd	16.092	488.045	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	276.310	738.903
WEG SA	60.200	477.481	Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.837.900	718.834
Info Edge India Ltd	8.582	476.620	Samsung SDI Co Ltd	1.754	708.156
ICICI Bank Ltd	38.966	439.462	SK Hynix Inc	9.579	689.768
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	59.536	430.266	ASM International NV	1.574	688.971
Tata Consultancy Services Ltd	9.987	417.372	PB Fintech Ltd	71.584	641.995
Prudential Plc	36.823	396.844	WEG SA	86.085	634.453
Zomato Ltd	398.324	387.272	NetEase Inc	31.000	599.710
ASML Holding NV	539	383.458	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	170.375	568.507
NetEase Inc	18.500	364.708	Marico Ltd	88.052	559.529
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	53.368	360.816	Raia Drogasil SA	100.160	556.219
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	117.738	349.009	Globant SA	2.661	537.573
Proya Cosmetics Co Ltd 'A'	25.400	347.694	Maruti Suzuki India Ltd	4.886	532.349
Dino Polska SA '144A'	3.705	334.970	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	82.600	497.229
Samsung SDI Co Ltd	627	328.503	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	64.839	494.034
Livent Corp	14.839	322.665	NARI Technology Co Ltd 'A'	153.600	486.654
Delta Electronics Inc	30.000	320.844	ICICI Bank Ltd	41.238	472.735
NARI Technology Co Ltd 'A'	90.580	316.572	Sungrow Power Supply Co Ltd	37.000	467.770
Credicorp Ltd	2.011	304.806	MercadoLibre Inc	323	465.465
Globant SA	1.749	298.627	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	8.600	422.855
Clicks Group Ltd	18.380	287.179	Livent Corp	20.804	413.526
Raia Drogasil SA	47.403	286.400	Credicorp Ltd	3.099	406.305
Marico Ltd	41.556	283.116	Clicks Group Ltd	25.508	394.604
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	38.000	275.562	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	89.972	387.336

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC
BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT) Forts.

BNY Mellon Global Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Restaurant Brands International Inc	361.959	23.939.842	RELX Plc	612.843	19.457.599
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	5.866.097	14.550.340	BAE Systems Plc	1.402.075	17.981.134
Publicis Groupe SA	179.033	14.065.484	Restaurant Brands International Inc	264.227	17.688.258
Shell Plc	403.917	12.444.926	Broadcom Inc	18.613	14.456.845
Veolia Environnement SA	387.279	12.053.232	FedEx Corp	61.385	13.453.645
Kenvue Inc	484.307	11.249.303	Cisco Systems Inc	259.050	13.364.109
MediaTek Inc	465.000	10.395.667	British American Tobacco Plc	398.958	13.028.964
Procter & Gamble Co/The	72.084	10.157.766	AstraZeneca Plc	83.328	11.733.968
Paychex Inc	79.295	9.782.681	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	31.020	11.575.387
BT Group Plc	4.492.151	8.604.991	Sage Group Plc/The	988.904	10.876.338
Anglo American Plc	276.811	8.425.817	Comerica Inc	142.382	10.747.636
Sysco Corp	110.712	8.071.518	Svenska Handelsbanken AB	1.088.457	9.961.316
Sanofi SA	79.055	7.523.269	Interpublic Group of Cos Inc/The	262.658	9.759.384
Gilead Sciences Inc	92.840	7.373.779	Deutsche Post AG	196.970	9.645.299
Roche Holding AG	24.069	7.075.569	Marathon Petroleum Corp	66.702	9.022.872
Chemours Co/The	201.726	6.793.550	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	3.172.361	8.791.833
Johnson Controls International plc	115.633	6.665.642	Sanofi SA	81.056	8.740.175
Allstate Corp/The	60.139	6.577.307	Industria de Diseno Textil SA	242.332	8.543.931
Carter's Inc	97.217	6.424.070	Zurich Insurance Group AG	17.641	8.452.421
Chroma ATE Inc	926.000	6.404.131	MetLife Inc	132.487	7.795.723
Tyson Foods Inc - Class A	109.984	6.136.082	Continental AG	102.540	7.692.492
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	19.804.400	5.912.046	Hewlett Packard Enterprise Co	479.817	7.633.753
Dominion Energy Inc	96.862	5.787.726	CME Group Inc	37.936	7.456.802
Chesapeake Energy Corp	70.079	5.721.391	Johnson Controls International plc	114.646	7.412.407
PepsiCo Inc	27.428	4.920.152	Fidelity National Information Services Inc	118.484	7.153.880
Kraft Heinz Co/The	135.774	4.878.235	BT Group Plc	4.492.151	7.084.410
Texas Instruments Inc	30.602	4.673.564	Emerson Electric Co	83.615	6.965.939
JPMorgan Chase & Co	32.493	4.404.164	Flowservice Corp	201.654	6.782.738
Medtronic Plc	54.247	4.217.434	Roche Holding AG	22.560	6.721.321
CME Group Inc	23.380	4.198.991	MediaTek Inc	249.000	6.147.216
Credicorp Ltd	31.291	4.111.113	Taylor Wimpey Plc	4.199.844	6.110.862
Nestle SA	35.410	4.102.257	JPMorgan Chase & Co	42.302	5.832.739
Goldman Sachs Group Inc/The	11.217	4.094.089	Medtronic Plc	69.092	5.736.622
Infosys Ltd ADR	247.813	4.020.372	Organon & Co	259.407	5.599.413
Bank Mandiri Persero Tbk PT	6.747.700	3.868.789	Volkswagen AG - Preference	44.315	5.365.582
British American Tobacco Plc	101.348	3.781.196	Goldman Sachs Group Inc/The	16.023	5.310.372
AbbVie Inc	25.006	3.728.097	Insurance Australia Group Ltd	1.447.731	5.264.640
Mercedes-Benz Group AG	52.776	3.644.254	Bayer AG	86.282	5.143.854
Bayer AG	58.731	3.563.390	AbbVie Inc	33.932	5.038.407
Smiths Group Plc	164.992	3.416.847	PepsiCo Inc	27.363	5.003.605
			Exelon Corp	118.079	4.859.319
			Dominion Energy Inc	90.732	4.828.623
			Samsung Electronics Co Ltd - Preference	113.139	4.807.706
			Informa Plc	609.430	4.807.452
			Mercedes-Benz Group AG	62.877	4.798.203
			Enel SpA	733.486	4.784.162
			TotalEnergies SE	73.872	4.737.657

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
LifePoint Health Inc '144A' 9.875% 15-Aug-2030	1.146.000	1.122.805	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	1.120.000	1.008.075
DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	1.152.000	1.108.421	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	1.181.000	987.933
Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.875% 15-Aug-2026	988.000	988.280	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC 'REGS' 4.750% 15-Sep-2024	720.000	909.385
Caesars Entertainment Inc '144A' 7.000% 15-Feb-2030	860.000	867.838	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	890.000	876.166
Venture Global LNG Inc '144A' 8.125% 01-Jun-2028	829.000	826.165	Ally Financial Inc 8.000% 01-Nov-2031	833.000	871.320
Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	837.000	807.688	Societe Generale SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2172	830.000	823.763
Societe Generale SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2172	830.000	791.463	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	792.000	768.244
Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	1.121.000	790.973	PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	723.000	761.645
Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	785.000	766.341	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	725.000	740.000
Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 9.625% 15-Nov-2028	710.000	760.893	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	774.000	720.705
Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	950.000	757.225	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	693.000	686.609
Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	1.071.000	739.753	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	716.000	672.004
Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 8.000% 15-Feb-2031	722.000	711.907	JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 4.600% 01-Aug-2171	722.000	671.735
NOVA Chemicals Corp '144A' 5.000% 01-May-2025	740.000	707.225	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.375% 01-Mar-2027	605.000	670.017
CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	862.000	692.106	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	620.000	668.050
White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	752.000	681.884	Tenet Healthcare Corp 6.250% 01-Feb-2027	665.000	659.375
Emerald Debt Merger Sub LLC '144A' 6.625% 15-Dec-2030	660.000	667.250	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	781.000	658.371
Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	760.000	664.268	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	690.000	641.875
Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	640.000	651.600	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	667.000	638.233
Lottomatica SpA/Roma 'REGS' 7.125% 01-Jun-2028	590.000	639.647	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	670.000	631.850

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

All Purchases	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Dominion Energy Inc	136.026	7.350.966	Vistra Corp	296.766	9.671.692
NextEra Energy Partners LP (Units)	181.010	7.140.245	Bouygues SA	215.996	7.246.883
Exelon Corp	139.227	5.746.666	SSE Plc	317.126	7.127.284
Clearway Energy Inc	175.417	4.754.848	Antero Midstream Corp	517.171	5.782.148
Veolia Environnement SA	113.993	3.427.876	Enel SpA	820.938	5.501.866
BT Group Plc	1.637.580	3.153.598	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	160.431	5.196.380
AT&T Inc	170.452	2.628.708	Medical Properties Trust Inc (REIT)	573.266	4.653.026
Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	92.740	2.611.848	Deutsche Post AG	103.486	4.567.366
Vistra Corp	112.625	2.446.064	Engie SA	254.444	3.892.164
Bouygues SA	68.996	2.354.368	Orange SA	251.545	3.078.320
Orange SA	181.510	2.083.035	Endesa SA	126.786	2.615.831
PPL Corp	65.335	1.672.164	BT Group Plc	1.637.580	2.559.332
Antero Midstream Corp	131.167	1.610.128	ONEOK Inc	35.726	2.342.480
SFL Corp Ltd	146.127	1.493.656	Italgas SpA	431.958	2.333.109
Drax Group Plc	224.406	1.491.613	Enagas SA	99.098	1.929.914
Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	1.160.000	1.150.068	Redeia Corp SA	100.932	1.664.256
Vinci SA	5.221	624.490	PPL Corp	60.102	1.545.911
ONEOK Inc	10.134	596.221	Dominion Energy Inc	31.638	1.514.971
			Vinci SA	12.602	1.430.352
			Verizon Communications Inc	42.973	1.410.228
			Drax Group Plc	231.240	1.233.334
			Enbridge Inc	28.946	1.144.913
			Exelon Corp	26.466	1.045.383
			Hess Midstream LP - Class A	34.378	1.038.383

BNY Mellon Global Leaders Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Old Dominion Freight Line Inc	6.200	2.135.679	TJX Cos Inc/The	15.850	1.317.835
Texas Instruments Inc	12.100	2.097.096	West Pharmaceutical Services Inc	3.690	1.309.997
ASML Holding NV	2.710	1.836.774	Illumina Inc	12.000	1.298.772
CSL Ltd	9.740	1.784.834	Intuitive Surgical Inc	3.920	1.205.088
Microsoft Corp	4.900	1.706.043	Mastercard Inc	3.050	1.187.713
Edwards Lifesciences Corp	18.400	1.681.453	Amphenol Corp - Class A	13.800	1.186.732
Automatic Data Processing Inc	7.500	1.641.133	L'Oreal SA	2.560	1.175.163
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.730	1.595.886	Microsoft Corp	3.450	1.133.723
Alphabet Inc	12.600	1.531.160	ASML Holding NV	1.610	1.110.274
L'Oreal SA	3.260	1.499.186	Adobe Inc	2.100	1.102.642
Intuitive Surgical Inc	4.600	1.490.117	Automatic Data Processing Inc	4.450	1.013.032
Amphenol Corp - Class A	17.300	1.443.047	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.120	954.184
Mastercard Inc	3.600	1.401.934	Old Dominion Freight Line Inc	2.250	906.258
Fastenal Co	23.700	1.400.370	Novo Nordisk A/S	5.920	882.796
Keyence Corp	2.900	1.385.424	Keyence Corp	2.000	880.337
Adobe Inc	2.800	1.369.702	Alphabet Inc	6.700	837.927
AIA Group Ltd	130.200	1.337.022	Fastenal Co	14.150	837.420
Roche Holding AG	4.030	1.247.987	Texas Instruments Inc	5.050	833.221
Novo Nordisk A/S	7.520	1.210.310	CSL Ltd	4.300	802.058
TJX Cos Inc/The	13.200	1.111.896	AIA Group Ltd	87.000	800.636
West Pharmaceutical Services Inc	2.900	1.111.143	Roche Holding AG	2.400	697.842
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	10.900	1.104.228	Edwards Lifesciences Corp	9.150	686.263
Air Liquide SA	5.040	905.515	Novo Nordisk A/S	6.600	665.664
NIKE Inc	8.100	898.865	NIKE Inc	5.350	642.440
Illumina Inc	4.400	831.673	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	5.900	571.311
Industria de Diseño Textil SA	20.200	764.712	Air Liquide SA	2.260	425.779

BNY Mellon Global Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Danaher Corp	3.185	832.234	Relx Plc	35.882	846.412
Sanofi SA	8.136	768.228	Roche Holding AG	3.007	819.374
Relx Plc	32.308	730.207	Chubb Ltd	3.067	637.951
Progressive Corp/The	4.135	595.035	Suzuki Motor Corp	16.500	571.360
Dassault Systemes SE	11.569	500.028	Abbott Laboratories	5.097	566.211
NVIDIA Corp	1.386	349.599	Microsoft Corp	1.711	554.757
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.289	305.616	Hubbell Inc - Class B	1.726	517.671
Microsoft Corp	873	302.124	Bayer AG	8.098	311.067
AIA Group Ltd	29.400	266.484	Trane Technologies Plc	1.566	306.089
Apple Inc	1.063	200.040	SAP SE	2.276	301.227
HDFC Bank Ltd	9.772	195.906	Wolters Kluwer NV	2.223	272.480
FANUC Corp	2.500	182.357	Apple Inc	1.376	243.377
Novozymes A/S	3.593	181.971	Barclays Plc	96.018	205.055
Alphabet Inc - Class A	1.290	163.713	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	43.500	200.315
Lonza Group AG	354	157.912	Alphabet Inc - Class A	1.669	199.938
SAP SE	1.053	147.547	Mastercard Inc	466	177.686
Mastercard Inc	360	142.371	Amazon.com Inc	1.340	162.879
Amazon.com Inc	1.034	137.606	Accenture Plc - Class A	499	150.674
Trane Technologies Plc	635	124.036	Universal Music Group NV	6.263	150.639
Accenture Plc - Class A	386	123.645	TE Connectivity Ltd	1.126	147.934
TE Connectivity Ltd	868	116.846	Exelon Corp	3.608	145.178
Medtronic Plc	1.368	115.473	AIA Group Ltd	15.000	145.083
Universal Music Group NV	4.838	114.676	Medtronic Plc	1.770	144.620
Sony Group Corp	1.200	112.606	Diageo Plc	3.448	142.680
Exelon Corp	2.787	112.235	Sony Group Corp	1.600	141.705
Diageo Plc	2.664	109.391	Goldman Sachs Group Inc/The	414	137.565
Goldman Sachs Group Inc/The	320	108.411	CME Group Inc	685	133.300
Cooper Cos Inc/The	288	106.110	Cooper Cos Inc/The	373	131.484
Applied Materials Inc	712	102.062	Applied Materials Inc	923	124.906
CME Group Inc	529	101.426	SSE Plc	5.614	118.345
SSE Plc	4.337	100.499	Samsung SDI Co Ltd	244	117.075
Wolters Kluwer NV	787	99.438	Danaher Corp	494	114.844
Hubbell Inc - Class B	314	97.416	HDFC Bank Ltd	5.844	112.311
Samsung SDI Co Ltd	186	91.169	AstraZeneca Plc	825	111.709
Roche Holding AG	287	90.264	Texas Instruments Inc	649	108.254
AstraZeneca Plc	637	88.148			
Texas Instruments Inc	501	87.095			

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	142.650.000	141.175.171	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	142.650.000	142.439.430
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	108.143.000	106.579.075	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	108.143.000	107.894.818
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2024	72.887.000	71.618.764	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	96.239.367	92.539.419
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	67.730.000	66.736.516	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	76.441.400	61.956.317
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	53.826.000	52.963.437	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	684.846	61.363.287
Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	548.576	50.054.817	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	572.186	61.024.124
Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	548.341	50.033.375	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	588.479	61.019.249
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	55.947.591	49.884.441	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	59.308.000	58.779.443
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	1.059.960.000	48.119.805	Invesco Physical Gold ETC	304.116	51.487.261
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	900.870.000	43.115.641	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	1.009.660.000	47.924.282
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	329.900.000	41.961.783	iShares Physical Gold ETC - ETF	1.369.927	46.768.941
NVIDIA Corp	147.377	39.579.410	Unilever Plc	1.050.117	46.715.351
Unilever Plc	793.958	34.768.353	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	298.303.000	44.734.052
Roche Holding AG	115.155	31.322.511	Shell Plc	1.428.196	39.932.463
Barrick Gold Corp	1.569.325	27.346.541	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	72.171.000	39.765.571
iShares Physical Gold ETC	698.269	25.077.698	Exelon Corp	900.157	33.054.453
Invesco Physical Gold ETC	128.079	22.813.084	ICON Plc	156.095	32.824.110
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	5.164.982.900	22.409.280	Amundi Physical Gold ETC	463.482	32.293.020
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	166.259.000	20.709.688	Ryanair Holdings Plc ADR	339.084	31.701.168
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	35.185.000	20.410.079	NVIDIA Corp	101.704	31.042.551
United Kingdom Gilt 4.250% 07-Sep-2039	17.925.796	20.070.674	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	244.934	26.195.068
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	213.166	19.651.620	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	26.170.000	26.154.198
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	433.923.000	19.429.943	Barrick Gold Corp	1.569.325	24.617.984
Goldman Sachs Group Inc/The 0.000% 25-Apr-2025	212.740	19.239.418	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	5.164.982.900	24.545.682
Amundi Physical Gold ETC	255.422	18.744.299	Booking Holdings Inc	9.362	24.198.866
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	18.681.000	18.534.354			
United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2040	15.436.947	17.239.120			
Icon Plc	78.538	16.638.651			
BNP Paribas SA	253.926	16.433.581			

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
United Kingdom Gilt 0.125% 31-Jan-2024	5.113.000	4.964.476	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jan-2025	3.780.087	3.532.575
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Jan-2024	2.000.000	1.944.512	United Kingdom Gilt 0.125% 31-Jan-2024	2.165.326	2.121.189
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Feb-2024	1.851.000	1.800.170	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	2.601.100	2.103.094
Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	21.444	1.677.079	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Jan-2024	2.000.000	1.983.488
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Dec-2023	1.700.000	1.653.732	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	2.641.600	1.856.317
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	2.098.974	1.629.945	iShares Physical Gold ETC	58.480	1.728.547
Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	19.551	1.529.033	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Dec-2023	1.700.000	1.678.038
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	36.860.000	1.469.830	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	18.289	1.677.474
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Feb-2024	1.500.000	1.459.143	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	21.171	1.598.225
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	33.310.000	1.385.618	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	17.217	1.531.445
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Nov-2023	1.317.564	1.289.381	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	35.000.000	1.456.800
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Oct-2023	1.256.692	1.240.087	Invesco Physical Gold ETC	9.849	1.442.794
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	11.200.000	1.235.031	Unilever Plc	36.077	1.434.701
NVIDIA Corp	5.115	1.229.466	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Nov-2023	1.317.564	1.305.863
United Kingdom Gilt 2.250% 07-Sep-2023	1.200.000	1.191.684	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	10.018.000	1.301.310
Unilever Plc	29.202	1.154.542	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Oct-2023	1.256.692	1.251.639
Roche Holding AG	4.327	1.034.343	United Kingdom Gilt 2.250% 07-Sep-2023	1.200.000	1.197.150
iShares Physical Gold ETC	31.824	996.028	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	2.549.000	1.188.550
Barrick Gold Corp	55.140	842.483	Shell Plc	46.513	1.132.045
Invesco Physical Gold ETC	4.807	747.855	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	2.382.000	1.127.634
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	1.398.000	698.262	Exelon Corp	29.936	966.364
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	177.631.900	672.972	ICON Plc	5.040	929.805
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	7.922	632.095	NVIDIA Corp	3.417	928.315
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	5.675.000	619.385	Amundi Physical Gold ETC	15.257	916.199
Goldman Sachs Group Inc/The (Zero Coupon) 0.000% 25-Apr-2025	7.440	594.629	United Kingdom Gilt 0.750% 22-Jul-2023	870.000	857.985
Amundi Physical Gold ETC	9.255	593.491	Ryanair Holdings Plc ADR	9.826	799.539
United Kingdom Gilt 4.250% 07-Sep-2039	608.577	590.647	Relx Plc	37.980	781.208
Relx Plc	31.011	589.006	Barrick Gold Corp	55.140	746.743
United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	832.600	585.927	AstraZeneca Plc	6.676	733.484
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	14.726.000	583.227	Booking Holdings Inc	325	728.978

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.387% 31-Jan-2025	58.678.600	58.796.410	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.648% 31-Oct-2023	34.874.600	34.887.083
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.656% 30-Apr-2024	21.006.900	20.998.701	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.968% 30-Apr-2024	29.106.900	29.099.023
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	10.950.738	10.364.489	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.541% 31-Jan-2025	16.052.100	16.071.483
Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	95.781	9.578.100	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	108.740	10.503.688
Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	89.863	8.986.300	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	86.454	10.136.007
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	174.790.000	8.600.346	Invesco Physical Gold ETC	53.529	9.935.691
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	147.900.000	7.667.768	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	9.967.300	9.698.807
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	56.000.000	7.506.522	iShares Physical Gold ETC	257.020	9.605.869
NVIDIA Corp	24.148	7.074.389	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	79.137	9.000.686
Unilever Plc	142.037	6.806.142	Unilever Plc	183.189	8.943.898
Roche Holding AG	20.772	6.005.843	Shell Plc	290.199	8.790.022
iShares Physical Gold ETC	136.941	5.295.719	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	160.200.000	8.316.680
Barrick Gold Corp	265.692	4.970.415	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	9.289.500	7.878.104
Invesco Physical Gold ETC	24.838	4.761.224	Merrill Lynch International & Co CV	72.827	7.282.693
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	848.649.000	4.020.410	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	45.671.000	7.216.406
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	6.195.000	3.964.425	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	11.927.000	7.049.439
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	38.343	3.757.878	Exelon Corp	153.246	6.105.924
Amundi Physical Gold ETC	45.436	3.591.548	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	10.103.000	6.093.109
Goldman Sachs Group Inc/The (Zero Coupon) 0.000% 25-Apr-2025	35.050	3.505.000	Amundi Physical Gold ETC	76.831	5.837.515
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	25.287.000	3.409.366	ICON Plc	26.057	5.834.925
Shell Plc	105.136	3.240.634	NVIDIA Corp	16.656	5.669.679
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	66.637.000	3.191.058	Ryanair Holdings Plc ADR	48.785	5.055.229
Relx Plc	145.290	3.147.370	Relx Plc	193.261	4.801.898
Amazon.com Inc	26.787	3.063.856	Barrick Gold Corp	265.692	4.568.514
Icon Plc	13.573	3.059.901	Booking Holdings Inc	1.616	4.544.227
			Roche Holding AG	15.906	4.522.804
			Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	848.649.000	4.397.679

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	400.318.501	400.318.501	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	403.047.726	403.047.726
Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 7.500% 21-Aug-2026	11.500.000	12.532.344	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	15.000.000	14.284.300
Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	13.000.000	12.335.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 6.007% 01-Apr-2024	12.850.000	13.913.654
Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	12.750.000	12.271.827	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	12.000.000	11.978.484
ZF Finance GmbH 'EMTN' 5.750% 03-Aug-2026	11.000.000	12.122.289	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2025	10.021.000	10.737.151
Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 10.000% 11-Oct-2028	9.500.000	11.532.058	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 6.934% 30-Sep-2024	9.250.000	10.049.005
IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 8.750% 15-May-2028	10.050.000	10.944.908	Ford Motor Credit Co LLC FRN 8.299% 06-Mar-2026	10.000.000	10.044.260
Ford Motor Credit Co LLC FRN 0.000% 06-Mar-2026	10.000.000	10.000.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	9.500.000	9.760.846
OI European Group BV 'REGS' 6.250% 15-May-2028	9.000.000	9.841.128	FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	9.000.000	9.054.200
Forvia SE 7.250% 15-Jun-2026	8.850.000	9.824.622	Paprec Holding SA 'REGS' 4.000% 31-Mar-2025	7.500.000	8.010.176
Silgan Holdings Inc 3.250% 15-Mar-2025	8.900.000	9.656.300	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.625% 15-May-2025	7.250.000	7.927.942
Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' 8.750% 01-May-2028	8.520.000	9.441.299	Forvia SE 7.250% 15-Jun-2026	7.088.000	7.887.770
Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 8.250% 11-Oct-2028	8.500.000	8.930.954	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	7.000.000	7.743.730
Galaxy Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jul-2026	7.500.000	8.732.217	Energian Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024	7.500.000	7.443.750
Assemblin Group AB 'REGS' FRN 0.000% 05-Jul-2029	8.000.000	8.657.522	Monitchem HoldCo 2 SA 'REGS' 9.500% 15-Sep-2026	6.382.000	7.366.364
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 3.500% 11-Feb-2027	8.000.000	7.952.848	esure Group Plc 6.750% 19-Dec-2024	6.015.000	7.225.582
Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	7.500.000	7.805.193	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	7.000.000	7.124.228
Avantor Funding Inc 'REGS' 3.875% 15-Jul-2028	7.500.000	7.627.651	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 6.375% 15-Feb-2025	5.500.000	6.702.747
Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	7.606.000	7.361.760	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025	6.000.000	6.412.235
TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	7.200.000	7.211.757	Spectrum Brands Inc 'REGS' 4.000% 01-Oct-2026	6.250.000	6.384.706

BNY Mellon Global Unconstrained Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Danaher Corp	1.548	406.109	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 5,417% 31-Oct-2023	600.000	600.000
Rentokil Initial Plc	33.732	254.670	Abbott Laboratories	2.994	332.380
Dassault Systemes SE	4.802	212.267	Toll Brothers Inc	3.053	213.917
Progressive Corp/The	1.431	203.514	Insurance Australia Group Ltd	54.394	201.893
Unilever Plc	3.771	181.966	Chubb Ltd	717	135.203
RenaissanceRe Holdings Ltd	720	143.590	Hubbell Inc - Class B	429	133.009
Reckitt Benckiser Group Plc	1.957	142.872	Ferguson PLC	626	110.759
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	1.000.000	139.630	American Airlines Inc '144A' 11,750% 15-Jul-2025	100.000	109.470
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	104.938	103.118	Assurant Inc	785	98.638
Novozymes A/S	1.698	86.267	Suzuki Motor Corp	2.700	93.870
Roche Holding AG	297	83.829	SAP SE	553	70.770
Smurfit Kappa Group Plc	1.966	66.908	SKYCITY Entertainment Group Ltd	63.698	67.227
Universal Music Group NV	2.296	46.195	Laureate Education Inc	5.339	62.634
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	36.647	34.100	Otis Worldwide Corp	503	45.149
Prudential Plc	2.507	27.323	Veralto Corp	516	39.261
Lonza Group AG	60	24.081	Eli Lilly & Co	43	23.795

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten JPY	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse JPY
Ulvac Inc	171.200	963.534.344	Optorun Co Ltd	482.400	865.267.230
Rakuten Bank Ltd	407.100	811.400.401	Dowa Holdings Co Ltd	189.300	838.706.418
Dentsu Soken Inc	165.900	797.777.678	RS Technologies Co Ltd	297.100	808.303.168
Maruwa Co Ltd/Aichi	17.800	489.762.273	Sanken Electric Co Ltd	86.300	802.670.523
Pilot Corp	92.900	465.888.722	Nakanishi Inc	198.800	561.574.607
C Uyemura & Co Ltd	49.900	453.564.085	Nifco Inc/Japan	153.100	550.189.695
Enplas Corp	32.500	387.997.604	ADEKA Corp	198.600	505.406.817
Insource Co Ltd	337.600	387.182.294	Zenkoku Hoshio Co Ltd	97.500	486.597.531
Cover Corp	121.800	363.335.747	Ain Holdings Inc	93.700	453.507.990
TRE Holdings Corp	233.600	292.351.352	Vector Inc	319.500	408.723.072
Premium Group Co Ltd	156.600	257.933.497	Premium Group Co Ltd	236.400	376.217.102
Nakanishi Inc	88.900	254.123.736	MCJ Co Ltd	353.800	366.268.592
Ain Holdings Inc	44.900	230.288.171	Wacom Co Ltd	594.500	361.515.118
Optorun Co Ltd	85.700	199.639.424	Rakuten Bank Ltd	145.400	361.262.890
Vision Inc/Tokyo Japan	131.800	197.309.348	Direct Marketing MiX Inc	363.500	344.067.140
ADEKA Corp	79.700	196.968.430	Nippon Gas Co Ltd	158.800	335.385.675
Zenkoku Hoshio Co Ltd	37.700	188.867.681	Sakata INX Corp	289.200	331.389.678
Nifco Inc/Japan	39.200	152.783.955	Vision Inc/Tokyo Japan	214.200	323.143.106
RS Technologies Co Ltd	40.700	133.758.371	Japan Medical Dynamic Marketing Inc	359.600	317.608.151
MCJ Co Ltd	128.100	131.468.929	Resorttrust Inc	135.900	310.995.352
TechMatrix Corp	74.200	127.907.891	Insource Co Ltd	264.000	302.509.809
Vector Inc	90.600	118.975.361	TechMatrix Corp	180.200	301.035.975
Aida Engineering Ltd	114.400	103.953.264	Yonex Co Ltd	202.500	282.882.607
Nippon Gas Co Ltd	47.600	97.742.878	TRE Holdings Corp	210.000	268.403.320
			m-up Holdings Inc	215.800	268.093.821
			Aida Engineering Ltd	305.900	262.900.651
			Fibergate Inc/Japan	247.300	255.772.425
			Ulvac Inc	40.400	240.769.049
			Dentsu Soken Inc	41.200	211.987.192
			Anicom Holdings Inc	294.500	173.521.913
			Minkabu The Infonoid Inc	87.500	155.901.986
			BrainPad Inc	187.200	132.188.783

BNY Mellon Long-Term European Equity Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
ASML Holding NV	740	495.768	Abcam Plc	14.200	305.335
Novo Nordisk A/S	3.450	491.989	Chr Hansen Holding A/S	3.030	179.320
Spirax-Sarco Engineering Plc	3.910	476.060	Novozymes A/S	4.530	177.562
Lonza Group AG	840	456.844	Fevertree Drinks Plc	10.492	165.073
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	540	453.997	Kering SA	410	155.725
Carl Zeiss Meditec AG	4.810	445.008	Sandoz Group AG	908	24.989
Halma Plc	17.500	444.089			
Reply SpA	4.290	431.648			
Amadeus IT Group SA	6.530	428.133			
Infineon Technologies AG	12.000	425.845			
Big Yellow Group Plc	34.550	421.925			
CTS Eventim AG & Co KGaA	6.600	416.108			
Novartis AG	4.540	414.304			
Rational AG	625	410.954			
Sartorius Stedim Biotech	1.750	409.942			
Compass Group Plc	16.450	407.375			
Atlas Copco AB	35.310	406.988			
VAT Group AG	1.040	406.796			
Universal Music Group NV	18.900	406.064			
Greggs Plc	13.100	403.924			
Industria de Diseno Textil SA	11.500	403.347			
Kone Oyj	8.500	403.267			
Dassault Systemes SE	9.840	403.159			
adidas AG	2.330	402.716			
Sika AG	1.540	402.570			
SAP SE	3.130	402.196			
Hermes International SCA	210	401.460			
Experian Plc	11.500	401.458			
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	9.290	401.429			
Coloplast A/S	3.730	401.326			
ASM International NV	970	400.846			
Ferrari NV	1.370	400.009			
Diageo Plc	10.200	399.844			
Wolters Kluwer NV	3.520	398.982			
Air Liquide SA	2.500	398.898			
Merck KGaA	2.680	398.692			
Diploma Plc	11.300	398.509			
Prudential Plc	32.260	397.195			
Roche Holding AG	1.430	396.581			
Nestle SA	3.670	396.385			
TotalEnergies SE	7.750	395.789			
L'Oreal SA	960	395.425			
Kuehne + Nagel International AG	1.445	394.557			
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	35	394.438			
SGS SA	4.600	383.758			
Brembo SpA	26.577	348.878			
Abcam Plc	14.200	298.158			
Belimo Holding AG	670	294.441			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Old Dominion Freight Line Inc	95.430	29.153.561	SGS SA	7.465	16.593.411
O'Reilly Automotive Inc	31.280	26.460.832	Novo Nordisk A/S	103.000	14.441.582
ASML Holding NV	44.400	26.217.337	Booking Holdings Inc	4.700	11.512.676
Moody's Corp	82.680	24.760.325	Kone Oyj - Class B	279.000	11.489.173
Lonza Group AG	29.700	16.596.646	Old Dominion Freight Line Inc	20.700	7.776.622
Costco Wholesale Corp	33.830	15.600.939	Illumina Inc	71.773	6.427.351
Mettler-Toledo International Inc	14.040	15.308.677	Jardine Matheson Holdings Ltd	127.200	5.958.163
Industria de Diseno Textil SA	307.400	9.738.169	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	104.600	5.097.995
Waters Corp	31.000	7.606.826	Cisco Systems Inc	102.900	4.988.503
Roche Holding AG	18.300	4.989.912	Keyence Corp	11.500	4.674.324
Experian Plc	141.629	4.934.964	Adobe Inc	8.300	3.954.791
Cisco Systems Inc	111.600	4.824.262	Compass Group Plc	152.400	3.839.656
Nestle SA	42.000	4.563.977	Mastercard Inc	11.100	3.675.378
Paychex Inc	40.500	4.331.956	Fastenal Co	72.100	3.499.816
SMC Corp	7.200	3.519.312	Microsoft Corp	13.000	3.307.305
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	123.500	3.329.463	Amphenol Corp - Class A	45.700	3.121.322
CSL Ltd	20.700	3.302.046	Linde Plc	9.300	3.054.971
Stryker Corp	12.200	3.250.586	Alimentation Couche-Tard Inc	64.700	2.864.350
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	40.800	3.159.966	TJX Cos Inc/The	35.400	2.638.575
Canadian National Railway Co	26.600	2.810.198	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.199	2.584.309
Adobe Inc	8.600	2.689.303	West Pharmaceutical Services Inc	8.700	2.501.530
Illumina Inc	14.300	2.684.049	Stryker Corp	9.900	2.425.652
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	28.200	2.344.658
			Walt Disney Co/The	26.400	2.136.471

BNY Mellon Mobility Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Aptiv Plc	167.098	18.624.482	Aptiv Plc	155.580	17.826.561
LG Chem Ltd	24.875	13.423.196	CNH Industrial NV	1.045.744	15.155.776
Mobileye Global Inc - Class A	298.993	11.339.768	TE Connectivity Ltd	106.174	13.191.381
TE Connectivity Ltd	88.628	10.622.677	MediaTek Inc	532.000	12.012.342
Deutsche Post AG	218.869	9.490.640	Schneider Electric SE	68.766	11.561.192
Akamai Technologies Inc	88.050	9.466.247	Albemarle Corp	95.430	11.556.540
Albemarle Corp	46.393	9.452.476	Marvell Technology Inc	237.553	10.534.247
Kubota Corp	617.600	9.375.867	Denso Corp	184.000	10.466.147
Dassault Systemes SE	228.970	9.091.374	East Japan Railway Co	180.100	10.308.646
Emerson Electric Co	100.830	8.819.605	Hubbell Inc - Class B	34.443	9.520.593
Alstom SA	272.471	8.319.354	LG Chem Ltd	24.875	9.360.331
CrowdStrike Holdings Inc	51.308	7.971.233	MP Materials Corp	498.705	9.355.218
Meituan '144A'	480.200	7.574.304	Eaton Corp Plc	46.782	9.272.128
Suzuki Motor Corp	205.800	7.471.961	Regal Rexnord Corp	62.828	8.707.312
Chroma ATE Inc	1.255.000	7.324.134	Splunk Inc	62.288	8.622.969
Tesla Inc	42.547	7.085.427	Uber Technologies Inc	176.830	8.202.564
Texas Instruments Inc	42.977	6.977.329	General Motors Co	264.939	8.028.724
Anglo American Plc	271.387	6.296.219	Magna International Inc	139.674	7.810.339
Deere & Co	15.843	6.235.575	ANSYS Inc	24.091	7.697.081
Marvell Technology Inc	120.019	6.194.128	Skyworks Solutions Inc	66.553	7.625.457
Dowdais Group Plc	4.471.739	5.780.958	Contemporary Ampere Technology Co Ltd	198.500	7.194.486
Alfen N.V. '144A'	61.443	4.824.707	Tesla Inc	42.547	7.119.134
Knorr-Bremse AG	70.845	4.387.147	Hanon Systems	977.104	6.926.523
Denso Corp	193.400	4.313.998	Alfen N.V. '144A'	109.985	6.839.361
Visteon Corp	32.926	4.251.881	Taiyo Yuden Co Ltd	264.100	6.767.797
QUALCOMM Inc	27.430	3.046.194	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	176.904	5.623.307
East Japan Railway Co	54.800	2.823.532	Suzuki Motor Corp	136.800	5.452.556
Zuora Inc	304.212	2.776.570	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	918.370	5.252.436
BYD Co Ltd 'H'	92.000	2.757.806	Deutsche Post AG	103.805	5.013.914
FANUC Corp	79.300	2.640.814	Samsung SDI Co Ltd	9.122	4.986.620
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	80.390	2.470.951	ON Semiconductor Corp	67.953	4.936.176
Mercedes-Benz Group AG	33.467	2.408.859	Infineon Technologies AG	122.644	4.787.491
			Knorr-Bremse AG	69.749	4.714.285
			Semtech Corp	212.755	4.624.579
			STMicroelectronics NV	89.342	4.281.420
			Chroma ATE Inc	569.000	4.244.686
			Plug Power Inc	513.080	4.141.548
			Alstom SA	272.471	3.852.227
			Lumentum Holdings Inc	83.922	3.656.768

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Alle Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
SCOR SE	46.131	1.339.054	Elis SA	57.955	991.563
Siltronic AG	13.798	928.104	Publicis Groupe SA	13.259	952.817
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	15.611	818.968	Sopra Steria Group SACA	4.701	898.148
Signify NV '144A'	29.244	794.194	Siltronic AG	10.389	833.830
BPER Banca	211.779	593.116	BE Semiconductor Industries NV	10.093	775.534
BE Semiconductor Industries NV	5.566	541.775	Italgas SpA	146.607	748.620
Heidelberger Druckmaschinen AG	301.717	508.083	Rexel SA	26.893	633.756
Eurofins Scientific SE	7.946	497.528	Aegon NV	114.238	548.107
Buzzi Unicem SpA	17.881	497.086	Rheinmetall AG	2.007	521.486
Mediaset Espana Comunicacion SA	147.631	466.981	Telefonica Deutschland Holding AG	137.450	387.658
Deutsche EuroShop AG	17.960	428.944	Deutz AG	62.324	357.508
Italgas SpA	77.896	423.463	Sacyr SA	110.293	318.376
D'ieteren Group	2.403	388.887	Eiffage SA	1.469	144.378
DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	10.532	336.964	Alten SA	793	116.042
			Iren SpA	55.768	104.206
			Brenntag SE	1.323	92.240
			Bekaert SA	2.168	86.451
			HUGO BOSS AG	1.332	82.308
			TKH Group NV Dutch Cert	1.822	77.404
			Trigano SA	546	70.089

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
ImmunoGen Inc	79.341	1.142.278	BioMarin Pharmaceutical Inc	23.563	2.276.056
Crinetics Pharmaceuticals Inc	54.615	1.120.876	ImmunoGen Inc	79.341	2.121.068
Pacific Biosciences of California Inc	89.783	1.008.955	Crinetics Pharmaceuticals Inc	54.615	1.814.077
Gilead Sciences Inc	12.496	989.805	Eli Lilly & Co	3.667	1.736.530
Health Care Select Sector SPDR Fund - ETF	7.795	987.028	Sanofi SA ADR	31.845	1.529.824
Insmid Inc	42.140	881.128	Alnylam Pharmaceuticals Inc	8.225	1.529.531
UCB SA	8.525	801.880	AstraZeneca PLC	10.943	1.474.782
Rocket Pharmaceuticals Inc	33.758	714.764	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.806	1.436.033
Ambrx Biopharma Cayman Inc	47.433	709.985	Legend Biotech Corp ADR	20.756	1.373.752
Alnylam Pharmaceuticals Inc	3.464	679.012	Danaher Corp	5.435	1.178.147
Lonza Group AG	1.133	668.858	Insmid Inc	42.140	1.146.041
Regeneron Pharmaceuticals Inc	694	538.596	Seagen Inc	6.019	1.124.005
AstraZeneca PLC	3.662	513.831	Biogen Inc	4.076	1.064.786
Repligen Corp	2.933	510.935	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	25.593	1.054.119
Sartorius AG - Preference	938	442.237	Repligen Corp	6.483	1.025.443
Laboratory Corp of America Holdings	2.124	424.613	Health Care Select Sector SPDR Fund - ETF	7.795	1.009.049
BioMarin Pharmaceutical Inc	4.819	423.391	Gilead Sciences Inc	12.496	979.257
Stevanato Group SpA	13.710	397.386	Rocket Pharmaceuticals Inc	33.758	888.361
Agilent Technologies Inc	3.081	375.778	Merck KGaA	4.338	838.545
Bio-Techne Corp	4.329	364.009	Cytokinetics Inc	23.697	809.770
Apellis Pharmaceuticals Inc	5.486	358.770	Sarepta Therapeutics Inc	8.905	784.260
Ultragenyx Pharmaceutical Inc	8.614	354.007	Bio-Techne Corp	10.285	736.467
Danaher Corp	1.356	353.977	Pacific Biosciences of California Inc	89.783	729.703
Sarepta Therapeutics Inc	2.403	338.671	AbbVie Inc	4.705	714.845
Prothena Corp PLC	4.727	321.447	Denali Therapeutics Inc	32.994	707.174
Akoya Biosciences Inc	42.180	304.652	Moderna Inc	4.869	689.796
Akero Therapeutics Inc	6.454	291.974	Illumina Inc	5.341	672.566
Legend Biotech Corp ADR	5.655	286.198	Keros Therapeutics Inc	18.733	670.990
Intellia Therapeutics Inc	6.326	283.007	UCB SA	8.525	668.674
Seagen Inc	1.551	274.974	Lonza Group AG	1.133	662.334
Biogen Inc	905	246.447	Kymira Therapeutics Inc	21.480	639.171
Sanofi SA ADR	4.657	240.529	Ambrx Biopharma Inc	47.433	587.750
PTC Therapeutics Inc	4.640	237.713	uniQure NV	29.218	583.890
Eli Lilly & Co	670	226.365	10X Genomics Inc	12.828	565.724
10X Genomics Inc	4.056	215.465	PTC Therapeutics Inc	17.850	529.291
			Intellia Therapeutics Inc	17.596	527.877
			IQVIA Holdings Inc	2.608	498.570
			Laboratory Corp of America Holdings	2.124	463.651

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.936% 31-Jan-2025	45.450.000	42.326.753	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.346% 31-Jan-2025	45.450.000	41.676.429
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	29.950.000	25.908.730	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	23.402.400	20.442.007
United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-Jan-2026	17.010.000	15.348.199	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	20.748.100	15.285.071
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	15.164.533	13.184.991	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.648% 31-Oct-2023	15.412.100	14.214.233
United Kingdom Gilt 2.000% 07-Sep-2025	10.950.000	11.941.713	United Kingdom Gilt 2.000% 07-Sep-2025	10.950.000	11.984.821
United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	14.530.000	11.790.049	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	12.277.964	11.720.216
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	2.523.000.000	11.574.774	European Investment Bank 'REGS' FRN 5.464% 05-Mar-2024	11.640.000	10.673.392
United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.512% 31-Jul-2025	11.660.000	10.957.638	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	14.760.000	10.133.292
European Investment Bank 'REGS' FRN 5.464% 05-Mar-2024	11.640.000	10.432.335	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	193.000.000	9.255.985
United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	14.190.000	9.500.966	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	7.625.093	8.508.733
Australia Government Bond 2.750% 21-May-2041	17.490.000	9.039.927	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	14.190.000	8.228.930
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	71.000.000	8.974.824	United States Treasury Floating Rate Note FRN 5.482% 31-Jul-2025	8.920.000	8.177.427
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	7.438.494	8.398.075	Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	9.920.000	6.745.287
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	159.000.000	7.334.498	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	7.663.603	6.567.237
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	6.874.728	6.990.462	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	7.158.056	6.561.755
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2026	6.381.123	6.351.665	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	8.080.000	6.504.753
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2026	43.000.000	5.984.463	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	43.000.000	6.442.874
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	120.000.000	5.860.880	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2026	43.000.000	6.121.082
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	43.000.000	5.524.703	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	8.110.000	5.617.352
Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	89.856.000.000	5.386.398	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.483% 22-Nov-2028	5.850.000	5.395.796
Japan Government Forty Year Bond 0.400% 20-Mar-2056	1.268.900.000	5.304.099	Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	1.108.600.000	5.277.042
New Zealand Government Bond 0.250% 15-May-2028	10.570.000	4.954.541	European Investment Bank 'REGS' FRN 5.618% 21-Jan-2026	5.580.000	5.220.766
Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031	6.230.000	4.925.067	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	4.590.000	4.950.064
Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	19.920.000	4.551.504	Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031	6.230.000	4.937.532
			New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	12.750.000	4.763.004
			Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	95.000.000	4.760.366
			European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 5.489% 14-Apr-2026	5.110.000	4.743.996
			Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 5.095% 15-Mar-2027	6.880.000	4.682.335

BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Alle Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Voltronic Power Technology Corp	4.000	194.887	By-health Co Ltd	95.600	254.356
Sona Blw Precision Forgings Ltd '144A'	31.272	172.113	Godrej Consumer Products Ltd	14.713	184.745
Sungrow Power Supply Co Ltd	11.800	170.014	Novozymes A/S	3.843	162.756
Chroma ATE Inc	25.000	159.465	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	9.000	162.367
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	3.000	141.379	PB Fintech Ltd	15.021	137.499
Samsung SDI Co Ltd	216	126.109	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	28.800	122.429
Regional SAB de CV	11.110	85.012	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	29.800	117.478
Prudential Plc	7.809	84.111	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	18.000	106.622
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	211.600	75.022	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	18.600	84.857
WEG SA	10.081	73.758	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	1.500	73.754
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	7.600	64.113	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	8.800	71.888
HDFC Bank Ltd	2.522	48.971	Samsung SDI Co Ltd	116	41.873
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.000	34.626	Delta Electronics Inc	3.000	26.641
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	4.586	27.403	Livent Corp	906	22.441
AIA Group Ltd	2.600	25.389	WEG SA	2.651	19.995
Livent Corp	1.297	25.210	ASML Holding NV	31	19.759
Dr Lal PathLabs Ltd '144A'	774	22.289	Sungrow Power Supply Co Ltd	900	14.498
NARI Technology Co Ltd 'A'	5.500	21.838	Tata Consultancy Services Ltd	194	9.683
Clicks Group Ltd	1.351	20.437			
Delta Electronics Inc	2.000	20.116			
PB Fintech Ltd	3.527	18.748			

BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
NVIDIA Corp	47.089	12.377.266	Roche Holdings AG	39.856	11.055.458
Danaher Corp	44.399	11.131.037	Cooper Cos Inc/The	31.459	10.473.695
Costco Wholesale Corp	21.437	10.796.328	SAP SE	78.410	10.228.142
Relx Plc	429.158	10.764.708	Exelon Corp	232.375	9.838.895
ICON Plc	48.079	10.232.216	Norfolk Southern Corp	39.739	9.404.000
Ingersoll Rand Inc	177.598	10.160.425	Diageo Plc	216.481	9.346.990
Chr Hansen Holding A/S	135.507	9.677.003	Relx Plc	377.252	9.183.056
CMS Energy Corp	157.769	9.641.665	Universal Music Group NV	389.071	9.165.066
Zurich Insurance Group AG	19.011	9.012.852	Zurich Insurance Group AG	19.011	9.001.819
Infineon Technologies AG	235.173	8.909.509	CME Group Inc	44.935	8.420.694
Boston Scientific Corp	156.631	8.521.557	Goldman Sachs Group Inc/The	23.016	8.291.375
Roper Technologies Inc	19.537	8.359.373	Novartis AG	95.173	8.241.383
Linde PLC/bld	25.276	8.258.089	Alphabet Inc - Class A	86.788	8.177.794
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	25.521.100	8.240.907	Shell Plc	265.134	7.892.152
Croda International Plc	91.521	7.737.843	Applied Materials Inc	70.610	7.844.669
ASML Holding NV	11.880	7.493.039	Medtronic Plc	92.369	7.488.779
Accenture Plc - Class A	26.597	7.452.187	Swedbank AB	373.112	7.488.569
Informa Plc	869.999	7.113.404	General Electric Co	87.005	7.163.978
Zoetis Inc	38.967	6.961.472	Samsung SDI Co Ltd	18.644	7.129.306
SolarEdge Technologies Inc	23.716	6.949.678	Nestle SA	55.618	6.743.153
NextEra Energy Inc	93.592	6.945.684	Abbott Laboratories	61.808	6.482.870
Progressive Corp/The	47.025	6.641.016	Barclays Plc	3.151.687	6.475.281
RenaissanceRe Holdings Ltd	29.331	6.291.410	Eli Lilly & Co	19.339	6.364.640
Eversource Energy	75.479	5.934.042	Intuit Inc	13.488	6.155.668
Ecolab Inc	35.124	5.666.147	Chubb Ltd	27.356	5.721.308
Verizon Communications Inc	141.536	5.577.371	Dollar General Corp	24.964	5.650.205
Intuit Inc	13.488	5.412.732	JPMorgan Chase & Co	39.372	5.533.040
Applied Materials Inc	36.894	5.177.737	Altria Group Inc	113.056	5.369.845
Orsted AS '144A'	66.215	5.131.375	Ebara Corp	128.400	5.197.504
Lonza Group AG	11.610	5.088.554	Verizon Communications Inc	141.536	5.174.111
Genus Plc	153.703	4.965.262	SolarEdge Technologies Inc	23.716	4.959.109
Technip Energies NV	197.536	4.889.038	SCOR SE	205.344	4.952.132
Alphabet Inc - Class A	45.466	4.802.103	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	5.682	4.835.788
HDFC Bank Ltd	227.200	4.548.352	Volkswagen AG - Preference	34.410	4.769.641
Hermes International SCA	2.058	4.423.169	NVIDIA Corp	21.556	4.745.875
L'Oreal SA	10.415	4.337.121	Alibaba Group Holding Ltd	386.436	4.569.389
SAP SE	34.576	4.048.423	SSE Plc	199.244	4.243.247
Medtronic Plc	45.193	3.901.108	Hubbell Inc - Class B	15.837	3.965.591
			Bank Mandiri Persero Tbk PT	5.843.900	3.855.449
			Sugi Holdings Co Ltd	90.800	3.766.870
			Albemarle Corp	27.225	3.625.235
			Bayer AG	55.290	3.458.054

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	6.022.000	5.961.237	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	6.022.000	6.021.097
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	5.547.120	5.469.870	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 29-Nov-2023	5.547.120	5.519.539
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	2.830.000	2.788.489	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	4.033.000	4.013.718
iShares Physical Gold ETC	69.682	2.458.573	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	3.986.040	3.837.291
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	2.482.000	2.442.226	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	68.300.000	3.239.293
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	46.980.000	2.132.650	iShares Physical Gold ETC	90.192	3.098.719
Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	22.004	2.007.755	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	3.151.400	2.573.706
Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	20.853	1.902.732	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	23.522	2.512.601
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	38.550.000	1.840.540	Merrill Lynch International & Co CV	24.960	2.303.797
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2024	1.848.000	1.812.117	Unilever Plc	47.589	2.211.302
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	12.461.000	1.563.070	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	20.593	2.137.954
Roche Holding AG	5.728	1.554.170	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Feb-2024	2.117.066	2.102.802
NVIDIA Corp	5.841	1.513.839	Invesco Physical Gold ETC	12.221	2.077.356
Unilever Plc	31.044	1.425.797	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	3.732.000	2.016.442
Bayer AG	19.433	1.150.826	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	2.000.000	1.997.829
Relx Plc	41.657	1.087.266	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	12.461.000	1.871.858
Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jul-2027	8.500.000	1.081.161	Amundi Physical Gold ETC	26.654	1.865.493
Invesco Physical Gold ETC	5.988	1.061.284	Relx Plc	64.526	1.792.555
Amundi Physical Gold ETC	13.765	1.005.319	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 31-Jan-2024	1.791.000	1.769.932
Mexico Cetes (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2024	228.408.300	990.994	Exelon Corp	46.763	1.751.308
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15-Apr-2028	1.102.950	983.423	Greencoast UK Wind Plc/Funds	1.024.900	1.716.877
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	10.474	955.911	NVIDIA Corp	5.197	1.661.554
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	934.000	925.929	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	35.920.000	1.656.452
Goldman Sachs International (WTS) 0.000% 25-Apr-2025	9.600	868.188	Barclays Bank Plc (WTS) 17-Jan-2025	16.782	1.593.693
Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	8.345	858.558	AstraZeneca Plc	12.273	1.538.681
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	1.394.000	810.704	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	2.726.000	1.524.992
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	18.044.000	807.963	Microsoft Corp	4.995	1.496.034
United Kingdom Gilt 4.250% 07-Sep-2039	674.482	755.202	Barclays Bank Plc (WTS) 21-Jan-2025	15.572	1.480.669
			Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2024	1.451.000	1.435.619
			Roche Holding AG	5.311	1.426.306
			ICON Plc	6.775	1.417.448

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF	39.561	5.183.669	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15-Nov-2032	5.450.000	5.647.374
United States Treasury Note/Bond 4.000% 31-Jul-2030	4.550.000	4.408.770	United States Treasury Note/Bond 4.000% 31-Jul-2030	4.550.000	4.424.986
United Kingdom Gilt 3.250% 31-Jan-2033	3.650.000	4.399.675	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	4.950.000	3.246.243
Korea Treasury Bond 4.250% 10-Dec-2032	3.469.800.000	2.838.726	Korea Treasury Bond 4.250% 10-Dec-2032	3.469.800.000	2.892.355
United States Treasury Note/Bond 4.125% 15-Nov-2032	2.675.000	2.765.504	United Kingdom Gilt 3.250% 31-Jan-2033	2.350.000	2.689.006
Korea Treasury Bond 3.250% 10-Mar-2053	3.526.000.000	2.593.913	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	2.450.000	2.335.317
United States Treasury Note/Bond 3.875% 15-Aug-2033	2.200.000	2.208.259	Korea Treasury Bond 3.250% 10-Mar-2053	3.526.000.000	2.311.350
Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.375% 18-Jul-2038	1.568.000	1.754.546	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2032	2.450.000	2.291.542
United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	1.550.000	1.503.385	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	41.000.000	2.171.384
New Zealand Government Bond 2.000% 15-May-2032	2.681.000	1.433.880	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	44.075.000	2.082.551
Republic of South Africa Government Bond 8.750% 31-Jan-2044	35.044.000	1.411.087	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	1.784.000	1.892.371
Mexican Bonos 7.500% 26-May-2033	25.300.000	1.363.644	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.375% 18-Jul-2038	1.568.000	1.708.651
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-Aug-2028	1.400.000	1.359.920	New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	3.003.000	1.581.093
Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	1.256.000	1.357.597	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-May-2033	1.550.000	1.488.826
Mizuho Financial Group Inc 'emtn' 4.416% 20-May-2033	1.200.000	1.285.501	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.250% 15-Jun-2033	1.256.000	1.450.318
Resimac Bastille Trust Series 2023-1NC FRN 0.000% 09-Jan-2055	1.800.000	1.211.310	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 31-Jan-2044	35.044.000	1.413.290
Japan Government Twenty Year Bond 1.400% 20-Dec-2042	158.800.000	1.202.714	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-Aug-2028	1.400.000	1.357.948
Japan Government Twenty Year Bond 1.100% 20-Mar-2043	140.900.000	1.046.190	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	1.380.000	1.315.356
New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	1.850.000	1.014.273	Mizuho Financial Group Inc 'emtn' 4.416% 20-May-2033	1.200.000	1.281.515
Kering SA 'EMTN' 3.625% 05-Sep-2031	900.000	964.867	Mexican Bonos 7.500% 26-May-2033	25.300.000	1.278.597
			New Zealand Government Bond 2.000% 15-May-2032	2.681.000	1.259.253
			Japan Government Twenty Year Bond 1.400% 20-Dec-2042	158.800.000	1.240.553

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC
BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT) Forts.

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Medtronic Plc	271.399	24.214.033	Chubb Ltd	95.481	18.917.825
CRH Plc	250.342	14.412.149	Medtronic Plc	176.694	16.665.475
Becton Dickinson & Co	52.493	13.365.552	Gilead Sciences Inc	192.815	14.898.235
Kenvue Inc	551.027	12.672.989	RTX Corp	154.456	14.307.460
AT&T Inc	795.424	12.616.860	Eaton Corp Plc	88.006	13.562.322
AbbVie Inc	82.645	12.303.986	Cisco Systems Inc	220.877	11.481.739
L3Harris Technologies Inc	60.062	11.637.395	Exxon Mobil Corp	104.969	11.345.653
Occidental Petroleum Corp	157.646	9.545.833	Everest Re Group Ltd	30.515	11.302.784
Shell Plc ADR	152.405	9.393.426	Constellation Energy Corp	102.925	10.260.621
Assurant Inc	65.126	8.861.264	Marathon Petroleum Corp	77.551	10.189.015
Morgan Stanley	95.729	8.478.177	Hess Corp	61.814	9.406.076
Eaton Corp Plc	58.805	8.456.908	JPMorgan Chase & Co	65.365	9.245.540
Northrop Grumman Corp	18.398	8.245.583	Schlumberger NV	167.805	8.966.764
American International Group Inc	135.745	8.023.733	Sanofi ADR	167.363	8.914.673
Danaher Corp	37.260	7.693.032	Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	176.653	8.858.415
Intel Corp	199.426	7.397.593	Exelon Corp	216.665	8.257.264
Chubb Ltd	37.054	7.262.225	Morgan Stanley	87.940	7.549.210
Newmont Corp	174.057	7.162.435	Eli Lilly & Co	17.789	7.466.523
Goldman Sachs Group Inc/The	20.957	7.112.891	Caterpillar Inc	30.466	7.299.836
Las Vegas Sands Corp	150.395	6.949.666	CRH Plc	128.518	7.158.951
Voya Financial Inc	95.611	6.932.261	L3Harris Technologies Inc	39.568	7.127.185
Everest Re Group Ltd	18.611	6.775.689	Ameriprise Financial Inc	19.957	7.069.517
UnitedHealth Group Inc	13.012	6.728.474	CME Group Inc	35.150	7.046.051
RenaissanceRe Holdings Ltd	33.014	6.621.357	Allstate Corp/The	59.971	6.564.723
Wynn Resorts Ltd	64.430	6.513.367	Ares Management Corp - Class A	59.180	6.345.013
Dominion Energy Inc	140.370	6.506.827	US Bancorp	159.295	6.269.358
JPMorgan Chase & Co	44.415	6.481.997	Interpublic Group of Cos Inc/The	159.733	5.692.884
Allstate Corp/The	50.716	6.381.070	Assurant Inc	37.237	5.660.067
Marathon Petroleum Corp	50.407	6.365.128	Wynn Resorts Ltd	64.430	5.358.207
CF Industries Holdings Inc	75.921	6.210.124	Fidelity National Information Services Inc	94.259	5.222.907
Constellation Energy Corp	67.542	6.118.722	British American Tobacco Plc ADR	144.387	5.109.103
Charles Schwab Corp/The	96.896	6.001.908	Charles Schwab Corp/The	96.896	5.104.385
US Bancorp	152.708	5.786.211	Hewlett Packard Enterprise Co	342.000	4.983.907
Progressive Corp/The	42.422	5.776.716	Goldman Sachs Group Inc/The	14.530	4.820.426
Cisco Systems Inc	116.706	5.759.612	PPL Corp	177.107	4.773.658
International Game Technology Plc	207.280	5.620.163	Applied Materials Inc	35.195	4.722.484
FedEx Corp	22.765	5.476.262	Omnicom Group Inc	51.498	4.600.248
Willis Towers Watson Plc	24.877	5.409.195	Pioneer Natural Resources Co	19.475	4.590.359
CME Group Inc	27.291	5.340.779	Freeport-McMoRan Inc	114.878	4.385.180
Bank of America Corp	157.307	5.281.120	Voya Financial Inc	61.280	4.357.466
International Business Machines Corp	34.252	5.032.314	EOG Resources Inc	34.945	4.315.819
ConocoPhillips	44.823	5.015.991	Coca-Cola Co/The	70.849	4.136.926
Ares Management Corp - Class A	59.180	4.966.412	Bank of America Corp	141.473	4.087.279
Diamondback Energy Inc	28.900	4.706.480			
Pioneer Natural Resources Co	19.475	4.662.441			
Exxon Mobil Corp	43.453	4.624.739			

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 2.100% 01-Jul-2042	17.250.000	17.250.000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 2.100% 01-Jul-2042	17.250.000	17.250.000
City of Houston TX Combined Utility System Revenue 3.828% 15-May-2028	16.125.000	15.814.349	Texas Natural Gas Securitization Finance Corp 5.169% 01-Apr-2041	15.585.000	15.600.585
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp 5.169% 01-Apr-2041	15.585.000	15.585.000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 3.828% 15-May-2028	16.125.000	15.565.140
Metropolitan Transportation Authority 5.175% 15-Nov-2049	15.525.000	14.193.658	County of Broward FL Airport System Revenue 2.384% 01-Oct-2026	12.930.000	11.966.456
Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth 4.145% 01-Feb-2033	12.500.000	12.380.250	Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth 4.145% 01-Feb-2033	12.500.000	11.954.625
Commonwealth of Massachusetts 3.680% 15-Jul-2026	12.235.000	11.929.985	County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029	13.095.000	11.247.819
California State University 5.183% 01-Nov-2053	11.750.000	11.750.000	New York Power Authority 5.749% 15-Nov-2033	10.000.000	10.757.800
New York Power Authority 5.749% 15-Nov-2033	10.000.000	10.956.700	Dallas Fort Worth International Airport 3.089% 01-Nov-2040	13.440.000	10.564.378
New York Transportation Development Corp 6.971% 30-Jun-2051	10.000.000	10.000.000	Florida Municipal Power Agency 1.425% 01-Oct-2026	11.750.000	10.542.335
State of Wisconsin 4.415% 01-May-2025	10.000.000	9.995.600	PEFA Inc 5.000% 01-Sep-2049	9.850.000	9.995.091
Massachusetts School Building Authority 2.436% 15-Oct-2027	10.000.000	9.090.800	State of Wisconsin 4.415% 01-May-2025	10.000.000	9.949.900
Grand Parkway Transportation Corp 3.236% 01-Oct-2052	11.995.000	9.090.411	Grand Parkway Transportation Corp 3.236% 01-Oct-2052	11.995.000	9.060.063
Battery Park City Authority 4.800% 01-Nov-2028	8.490.000	8.615.907	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.375% 01-Aug-2034	10.000.000	8.971.600
Permanent University Fund - Texas A&M University System 3.660% 01-Jul-2047	9.655.000	8.446.194	State Board of Administration Finance Corp 2.154% 01-Jul-2030	10.295.000	8.578.618
Texas A&M University 2.906% 15-May-2048	10.975.000	8.024.701	Permanent University Fund - Texas A&M University System 3.660% 01-Jul-2047	9.655.000	8.224.226
County of Franklin OH 3.382% 01-Nov-2050	10.120.000	7.406.432	Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034	9.890.000	8.125.723
University of Nebraska Facilities Corp/The 3.037% 01-Oct-2049	9.545.000	7.245.469	Texas A&M University 2.906% 15-May-2048	10.975.000	7.930.645
North Dakota Housing Finance Agency 6.250% 01-Jan-2054	7.000.000	7.236.530	Providence Public Building Authority 5.000% 15-Sep-2039	7.395.000	7.905.255
Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 3.720% 01-Sep-2026	7.225.000	6.750.173	Black Belt Energy Gas District 5.250% 01-Feb-2053	7.500.000	7.891.125
Board of Regents of the University of Texas System 3.354% 15-Aug-2047	8.095.000	6.467.824	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 4.258% 01-Feb-2036	7.865.000	7.647.061
Water Works Board of the City of Birmingham/The 2.388% 01-Jan-2035	7.995.000	6.318.688	North Dakota Housing Finance Agency 6.250% 01-Jan-2054	7.000.000	7.221.760
Los Angeles Community College District/CA 5.500% 01-Aug-2024	6.000.000	6.000.000	University of Nebraska Facilities Corp/The 3.037% 01-Oct-2049	9.545.000	6.910.866
State of Connecticut 2.420% 01-Jul-2027	6.000.000	5.648.700	Municipal Electric Authority of Georgia 6.474% 01-Jul-2045	7.000.000	6.863.640
Sales Tax Securitization Corp 4.631% 01-Jan-2028	5.500.000	5.500.000	County of Cook IL 5.790% 15-Nov-2029	6.325.000	6.484.011
County of Miami-Dade Seaport Department 6.224% 01-Nov-2055	5.000.000	5.000.000	Board of Regents of the University of Texas System 3.354% 15-Aug-2047	8.095.000	6.424.273
Sales Tax Securitization Corp 4.736% 01-Jan-2030	5.000.000	4.975.050	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-May-2043	6.000.000	5.849.040
Massachusetts Educational Financing Authority 5.950% 01-Jul-2044	5.000.000	4.937.900	New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046	6.000.000	5.789.880
Maryland Economic Development Corp 5.250% 30-Jun-2055	5.040.000	4.811.520	North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033	7.000.000	5.511.240
New York Transportation Development Corp 4.375% 01-Oct-2045	5.000.000	4.767.900	Inland Valley Development Agency 5.500% 01-Mar-2033	5.000.000	4.951.950
Pennsylvania State University/The 2.790% 01-Sep-2043	6.000.000	4.575.300	State Board of Administration Finance Corp 1.258% 01-Jul-2025	5.000.000	4.731.550
New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028	5.000.000	4.374.850	City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033	4.000.000	4.505.740
California Community Choice Financing Authority 5.250% 01-Jan-2054	4.000.000	4.182.840	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2035	4.000.000	4.275.600
City of Houston TX Airport System Revenue 4.250% 01-Jul-2053	4.000.000	3.933.280			
New Jersey Turnpike Authority 0.638% 01-Jan-2024	3.825.000	3.723.179			
City & County of San Francisco CA 4.750% 15-Jun-2040	3.645.000	3.427.831			
Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2039	3.000.000	3.420.570			
Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 3.922% 31-Dec-2049	4.075.000	3.326.423			
University of California 3.349% 01-Jul-2029	3.500.000	3.290.595			

Responsible Horizons EM Debt Impact Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Alle Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 4.000% 15-Nov-2052	1.900.000	2.024.101	United States Treasury Note/Bond 4.000% 15-Nov-2052	1.900.000	2.016.582
Mexico Government International Bond 2.250% 12-Aug-2036	2.200.000	1.785.881	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	500.000	517.073
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	1.200.000	1.229.043	Shinhan Bank Co Ltd 'GMTN' 0.250% 16-Oct-2024	500.000	514.892
Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 7.129% 18-Jul-2033	1.200.000	1.211.725	Türkiye Sinai Katkinma Bankasi AS 'REGS' 5.875% 14-Jan-2026	400.000	386.088
Banca Comerciala Romana SA 'EMTN' FRN 7.625% 19-May-2027	1.000.000	1.123.640	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.000% 23-Apr-2029	400.000	371.866
Shinhan Bank Co Ltd 'GMTN' 0.250% 16-Oct-2024	1.000.000	1.039.561	Akbank TAS 'REGS' FRN 6.800% 22-Jun-2031	400.000	357.200
Philippine Government International Bond 4.200% 29-Mar-2047	1.200.000	1.028.688	Hana Bank 'REGS' 1.250% 16-Dec-2026	400.000	349.552
America Movil SAB de CV 3.625% 22-Apr-2029	1.100.000	1.020.914	Malaysia Wakala Sukuk Bhd 'REGS' 2.070% 28-Apr-2031	400.000	328.200
NE Property BV 'EMTN' 2.000% 20-Jan-2030	1.200.000	1.017.455	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	300.000	240.930
QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025	1.100.000	1.014.156	KEB Hana Bank 'REGS' 3.500% 30-Jan-2024	200.000	198.576
China Construction Bank Corp/Hong Kong 'EMTN' 1.250% 04-Aug-2025	1.100.000	1.013.296	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.500% 12-Apr-2028	200.000	192.608
Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2.750% 22-Jan-2033	1.200.000	988.004	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 1.000% 07-Mar-2029	200.000	191.327
Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	1.121.250	983.639	America Movil SAB de CV 3.625% 22-Apr-2029	200.000	182.504
Chile Government International Bond 1.250% 22-Jan-2051	1.700.000	969.057	Chile Government International Bond 0.555% 21-Jan-2029	200.000	180.855
CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 1.000% 02-Nov-2033	1.200.000	967.261	Telecomunicaciones Digitales SA 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030	200.000	164.576
Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	1.100.000	959.000	Greenko Power II Ltd 'REGS' 4.300% 13-Dec-2028	41.250	41.250
Hungary Government International Bond 1.750% 05-Jun-2035	1.200.000	921.723			
IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	1.000.000	913.920			
P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	1.000.000	897.695			
mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	800.000	882.470			
Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London 'GMTN' 1.625% 28-Dec-2025	749.000	847.122			
African Development Bank 0.250% 21-Nov-2024	800.000	827.890			
Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Luxembourg 'GMTN' 0.125% 28-Oct-2024	800.000	822.642			
Georgian Railway JSC 'REGS' 4.000% 17-Jun-2028	900.000	785.000			
CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	900.000	780.000			
SK Hynix Inc 'REGS' 2.375% 19-Jan-2031	1.000.000	766.628			
Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	800.000	761.569			
HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	800.000	761.300			
Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 5.250% 10-Jan-2028	800.000	755.750			
Consorcio Transmantaro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	800.000	749.750			
Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.000% 23-Apr-2029	800.000	747.546			
LG Chem Ltd 'REGS' 2.375% 07-Jul-2031	900.000	744.721			
C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	800.000	737.500			
Export-Import Bank of Korea 5.125% 11-Jan-2033	700.000	728.502			
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 'REGS' 6.750% 24-Apr-2033	729.720	724.855			
Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS' 4.850% 14-Oct-2038	800.000	721.400			
Peruvian Government International Bond 1.950% 17-Nov-2036	900.000	718.344			
Telecomunicaciones Digitales SA 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030	800.000	712.000			
Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' 9.250% 16-Oct-2028	700.000	709.655			
Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	800.000	680.800			
ORLEN SA 'EMTN' 1.125% 27-May-2028	700.000	667.249			
Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 1.000% 07-Mar-2029	700.000	665.381			
Axian Telecom 'REGS' 7.375% 16-Feb-2027	700.000	642.300			
Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 'REGS' 10.875% 15-Jan-2031	650.000	639.125			
Benin Government International Bond 'REGS' 4.950% 22-Jan-2035	800.000	631.913			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Dec-2023	20.000.000	19.760.954	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 3.631% 13-Dec-2029	21.736.000	21.286.557
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Zero Coupon) 0.000% 15-Aug-2031	18.500.000	15.207.150	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 13-Dec-2023	20.000.000	19.817.904
Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	11.982.000	11.943.059	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Zero Coupon) 0.000% 15-Aug-2031	18.500.000	15.239.015
HSBC Holdings PLC 'EMTN' FRN 4.856% 23-May-2033	10.614.000	10.614.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3.875% 16-Jun-2032	14.600.000	14.182.684
Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	11.000.000	10.265.225	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	10.950.000	11.204.223
Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 3.631% 13-Dec-2029	10.168.000	10.168.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 4.856% 23-May-2033	10.614.000	10.651.238
AstraZeneca PLC 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	8.935.000	9.044.206	Societe Generale SA 'EMTN' 2.625% 30-May-2029	10.600.000	10.303.032
ING Groep NV FRN 4.500% 23-May-2029	9.000.000	8.969.220	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	8.387.000	8.403.166
Kutxabank SA FRN 4.750% 15-Jun-2027	8.900.000	8.876.949	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024	8.241.000	8.225.049
Ford Motor Credit Co LLC 4.867 % 03-Aug-2027	8.835.000	8.834.735	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	7.500.000	7.421.731
Stellantis NV 'EMTN' 4.250% 16-Jun-2031	8.900.000	8.819.265	Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	8.000.000	7.068.359
Schneider Electric SE 'EMTN' 3.500% 12-Jun-2033	8.700.000	8.614.418	UBS Group AG 1.500% 30-Nov-2024	6.970.000	6.970.000
RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 02-Oct-2029	8.466.000	8.479.989	KBC Group NV 'EMTN' 3.000% 25-Aug-2030	7.100.000	6.611.520
WPP Finance SA 'EMTN' 4.125% 30-May-2028	7.803.000	7.802.752	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2.125% 21-Jun-2052	8.000.000	6.340.741
Motability Operations Group Plc 'EMTN' 3.500% 17-Jul-2031	7.535.000	7.463.588	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 4.000% 24-Jun-2032	6.500.000	6.259.488
Svenska Handelsbanken AB 'EMTN' 3.750% 05-May-2026	6.933.000	6.913.865	Enel Finance International NV 'eMTN' 4.500% 20-Feb-2043	6.448.000	6.134.957
BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.125% 26-Sep-2032	6.900.000	6.857.634	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 5.148% 25-Jan-2034	5.868.000	6.110.506
Deutsche Boerse AG 3.875% 28-Sep-2033	6.800.000	6.716.292	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	6.199.000	6.022.517
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3.875% 16-Jun-2032	6.700.000	6.697.588	ING Groep NV FRN 4.500% 23-May-2029	6.000.000	5.967.660
Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 5.000% 04-Jul-2031	6.483.000	6.462.384	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	6.346.000	5.937.712

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	700.000	737.193	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	600.000	633.185
Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	718.000	717.126	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 1.500% 04-Dec-2024	550.000	550.000
BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 4.375% 13-Jan-2029	700.000	699.070	ICADE 1.500% 13-Sep-2027	400.000	367.992
RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 14-Jun-2028	559.000	563.424	Stellantis NV 'EMTN' 4.375% 14-Mar-2030	318.000	318.439
Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 4.500% 09-Nov-2028	505.000	507.059	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	300.000	294.372
NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 4.699% 14-Mar-2028	456.000	454.666	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	300.000	276.886
E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	500.000	453.367	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	300.000	256.917
Banque Stellantis France SACA 'EMTN' 3.875% 19-Jan-2026	400.000	397.385	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	300.000	255.877
E.ON SE 'EMTN' 3.875% 12-Jan-2035	396.000	393.080	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.125% 09-Dec-2027	300.000	253.812
Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	400.000	377.185	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	300.000	237.648
Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 4.375% 18-Jan-2031	400.000	372.085	Thermo Fisher Scientific Inc 0.875% 01-Oct-2031	300.000	235.054
UBS AG/London 'EMTN' 0.010% 29-Jun-2026	400.000	354.314	Forvia SE 2.375% 15-Jun-2029	250.000	205.650
Kutxabank SA FRN 4.750% 15-Jun-2027	300.000	299.223	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	250.000	198.500
Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.500% 30-May-2026	300.000	297.207	E.ON SE 'EMTN' 3.875% 12-Jan-2035	200.000	195.862
VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	350.000	287.832	BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024	200.000	193.444
BNP Paribas SA FRN 0.500% 04-Jun-2026	300.000	283.794	BPCE SA 0.125% 04-Dec-2024	200.000	189.129
Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	300.000	279.961	Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	200.000	188.737
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.000% 21-Jun-2026	300.000	275.307	de Volksbank NV 'EMTN' 0.250% 07-May-2027	200.000	187.081
Ford Motor Co 6.100% 19-Aug-2032	300.000	269.627	KBC Group NV 'EMTN' 3.000% 25-Aug-2030	200.000	186.907
DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 4.500% 19-Jul-2028	250.000	250.677	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.500% 05-Jun-2027	200.000	182.900
ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	300.000	240.960	EDP Finance BV 'EMTN' 1.875% 21-Sep-2029	200.000	180.210
P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	300.000	236.993	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 07-Sep-2026	200.000	178.793
AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	225.000	226.958	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 0.500% 17-Nov-2027	200.000	177.018
Commerzbank AG FRN 5.250% 25-Mar-2029	200.000	201.426	Comcast Corp 4.650% 15-Feb-2033	200.000	176.152
mBank SA 'EMTN' FRN 8.375% 11-Sep-2027	200.000	200.945	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	200.000	174.238
Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 7.500% 14-Sep-2029	200.000	200.000	Ford Motor Co 6.100% 19-Aug-2032	200.000	173.981
Skandinaviska Enskilda Banken AB 'EMTN' 4.375% 06-Nov-2028	200.000	199.982	Societe Generale SA FRN 0.875% 22-Sep-2028	200.000	172.382
Societe Generale SA 'EMTN' 4.125% 21-Nov-2028	200.000	199.708	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 'REGs' 2.000% 01-Sep-2028	200.000	170.000
Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 3.700% 30-May-2031	200.000	199.360	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	200.000	169.559
Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 4.125% 11-Dec-2030	200.000	198.786	de Volksbank NV 'EMTN' 0.375% 03-Mar-2028	200.000	166.854
Koninklijke Ahold Delhaize NV 3.500% 04-Apr-2028	200.000	198.691	VF Corp 0.250 % 25-Feb-2028	200.000	165.202
Motability Operations Group Plc 'EMTN' 3.500% 17-Jul-2031	200.000	198.560	Alliander NV 'EMTN' 0.375% 10-Jun-2030	200.000	163.996
Amprion GmbH 'EMTN' 4.125% 07-Sep-2034	200.000	198.320	NN Group NV 'EMTN' FRN 6.000% 03-Nov-2043	150.000	150.981
Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	200.000	198.245	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.750% 30-Jun-2031	200.000	149.250
Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.875% 25-April-2028	200.000	197.875	Digital Intrepid Holding BV 1.375% 18-Jul-2032	200.000	143.938
Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 3.625% 18-Jan-2033	200.000	197.401	Verizon Communications Inc 1.500% 18-Sep-2030	200.000	140.813
ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	200.000	197.384	RCI Banque SA 'EMTN' 4.875% 14-Jun-2028	140.000	140.039
Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	200.000	196.323	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.250% 04-Apr-2028	150.000	137.423
EDP Servicios Financieros Espana SA 'EMTN' 4.125% 04-Apr-2029	194.000	192.419	AstraZeneca Plc 'EMTN' 3.750% 03-Mar-2032	125.000	125.510
			Amgen Inc 3.000% 22-Feb-2029	150.000	124.560
			E.ON SE 'EMTN' 4.000% 29-Aug-2033	122.000	118.093
			Orsted AS FRN 1.500% 18-Feb-2021	150.000	114.000
			Orsted AS 'EMTN' 3.750% 01-Mar-2030	111.000	111.386

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) (zurückgetreten am 8. Februar 2023)

Greg Brisk (Brite)

Claire Cawley (Irin)^**

Caylie Stallard (Neuseeländerin)

Mark Flaherty (Ire)

Sarah Cox (Britin) (bestellt am 9. Februar 2023)

Sandeep Sumal (Brite) (bestellt am 30. August 2023)

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

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*
Marunouchi Trust Tower Main
1-8-3 Marunouchi
Chiyoda-ku
Tokio 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
NY 10166
Vereinigte Staaten von Amerika

Insight North America LLC
200 Park Avenue
New York
NY 10166
Vereinigte Staaten von Amerika

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
Vereinigte Staaten von Amerika

Newton Investment Management Japan Ltd*
Marunouchi Trust Tower Main
1-8-3 Marunouchi
Chiyoda-ku
Tokyo 100-0005
Japan

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.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

„S&P 500®“ ist eine Marke der The McGraw-Hill Companies, Inc. und ist für die Verwendung durch BNY Mellon Global Funds, plc lizenziert. Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wird nicht von Standard & Poor's gefördert, unterstützt, verkauft oder empfohlen und Standard & Poor's übernimmt keine Gewährleistungen hinsichtlich der Ratsamkeit von Anlagen in den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker.

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.

ANLAGE 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 -praktiken in einer Weise an, die ihrer Größe und der 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 Bestellung eines Dritten, der gemäß einer formalen Übertragungsvereinbarung im Namen des OGAW Anlageentscheidungen trifft, die sich auf das Risikoprofil der jeweiligen Teilfonds auswirken können, diesen Grundsatz der Verhältnismäßigkeit 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 Geschäftsleitung und andere Mitarbeiter aus 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 eine feste und keine variable Vergütungskomponente 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 Geschäftsleitung 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 die Anleger nicht zum Eingehen unnötiger oder 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 2023:

	USD
Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr (ohne MwSt.)	554.014
Davon feste Vergütung	359.483
Davon variable Vergütung	194.531

ANLAGE 2

ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“)

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 verliehenen Wertpapiere nach Fonds als Anteil der verleihbaren Vermögenswerte insgesamt sowie der Nettoinventarwert jedes Fonds per 31. Dezember 2023 angegeben:

Fonds	Währung	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere	% der Summe der verleihbaren Vermögenswerte	% des Netto- inventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	30.144.693	14,93	10,33
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	7.431.678	26,15	11,01
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	2.703.454	1,24	1,15
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	1.844.418	0,89	0,84
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	489.377	0,68	0,66
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	66.000.965	4,58	4,50
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	436.444	2,23	1,85
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	1.500.927	7,96	4,93
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	25.717.124	14,96	13,82
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	4.170.549	7,46	7,14
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	32.060.989	10,47	6,58
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	14.695.608	16,96	8,05
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	11.283.388	10,15	9,80
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	3.809.148	4,01	3,99
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	431.995	2,02	1,41
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	136.069.618	20,99	10,80
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	4.990.343	21,09	12,23
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	23.384.526	17,48	10,24
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.871.984	9,52	6,30
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	1.679.877.102	9,69	9,41
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	6.044.065	12,68	11,98
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	22.730.619	5,77	5,46

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 2023 bei jedem Sicherheitentreuhänder als Sachsicherheit gehalten wurden, die im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden:

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund		EUR	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	8.153.219		Euroclear Triparty	459.736
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	4.019.874			459.736
	Euroclear Triparty	18.966.244			
		31.139.337	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund		USD
				Euroclear Triparty	1.577.259
					1.577.259
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund		EUR	BNY Mellon Euroland Bond Fund		EUR
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.602.811		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	5.578.012
	Euroclear Triparty	5.052.214		Euroclear Triparty	20.881.663
		7.655.025			26.459.675
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund		USD	BNY Mellon European Credit Fund		EUR
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.544.126		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	461.428
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	360.231		Euroclear Triparty	3.822.261
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	219.046			4.283.690
		3.123.403	BNY Mellon Global Bond Fund		USD
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund		USD		Euroclear Triparty	33.200.048
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.496.427			33.200.048
	Euroclear Triparty	392.751	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund		USD
		1.889.178		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	11.419.313
BNY Mellon Efficient Global IG Corpo- rate Beta Fund		USD		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.970.271
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	314.188		Euroclear Triparty	2.703.748
	Euroclear Triparty	189.225			16.093.332
		503.413	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund		USD
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund		USD		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.037.873
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	67.382.392		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	5.988.003
		67.382.392		Euroclear Triparty	3.535.387
					11.561.263

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund		USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	4.112.841		Euroclear Triparty	880.905
		4.112.841		JPMorgan Chase Bank, N.A.	1.313.716
					25.636.330
BNY Mellon Global Opportunities Fund		USD	BNY Mellon Global Unconstrained Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	475.599		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.059.346
		475.599			2.059.346
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)		EUR	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund		JPY
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	57.723.267		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	1.410.298.779
	Euroclear Triparty	78.555.776		JPMorgan Chase Bank, N.A.	436.769.919
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	7.188.579			1.847.068.698
		143.467.622			
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)		GBP	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund		EUR
	Euroclear Triparty	4.877.007		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	6.573.451
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	230.261			6.573.451
		5.107.267			
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)		USD	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	23.441.709		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	20.902.360
				JPMorgan Chase Bank, N.A.	3.639.484
					24.541.844

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; Internationale Finanz-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.

ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (UNGEPRÜFT) Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Art und Qualität der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2023:

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			EUR	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	31.139.333		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	67.382.392
			31.139.333				67.382.392
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			EUR	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	7.655.025		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	459.736
			7.655.025				459.736
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund			USD	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	717.339		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.577.259
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	2.406.064				1.577.259
			3.123.403	BNY Mellon Euroland Bond Fund			EUR
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			USD		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	25.992.582
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.889.178		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	467.093
			1.889.178				26.459.675
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund			USD	BNY Mellon European Credit Fund			EUR
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	503.413		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	4.283.690
			503.413				4.283.690

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Bond Fund			USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)			EUR
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		33.200.048	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		81.492.378
			33.200.048	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		61.975.244
							143.467.622
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund			USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			GBP
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		6.222.364	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		4.877.269
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		9.870.968	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		229.998
			16.093.332				5.107.267
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund			USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)			USD
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		11.561.263	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		1.115.548
			11.561.263	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		24.520.782
							25.636.330
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			USD	BNY Mellon Global Unconstrained Fund			USD
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		4.073.467	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		2.059.346
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		39.374				2.059.346
			4.112.841				
BNY Mellon Global Opportunities Fund			USD	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			USD
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		475.599	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		590.918.599
			475.599	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		1.256.150.099
							1.847.068.698

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			EUR
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.049.207
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	3.524.244
			6.573.451
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	20.485.750
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	4.056.094
			24.541.844

In den folgenden Tabellen sind die zehn wichtigsten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihen entgegengenommen wurden, per 31. Dezember 2023 aufgeführt:

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD
German Federal Republic	7.347.527	Vereinigte Staaten von Amerika	340.609
French Republic	7.050.617	French Republic	63.725
Vereinigte Staaten von Amerika	4.428.349	German Federal Republic	29.462
Kingdom of Belgium	3.777.776	Republic of Austria	22.895
Vereinigtes Königreich	3.570.981	Kingdom of Belgium	21.013
Republic of Austria	1.659.741	Republic of Finland	8.179
European Investment Bank	1.124.700	European Investment Bank	5.595
Kingdom of the Netherlands	1.113.619	Vereinigtes Königreich	3.946
Norwegian Government	466.166	Kingdom of the Netherlands	3.290
Republic of Finland	267.737	International Bank for Reconstruction & Development	2.548
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund[▲]	USD
French Republic	3.039.284	Vereinigte Staaten von Amerika	67.382.393
Vereinigtes Königreich	2.629.467		
Kingdom of Belgium	1.300.676	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD
Republic of Austria	297.234	French Republic	128.322
Government of Canada	168.604	International Bank for Reconstruction & Development	112.182
Kingdom of the Netherlands	91.385	European Investment Bank	82.102
Republic of Finland	48.580	Vereinigtes Königreich	47.919
German Federal Republic	48.048	Kingdom of Belgium	47.785
Vereinigte Staaten von Amerika	31.022	German Federal Republic	30.017
The Grand Duchy of Luxembourg	556	Republic of Austria	9.446
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	Kingdom of the Netherlands	1.710
Vereinigte Staaten von Amerika	403.800	Commonwealth of Australia	225
BNP Paribas SA	214.240	Republic of Finland	15
Vinci SA	214.239		
Airbus SE	214.237	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD
Broadcom Inc	214.236	French Republic	883.593
Phillips 66	212.108	Kingdom of Belgium	320.284
SoftBank Group Corp	203.341	Republic of Austria	244.655
Daiichi Sankyo Co Ltd	165.572	Vereinigtes Königreich	95.795
French Republic	150.650	Kingdom of the Netherlands	13.437
Cognizant Technology Solutions Corp	83.253	Republic of Finland	7.143
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	German Federal Republic	7.065
Vereinigte Staaten von Amerika	1.498.838	Vereinigte Staaten von Amerika	4.560
French Republic	236.217	European Investment Bank	627
Kingdom of Belgium	101.112	The Grand Duchy of Luxembourg	82
Republic of Austria	23.107		
Vereinigtes Königreich	15.232		
Kingdom of the Netherlands	7.104		
Republic of Finland	3.777		
German Federal Republic	3.735		
The Grand Duchy of Luxembourg	43		
International Bank for Reconstruction & Development	10		

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD
French Republic	12.247.449	Vereinigte Staaten von Amerika	2.283.870
German Federal Republic	3.725.208	French Republic	2.064.865
Vereinigtes Königreich	1.835.595	Stellantis NV	726.377
Republic of Austria	1.819.188	Kingdom of Belgium	621.448
European Investment Bank	1.513.108	BNP Paribas SA	442.829
Vereinigte Staaten von Amerika	1.348.651	Unilever PLC	438.250
Kingdom of Belgium	1.152.736	Hermes International SCA	429.377
Kingdom of the Netherlands	984.614	Rio Tinto PLC	366.992
Republic of Finland	632.499	AXA SA	364.268
International Bank for Reconstruction & Development	585.794	European Investment Bank	344.028
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD
French Republic	1.646.005	Vereinigte Staaten von Amerika	6.116.640
Vereinigtes Königreich	677.627	French Republic	2.071.731
German Federal Republic	662.585	Kingdom of Belgium	804.744
Republic of Austria	394.825	German Federal Republic	764.404
Vereinigte Staaten von Amerika	378.016	Vereinigtes Königreich	483.295
Kingdom of the Netherlands	132.381	Republic of Austria	452.926
Kingdom of Belgium	115.673	European Investment Bank	430.302
European Investment Bank	107.753	Kingdom of the Netherlands	199.204
Republic of Finland	99.784	Republic of Finland	142.116
International Bank for Reconstruction & Development	24.772	Norwegian Government	64.813
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund ^	USD
French Republic	10.997.214	Vereinigte Staaten von Amerika	1.616.499
Kingdom of Belgium	8.484.287	Vereinigtes Königreich	985.502
Republic of Austria	3.690.815	French Republic	924.165
Vereinigtes Königreich	3.215.645	German Federal Republic	278.329
German Federal Republic	3.015.747	Kingdom of the Netherlands	259.397
Kingdom of the Netherlands	1.385.094	Amazon.com Inc	39.374
Norwegian Government	1.251.753	Kingdom of Belgium	7.676
European Investment Bank	739.466	Government of Canada	1.900
International Bank for Reconstruction & Development	170.915	BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD
Republic of Finland	126.626	Amazon.com Inc	47.560
		Alphabet Inc	47.560
		Apple Inc	47.560
		BP PLC	47.560
		Shell PLC	47.560
		Microsoft Corp	47.560
		Meta Platforms Inc	40.180
		Barclays PLC	39.929
		JPMorgan Chase & Co	38.991
		Rolls-Royce Holdings PLC	37.249

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD
French Republic	40.834.573	Stellantis NV	92.031
Republic of Austria	18.668.137	Alphabet Inc	81.285
Kingdom of Belgium	11.502.591	Amazon.com Inc	67.294
Vereinigtes Königreich	5.880.067	Chipotle Mexican Grill Inc	58.979
Stellantis NV	4.011.816	Pioneer Natural Resources Co	58.845
Hermes International SCA	2.770.132	BNP Paribas SA	56.203
Rio Tinto PLC	2.459.843	Berkshire Hathaway Inc	56.172
BNP Paribas SA	2.445.780	Unilever PLC	55.526
Unilever PLC	2.420.478	Hermes International SCA	54.402
AXA SA	2.011.872	Progressive Corp/The	49.225
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY
Vereinigtes Königreich	4.877.007	Vereinigte Staaten von Amerika	352.561.630
Novartis AG	23.026	French Republic	136.466.382
Nestle SA	23.026	Novartis AG	108.981.475
SAP SE	23.026	Microsoft Corp	74.199.014
ASML Holding NV	23.026	Hess Corp	74.196.669
Siemens AG	23.026	McDonald's Corp	70.262.610
Rio Tinto PLC	13.867	Cisco Systems Inc	65.185.633
Hermes International SCA	12.770	Amazon.com Inc	58.949.703
Allianz SE	10.618	Vereinigtes Königreich	49.669.286
NRG Energy Inc	10.063	Roche Holding AG	48.090.710
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR
Alphabet Inc	2.310.265	Vereinigte Staaten von Amerika	1.097.780
Chipotle Mexican Grill Inc	2.035.158	Vereinigtes Königreich	809.247
Pioneer Natural Resources Co	2.019.972	French Republic	603.798
Berkshire Hathaway Inc	1.928.238	German Federal Republic	439.931
Amazon.com Inc	1.854.831	Fast Retailing Co Ltd	143.611
Progressive Corp/The	1.689.768	Toyota Motor Corp	138.970
O'Reilly Automotive Inc	1.473.262	Shell PLC	138.840
Bristol-Myers Squibb Co	1.369.102	Microsoft Corp	135.877
Citigroup Inc	1.251.730	Barclays PLC	128.072
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.086.004	Amazon.com Inc	117.940
		BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD
		Vereinigte Staaten von Amerika	6.843.084
		French Republic	6.402.865
		Kingdom of Belgium	2.364.381
		Swiss Federation	2.036.965
		Vereinigtes Königreich	1.500.950
		German Federal Republic	1.317.241
		Novartis AG	400.980
		Nestle SA	363.948
		SAP SE	363.948
		ASML Holding NV	363.948

^ Wenn zum 31. Dezember 2023 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 2023:

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD
Australischer Dollar	2.545	Australischer Dollar	452
Kanadischer Dollar	532	Dänische Krone	1.041
Dänische Krone	4.960	Euro	157.347
Euro	22.620.974	Pfund Sterling	3.952
Neuseeländischer Dollar	43.029	Schwedische Krone	7
Norwegische Krone	466.166	US-Dollar	340.614
Pfund Sterling	3.571.433		503.413
Schwedische Krone	605		
US-Dollar	4.429.089	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD
	31.139.333	US-Dollar	67.382.392
			67.382.392
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	GBP	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD
Kanadischer Dollar	168.604	Australischer Dollar	225
Euro	4.825.764	Euro	410.991
Pfund Sterling	2.629.508	Neuseeländischer Dollar	1
US-Dollar	31.150	Pfund Sterling	48.152
	7.655.025	Schwedische Krone	327
		US-Dollar	40
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD		459.736
Kanadischer Dollar	129	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD
Euro	1.114.840	Dänische Krone	1
Japanischer Yen	526.083	Euro	1.476.257
Pfund Sterling	105.752	Pfund Sterling	95.801
Schweizer Franken	50.894	Schwedische Krone	177
US-Dollar	1.325.705	US-Dollar	5.023
	3.123.403		1.577.259
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD		
Euro	375.095		
Pfund Sterling	15.236		
US-Dollar	1.498.847		
	1.889.178		

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD
Australischer Dollar	25.906	Australischer Dollar	292.084
Kanadischer Dollar	6.017	Kanadischer Dollar	66.184
Dänische Krone	53.332	Euro	6.896.768
Euro	22.744.786	Japanischer Yen	354.811
Japanischer Yen	300.110	Pfund Sterling	4.066.134
Neuseeländischer Dollar	994	Schweizer Franken	1.148
Norwegische Krone	10.724	US-Dollar	4.416.203
Pfund Sterling	1.871.804		16.093.332
Schwedische Krone	1.765		
Schweizer Franken	16.443	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD
US-Dollar	1.427.794	Australischer Dollar	2.062
	26.459.675	Dänische Krone	4.803
		Euro	4.883.536
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	Neuseeländischer Dollar	5.982
Australischer Dollar	10.270	Norwegische Krone	64.813
Kanadischer Dollar	133	Pfund Sterling	483.306
Dänische Krone	12.553	US-Dollar	6.116.761
Euro	3.174.560		11.561.263
Neuseeländischer Dollar	808		
Norwegische Krone	8.754	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD
Pfund Sterling	698.437	Kanadischer Dollar	1.900
Schwedische Krone	88	Euro	1.469.568
US-Dollar	378.087	Pfund Sterling	985.502
	4.283.690	US-Dollar	1.655.871
			4.112.841
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD
Australischer Dollar	297	Euro	1.108
Kanadischer Dollar	634	Pfund Sterling	194.653
Euro	28.609.968	Schweizer Franken	966
Neuseeländischer Dollar	115.540	US-Dollar	278.872
Norwegische Krone	1.251.753		475.599
Pfund Sterling	3.215.758		
Schwedische Krone	143		
US-Dollar	5.955		
	33.200.048		

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY
Australischer Dollar	18.263	Kanadischer Dollar	93.446
Dänische Krone	42.630	Euro	430.492.249
Euro	96.777.340	Japanischer Yen	48.725.710
Japanischer Yen	2.446.809	Pfund Sterling	172.911.991
Pfund Sterling	28.867.853	Schweizer Franken	216.455.255
Schwedische Krone	15.572	US-Dollar	978.390.047
Schweizer Franken	1.573.650		1.847.068.698
US-Dollar	13.725.505		
	143.467.622	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR
		Kanadischer Dollar	145
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	Euro	1.750.764
Euro	101.532	Japanischer Yen	889.709
Japanischer Yen	11.692	Pfund Sterling	1.422.218
Pfund Sterling	4.921.572	Schweizer Franken	185.011
Schweizer Franken	50.203	US-Dollar	2.325.604
US-Dollar	22.268		6.573.451
	5.107.267	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD
		Euro	11.723.705
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	Japanischer Yen	194.000
Euro	1.690.083	Pfund Sterling	2.214.870
Japanischer Yen	113.401	Schweizer Franken	2.898.044
Pfund Sterling	257.631	US-Dollar	7.511.225
Schweizer Franken	286.427		24.541.844
US-Dollar	23.288.788		
	25.636.330		
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD		
Euro	440.315		
Japanischer Yen	44.954		
Pfund Sterling	550.915		
Schweizer Franken	421		
US-Dollar	1.022.741		
	2.059.346		

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Wertpapierleihgeschäften und der entgegengenommenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2023:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der verliehenen Wertpapiere und bei Sachsicherheiten dem vertraglichen Fälligkeitstermin des als Sicherheit entgegengenommenen Wertpapiers.

Fonds	Unter 1 Tag bis 1 Woche	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Unbefristet	Gesamt
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	30.144.693	-	30.144.693
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	244.482	90.203	685.458	30.119.190	-	31.139.333
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	7.431.678	-	-	-	7.431.678
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	975	-	250.279	7.403.771	-	7.655.025
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	2.703.454	2.703.454
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	10.189	14.255	20.957	671.938	2.406.064	3.123.403
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1.844.418	-	1.844.418
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	1.198	88.577	69.478	1.729.925	-	1.889.178
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	489.377	-	489.377
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	1.483	22.886	36.299	442.745	-	503.413
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	1.531.765	64.469.199	-	66.000.965
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	503	509	1.220.594	66.160.786	-	67.382.392
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	436.444	-	436.444
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	15.160	1.262	5.043	438.271	-	459.736

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Unter 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	Unbefristet	Gesamt
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1.500.927	-	1.500.927
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	143	-	48.014	1.529.102	-	1.577.259
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	25.717.124	-	25.717.124
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	84.352	77.894	1.241.097	24.589.239	467.093	26.459.675
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	4.170.549	-	4.170.549
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	7.685	27.140	180.688	4.068.177	-	4.283.690
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	191.968	31.869.021	-	32.060.989
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	582.422	34.928	187.808	32.394.890	-	33.200.048
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	14.695.608	-	14.695.608
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	1.544	41.988	635.137	5.543.695	9.870.968	16.093.332
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	11.283.388	-	11.283.388
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	30.360	6.896	452.743	11.071.264	-	11.561.263
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	3.809.148	3.809.148
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	30.324	841.731	3.201.413	39.373	4.112.841
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	431.995	431.995
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	-	475.599	475.599

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Unter 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	Unbefristet	Gesamt
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	66.412.505	-	62.870.726	6.786.387	136.069.618
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	958	43.087	1.733.275	79.715.058	61.975.244	143.467.622
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Verliehene Wertpapiere	-	-	2.884.071	-	-	1.896.953	209.319	4.990.343
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	752	694	545	4.875.278	229.998	5.107.267
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	22.094.120	1.290.406	23.384.526
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	36	3.640	50.493	1.061.379	24.520.782	25.636.330
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1.748.737	123.247	1.871.984
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	-	2.059.346	2.059.346
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	1.679.877.102	1.679.877.102
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	6.613.706	183.583.865	400.720.949	1.256.150.178	1.847.068.698
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	6.044.065	6.044.065
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	393.235	439.569	2.216.404	3.524.243	6.573.451
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	22.730.619	22.730.619
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	72.851	341.634	20.071.265	4.056.094	24.541.844

TRANSAKTIONEN MIT AKTIEN-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS

Die nachfolgenden Tabellen enthalten ausführliche Angaben zum gesamten Brutto-Nominalvolumen von Aktien-Swaps und Total Return Swaps sowie den absoluten beizulegenden Zeitwert als Anteil des Netto-inventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 31. Dezember 2023:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Gesamter Bruttonominalwert	Absoluter beizu- legender Zeitwert	% des Netto- inventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			EUR	EUR	
	BNP Paribas	Vereinigte Staaten von Amerika	224.531	224.531	0,08

TRANSAKTIONEN MIT AKTIEN-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Gesamter Bruttonominalwert	Absoluter beizulegender Zeitwert	% des Netto- inventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.			EUR	EUR	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	1.362.712	1.362.712	0,47
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	1.605.195	1.605.195	0,55
	Morgan Stanley	Vereinigtes Königreich	509.356	509.356	0,17
	Gesamt		3.701.794	3.701.794	1,27
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund*			EUR	EUR	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	178.227	178.227	0,71
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	84.887	84.887	0,34
	Gesamt		263.114	263.114	1,05
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			EUR	EUR	
	BNP Paribas	Vereinigte Staaten von Amerika	65.138.775	14.241.105	21,11
	Gesamt		65.138.775	14.241.105	21,11
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund			USD	USD	
	Bank of America Merrill Lynch	Vereinigtes Königreich	6.316.840	59.243	0,23
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	57.715.800	507.852	1,95
	Gesamt		64.032.640	567.095	2,18
BNY Mellon Global Credit Fund			USD	USD	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	3.077.038	3.077.038	0,30
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	96.270	96.270	0,01
	Morgan Stanley	Vereinigtes Königreich	1.799.554	1.799.554	0,17
	Gesamt		4.972.862	4.972.862	0,48
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund			USD	USD	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	395.241	395.241	0,42
	Morgan Stanley	Vereinigtes Königreich	190.667	190.667	0,20
	Gesamt		585.908	585.908	0,62
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund			EUR	EUR	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	1.759.489	1.759.489	0,16
	Gesamt		1.759.489	1.759.489	0,16

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

TRANSAKTIONEN MIT AKTIEN-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse der Währungen der vom Fonds im Rahmen von offenen Derivatgeschäften vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 31. Dezember 2023:

Fonds	Währung	Erhaltene Barsicherheiten	Gestellte Barsicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund		EUR	EUR
	Euro	1.030.000	(360.000)
		1.030.000	(360.000)
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund		EUR	EUR
	Euro	1.870.000	-
		1.870.000	-

TRANSAKTIONEN MIT AKTIEN-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Aktien-Swaps und Total Return Swaps (Nettoengagement) und der in diesem Zusammenhang vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 31. Dezember 2023:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der offenen Derivate.

Fonds	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monat 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Monate 1 Jahr	Unbefristet	Gesamt
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Total Return Swaps	–	–	–	(2.715.854)	–	–	–	(2.715.854)
BNY Mellon Absolute Return Credit Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Total Return Swaps	–	–	–	134.358	–	–	–	134.358
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien-Swaps	–	–	–	–	(5.758.638)	–	–	(5.758.638)
Total Return Swaps	566.798	–	–	(27.672)	6.307.242	447.700	–	7.294.068
Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten	670.000	–	–	–	–	–	–	670.000
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Aktien-Swaps	–	–	(59.244)	–	(236.215)	60.849	–	(234.610)
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Total Return Swaps	–	–	–	3.383.426	–	–	–	3.383.426
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Total Return Swaps	–	–	–	418.370	–	–	–	418.370
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Total Return Swaps	–	–	–	1.759.489	–	–	–	1.759.489
Erhaltene Barsicherheiten	1.870.000	–	–	–	–	–	–	1.870.000

ANLAGE 3

VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE- VERORDNUNG (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2023 sind der BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund, der BNY Mellon Asian Income Fund, der BNY Mellon Asian Opportunities Fund, der BNY Mellon Brazil Equity Fund, der BNY Mellon Dynamic Factor Premium V10 Fund, der BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund, der BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund*, der BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*, der BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund, der BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund, der BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund, der BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund, der BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund, der BNY Mellon Euroland Bond Fund, der BNY Mellon European Credit Fund, der BNY Mellon Global Bond Fund, der BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund, der BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund, der BNY Mellon Global High Yield Bond Fund, der BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund, der BNY Mellon Global Leaders Fund, der BNY Mellon Global Opportunities Fund, der BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), der BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), der BNY Mellon Global Real Return Fund (USD), der BNY Mellon Global Unconstrained Fund, der BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund, der BNY Mellon Small Cap Euroland Fund, der BNY Mellon Targeted Return Bond Fund und der BNY Mellon U.S. Equity Income Fund als Artikel-6-Teilfonds eingestuft. Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Der BNY Mellon Absolute Return Equity Fund und der BNY Mellon Future Life Fund, beides Artikel-6-Teilfonds, der BNY Mellon Food Innovation Fund, ein Artikel-8-Teilfonds, und der BNY Mellon Future Earth Fund und der BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund, beides Artikel-9-Teilfonds, wurden im Geschäftsjahr geschlossen.

* Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Absolute Return Credit Fund

Unternehmenskennung: 213800PDI8OGLAK3FZ66

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeichnis von **ökologisch nach-haltigen Wirt-schafts-tätig-keiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen wirt-schaftstätigkeiten.. Nach-haltige Investi-tionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 12,00 % an nachhaltigen Investitionen. ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 11. Dezember 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt:

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete. Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus den Bereichen Tabak, Rüstung, Glücksspiel, Kohleförderung und der Herstellung umstrittener Waffen bezogen. Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.

Außerdem investierte der Teilfonds in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR (wie vom Anlageverwalter festgelegt) („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind und die nach Auffassung des Anlageverwalters positiv zum Erreichen der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN

SDGs“) beitragen. Der Teilfonds hatte zum 31. Dezember 2023 12 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft werden.

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie,
- Industrie, Innovation und Infrastruktur,
- Nachhaltige Städte und Gemeinden,
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion,
- Klimaschutzmaßnahmen,
- Leben unter Wasser,
- Leben an Land

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass dieser Teilfonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewirbt und nachhaltige Investition nicht zu seinen Anlagezielen gehören. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung - – sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 12 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des Mindestanteils).
- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:

(a) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 20 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen;

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

(b) im Falle eines jeden solchen Use-of-Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen.

- Ausschlusspolitik: Der Teilfonds hat seine Ausschlusspolitik wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds zu erfüllen.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, die der Teilfonds teilweise tätigte, bestand in positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu Umweltzielen oder sozialen Zielen bei durch Investitionen in:

Use-of-Proceeds Impact Bonds: Die Erlöse wurden verwendet, um Projekte mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen zu finanzieren oder zu refinanzieren, wobei die UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele herangezogen wurden. Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Von Impact Issuers emittierte Schuldtitel: Mindestens 20 % der Umsatzströme dieser Investitionen standen anhand der UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele in Zusammenhang mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen. Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Gesundheit und Wohlergehen
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten
- Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investitionen nicht ausdrücklich berücksichtigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzten.

● *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen und ausschließlich im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das vom Teilfonds gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

– Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Soweit möglich hat der Teilfonds die folgenden PAIs aus Tabelle 1 im Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission berücksichtigt:

1. Treibhausgasemissionen („THG-Emissionen“): Scope 1, 2 und 3
2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken

8. Emissionen in Wasser
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden.

– Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an diesen Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 11. Dezember 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
GERMAN 0% 01/17/24	STAATSANLEIHEN	9,95 %	GER
GERMAN 0% 02/21/24	STAATSANLEIHEN	9,91 %	GER
GERMAN 0% 03/20/24	STAATSANLEIHEN	9,89 %	GER
US TSY 0% 05/02/24	STAATSANLEIHEN	9,72 %	USA
BNY MEL G SH DUR HYB-U X	AKTIEN	4,83 %	IRE
US TSY 0% 04/02/24	STAATSANLEIHEN	4,83 %	USA
Pfizer In 5.3% 05/19/53	PHARMAUNTERNEHMEN	1,56 %	USA
Athora Ne VAR 07/15/31	VERSICHERUNGEN	1,55 %	NET
UBS Group VAR 04/02/32	BANKEN	1,54 %	SWI
JPMorgan VAR 06/01/34	BANKEN	1,49 %	USA
EUROPE 2.75% 02/04/33	STAATSANLEIHEN	1,48 %	BEL
Kreditans 1.75% 09/14/29	BANKEN	1,47 %	GER
Bank of C VAR 07/25/28	BANKEN	1,42 %	CYP
Cellnex T 1.75% 10/23/30	MASCHINENBAU & BAUGEWERBE	1,4 %	SPA
Ryder Sys 6.6% 12/01/33	TRANSPORT	1,36 %	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

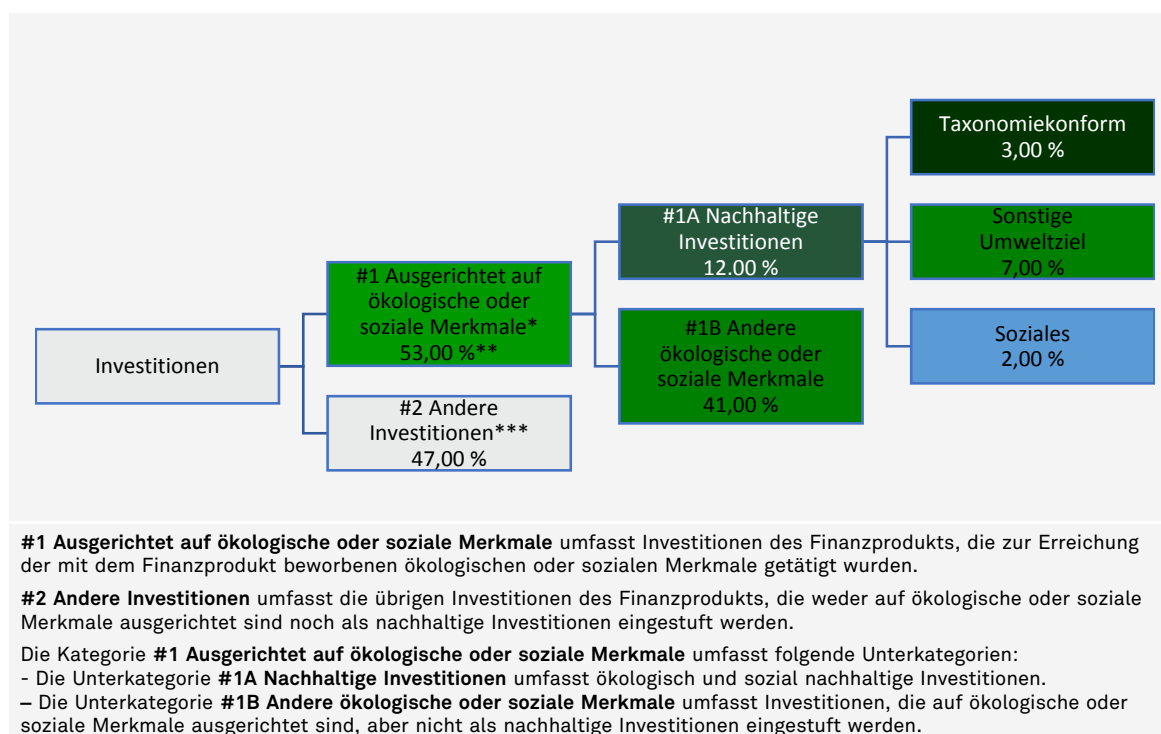
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale durch einen ausschließenden Ansatz und Allokationen zu bestimmten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sowie eine Anlage in einen OGA tätigte.

Die Angaben in #1 stellen eine Kombination aus beiden Ansätzen dar. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1A angegeben. Der nachstehende Zahlenwert unter #1B stellt den Portfolioanteil dar, den der Anlageverwalter nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet, jedoch bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der nachstehende Zahlenwert unter #1B stellt ebenfalls einen Portfolioanteil dar, der in einer Anlage in einem OGA gehalten wird, der nach Ansicht des Anlageverwalters mit den vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen übereinstimmt.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie in der nachstehenden Grafik angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



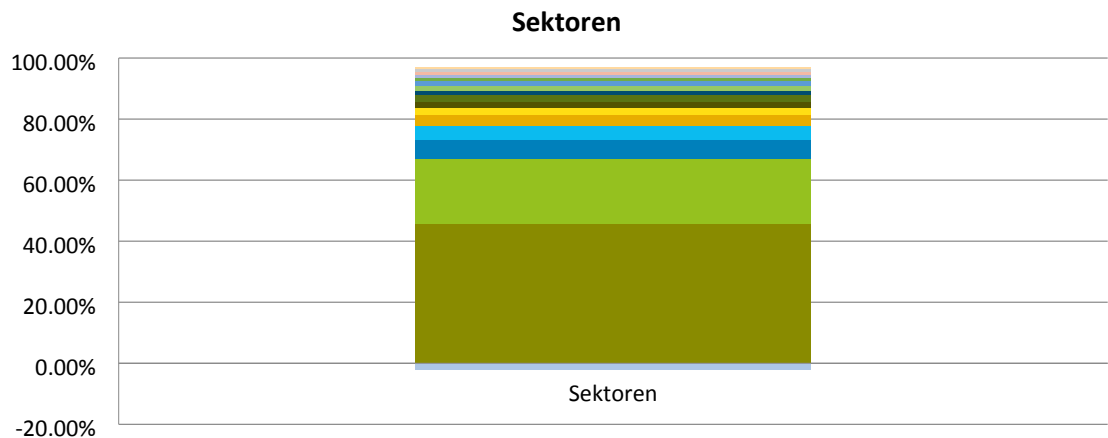
* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Investitionen zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass zu diesen Investitionen nur begrenzte Daten vorlagen. Daher war die Datenabdeckung für manche Investitionen des Teilfonds (etwa zum CO₂-Fußabdruck) sehr gering und in Ermangelung relevanter Daten ging der Anlageverwalter davon aus, dass solche Investitionen auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

** Der prozentuale Zahlenwert unter #1, die auf die Umwelt- und/oder Sozialmerkmale ausgerichtet ist, umfasst Anlagen, die 49 % des NIW in direkten Beteiligungen und 4 % des NIW in einer indirekten Beteiligung ausmachen. Die indirekte Beteiligung bezieht sich auf die Anlage des Teilfonds in einem OGA. Obwohl diese OGA-Beteiligung nach Ansicht des Anlageverwalters auf die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet war, wendete der OGA (i) die vom Teilfonds angewandten Ausschlusskriterien (wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie des Teilfonds im Nachtrag beschrieben) nicht vollständig an und (ii) war nicht auf die gesamten der vom Teilfonds berücksichtigten PAls ausgerichtet.

*** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds, wie unten dargestellt, hauptsächlich im Bankensektor und bei Staatsanleihen engagiert.



■ STAATSANLEIHEN	■ BANKEN	■ ELEKTRIK
■ AKTIEN	■ VERSICHERUNGEN	■ GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN
■ TRANSPORT	■ WASSER	■ SONSTIGE HERSTELLUNG
■ PHARMAUNTERNEHMEN	■ MASCHINENBAU & BAUGEWERBE	■ GESUNDHEIT – PRODUKTE
■ MULTINATIONAL	■ DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	■ IMMOBILIEN
■ BEKLEIDUNG	■ UNDEFINIERT	

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Aus den Allokationen des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR sind jedoch 35 % der nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die mit der Taxonomie konformen Investitionen trugen zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonemiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls

im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: – **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln – **Investitions-ausgaben**(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

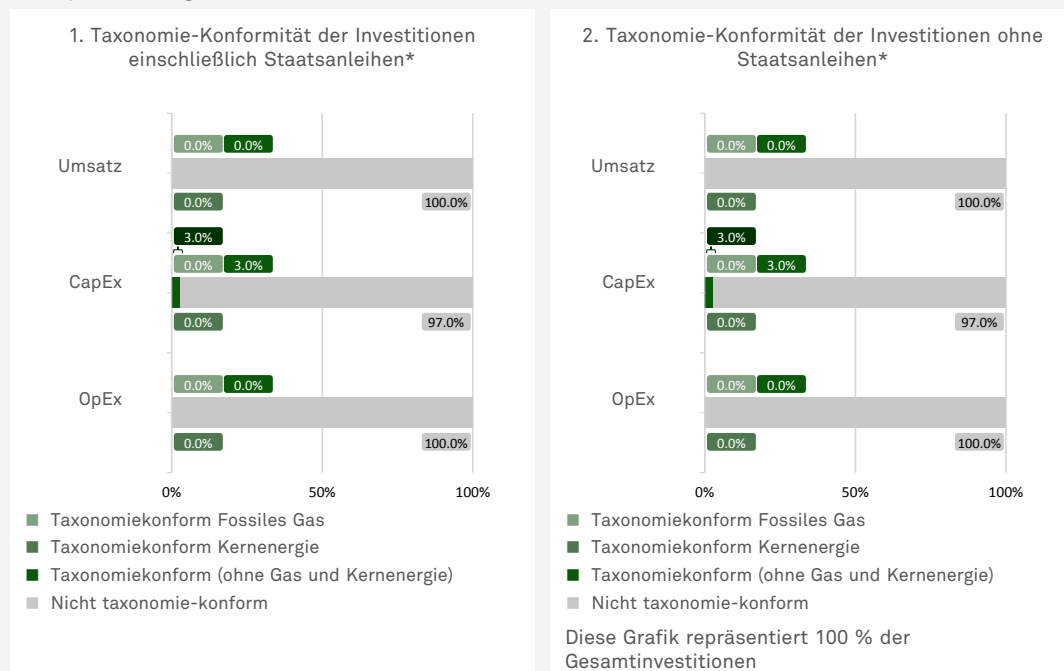
– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

65 % der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2023 2 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die spezifisch zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

– Der Anlageverwalter:

(a) Investierte in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ (wie vom Anlageverwalter festgelegt) erachtet wurden.

(b) Setzte eine Ausschlusspolitik ein wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben.

Diese verbindlichen Elemente des Teilfonds wurden in die Handelssysteme einprogrammiert und herangezogen, um die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale im Bezugszeitraum zu überwachen.

– Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.

Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung der beworbenen Merkmale verwendet werden, erfolgte durch die Responsible Investment Group. Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen werden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Kriterien sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.

– Im Bezugszeitraum war eine Mitwirkung bei den Emittenten, in die der Teilfonds investiert, weder erforderlich, noch wurde sie unternommen, weil es nicht zu Verstößen gegen verbindliche Elemente gekommen war, die im Nachtrag für den Teilfonds aufgeführt sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

Unternehmenskennung: 213800550EJYI8WPBT81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 80,38 % an nachhaltigen Investitionen. ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

- Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.
- Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.
- Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.
- Anlagen in Unternehmen, die von einer gesteigerten Effizienz und Transparenz des Geschäftsbetriebs profitieren, was sich auf die Ressourcennutzung und den ökologischen Fußabdruck von Unternehmen auswirkt. Dabei handelt es sich z. B. um Unternehmen, die u. a. Finanzdienstleistungen für unterversorgte Bevölkerungsgruppen anbieten und Unternehmen, die die Sicherheit von Privateigentum und die digitale Sicherheit sowie den Zugang zu und die Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit verbessern.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Nachhaltiger Handel
- Reduzierung der CO₂-Emissionen
- Abfallverminderung
- Förderung der Erzeugung und des Verbrauchs erneuerbarer Energien durch Gewährleistung der Rückverfolgbarkeit
- Nachhaltige Beschaffung

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Zugang zu mehr digitaler Sicherheit und mehr Zugang zu und Effizienz von digitalen Diensten
- Zugang zu Finanzierung
- Computer- und Netzsicherheit
- Datenschutz

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

- 1) Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:
 - in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
 - eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
 - keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

- 2) 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.
- 3) Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.
- 4) Innovation in der Lieferkette, wie durch qualitative Fallstudien belegt.
- 5) Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.

1. Block, Inc. Klasse A: 6,19 % des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Nachhaltigkeitsindikator: Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.

Thematische Begründung für Nachhaltigkeit: Block strebt einen breiteren Zugang zu Finanzdienstleistung zu geringeren Kosten durch Einsatz der Blockchain-Technologie an. Seine TBD-Sparte arbeitet an der Dezentralisierung des Finanzwesens, angefangen bei der Erstellung einer sicheren digitalen Wallet und der Steigerung der Geschwindigkeit, Funktionalität und Verfügbarkeit kostenloser Zahlungen durch Nutzung des Bitcoin Lightning Network. Das Lightning Network ist eine energieeffiziente Layer-2-Skalierungslösung, die sofortige und kosteneffektive BTC-Transaktionen ermöglicht. TBD plant das Angebot zusätzlicher, über Zahlungen hinausgehende Defi-Dienste, um von Banken unterversorgten Bevölkerungsgruppen mehr Zugang zu Finanzdienstleistungen zu verschaffen.

2. Universal Music Group N.V.: 5,27 % des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Nachhaltigkeitsindikator: Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.

Thematische Begründung für Nachhaltigkeit: UMG's Verwendung von nicht-fungiblen Token (NFTs) bietet einen besseren Zugang zu den sozialen Vorteilen von Musik und trägt zur Reduzierung von Abfall bei, indem digitale und nicht physische Sammlerstücke angeboten werden.

3. WisdomTree, Inc: 5,11 % des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Nachhaltigkeitsindikator: Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.

Thematische Begründung für Nachhaltigkeit:

Wisdomtree, ein führender ETF-Manager, investiert Vermögenswerte in digitale Vehikel in der Form von Token, um die Liquidität zu erhöhen und die Kosten für die Anleger zu senken. Das Unternehmen hat kürzlich Wisdomtree Prime an den Markt gebracht. Dabei handelt es sich um eine digitale Brieftasche für Verbraucher, die den Echtzeithandel, die Liquidität und das Management der tokenisierten Fondsangebote erleichtert. Wisdomtree hat mit Securrency zusammengearbeitet, um eine Technologie zu entwickeln, mit der sichergestellt wird, dass digitale Transaktionen auf öffentlichen Blockchains den Vorschriften zur Bekämpfung der Geldwäsche (AML) und den KYC-Vorschriften (Know-Your-Customer) für Marktteilnehmer entsprechen.

4. NVIDIA Corp: 4,92 % des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Nachhaltigkeitsindikator: Innovation in der Lieferkette, wie durch qualitative Fallstudien belegt.

Thematische Begründung für Nachhaltigkeit: NVDA ist ein Hardware-Enabler für die Blockchain-Technologie. Sie benötigt Rechenleistung für aktuelle Anwendungen sowie für zukünftige Blockchain-Anwendungen für das Web 3.0 und das Metaverse. Aus ökologischer und sozialer Sicht reduzieren die von NVDA demonstrierten Verbesserungen der GPU-Energieeffizienz für Rechenzentren und Gaming-/Omniverse-Endmärkte die Stromkosten, verbessern die Chipgeschwindigkeiten und sparen Platz.

5. Microsoft Corp.: 4,83 % des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Nachhaltigkeitsindikator: Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.

Thematische Begründung für Nachhaltigkeit: Microsoft bietet eine Palette an Blockchain-Architekturen, die sich auf Finanzdienstleistungen und vertikale Lieferketten konzentrieren. Microsoft hat kürzlich die Beteiligung am Canton Network bekannt gegeben. Dies ist ein Blockchain-Netzwerk, das den Bedarf an strengen Sicherheits-, Rechts- und Regulierungskontrollen erfüllt, die für die Tokenisierung, den Handel und die Abwicklung von Vermögenswerten auf den Finanzmärkten erforderlich sind. Im Bereich der Lieferkette bietet das Unternehmen die Digitalisierung, Rückverfolgbarkeit, Sichtbarkeit, Nachvollziehbarkeit und eine überprüfbare Aufzeichnung des Transfers von Produkten und Dienstleistungen für Unternehmen, um so Abfall zu reduzieren und die betriebliche Effizienz zu verbessern.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 100 % des Teilfonds. Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 100 % des Teilfonds.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Schwach – auf einer gewichteten Durchschnittsbasis wurde der Teilfonds von einem Drittanbieter von Daten als mit einem geringen Maß an nicht gemanagten ESG-Risiken behaftet eingestuft.
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	Qualitative Fallstudien für die 5 Top-Positionen im Fonds (nach Gewichtung) sind beigefügt (siehe oben)
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 5	Qualitative Fallstudien für die 5 Top-Positionen im Fonds (nach Gewichtung) sind beigefügt (siehe oben)

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeit- raum	Nachhaltigkeits- indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits- indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits- indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits- indikator Nr. 4	Nachhaltigkeits- indikator Nr. 5
31. Dezember 2022 bis 31. Dezember 2023	0 %	0 %	Schwach	Qualitative Fall- studien für die 5 Top-Positionen	Qualitative Fall- studien für die 5 Top-Positionen
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0 %	Schwach	Qualitative Fall- studien für die 5 Top-Positionen	Qualitative Fall- studien für die 5 Top-Positionen

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele der teilweise von dem Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sind vorstehend angeben.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen folgendermaßen zu den vorstehenden sozialen Zielen bei:

- Breiterer Zugang zu Finanzdienstleistungen zu geringeren Kosten durch Einsatz der Blockchain-Technologie
- Gesteigerte Zahlungsgeschwindigkeit und -sicherheit zu niedrigeren Kosten
- Einsatz der Blockchain, um Versicherungen schneller und sicherer abzuschließen
- Bewältigung maßgeblicher Risiken auf den Märkten für digitale Vermögenswerte – aufsichtsrechtliche Compliance und Sicherheit. Sichere Verwaltung privater Keys für Plattformen für digitale Vermögenswerte auf skalierbare Weise, wodurch ein Beitrag zum Datenschutz geleistet wird.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu Umweltzielen bei, die auf folgende Weise nicht mit der EU-Taxonomie konform sind:

- Umsetzung von Blockchain-Lösungen, die die Effizienz, Rückverfolgbarkeit und Nachhaltigkeit von Lieferketten verbessern
- Bereitstellung von Rückverfolgbarkeit für die Erzeugung und den Verbrauch von erneuerbarer Energie
- Bereitstellung von verteilten Solarstromanlagen unter Einsatz der Blockchain-Technologie, mit Lösungen, die zu einer intelligenteren, effizienteren, sichereren und zuverlässigen Erzeugung, Verwendung und Speicherung von Energie beitragen.
- Entwicklung Blockchain-gestützter Lösungen für Unternehmen zur Förderung der Effizienz/ Nachhaltigkeit von Lieferketten und zur Nachverfolgung, Messung und Reduzierung von CO₂-Fußabdruck/-Emissionen.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen

Bei den wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-

faktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Hauptinvestitionen (nach Gewichtung)	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SAP SE EUR NPV	SOFTWARE	5,21 %	GER
NVIDIA CORP USD 0.001	HALBLEITER	5,18 %	USA
WisdomTree Inc USD 0.01	DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	4,94 %	USA
UNIVERSAL MUSIC GR EUR 10	UNTERHALTUNG	4,92 %	NET
MICROSOFT USD 0.00000625	SOFTWARE	4,86 %	USA
ACCENTURE P USD 0.0000225	COMPUTER	4,33 %	USA
BLOCK INC USD 0.0000001	GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	4,08 %	USA
MERCEDES-BENZ GRO EUR NPV	AUTOHERSTELLER	3,92 %	GER
SIEMENS AG-SP USD NPV ADR	SONSTIGE HERSTELLUNG	3,59 %	USA
MASTERCARD INC USD 0.0001	DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	3,42 %	USA
SBI HOLDINGS INC JPY NPV	DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	3,31 %	JAP
KERING EUR 4	BEKLEIDUNG	3,3 %	FRC
LVMH MOET HENNESSY EUR 0.3	BEKLEIDUNG	3,29 %	FRC

Hauptinvestitionen (nach Gewichtung)	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
GXO LOGISTICS IN USD 0.01	GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	3,1 %	USA
JPMORGAN CHASE & CO USD 1	BANKEN	3,02 %	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 98,44 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 80,38 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Davon hatten 31,65 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 48,34 % ein soziales Ziel. 0,38 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale: 98,44 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 80,38 % des Nettoinventarwerts

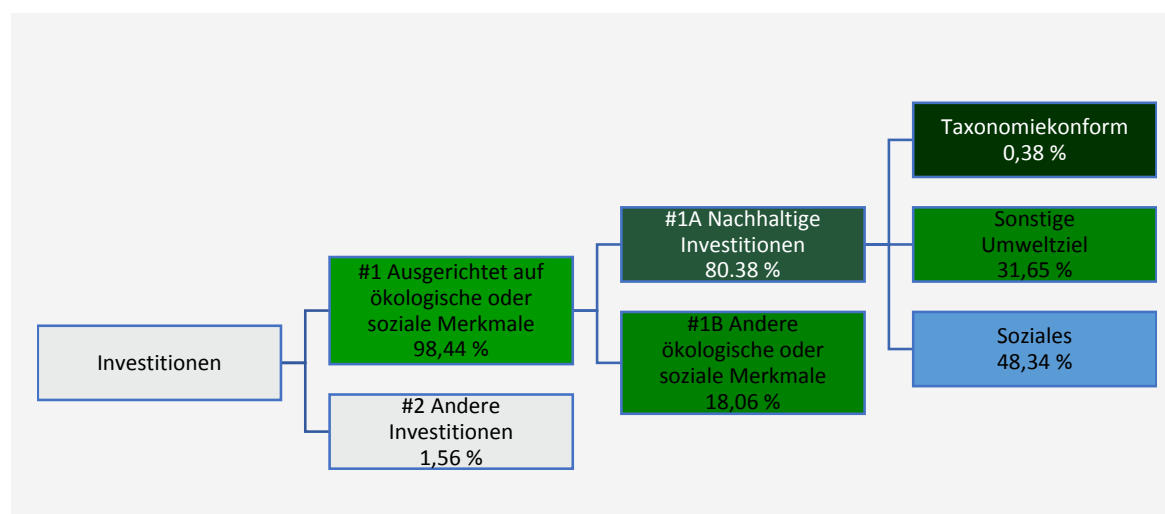
– Taxonomiekonform: 0,38 % des Nettoinventarwerts

– Umwelt: 31,65 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 48,34 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 18,06 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 1,56 % des Nettoinventarwerts



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

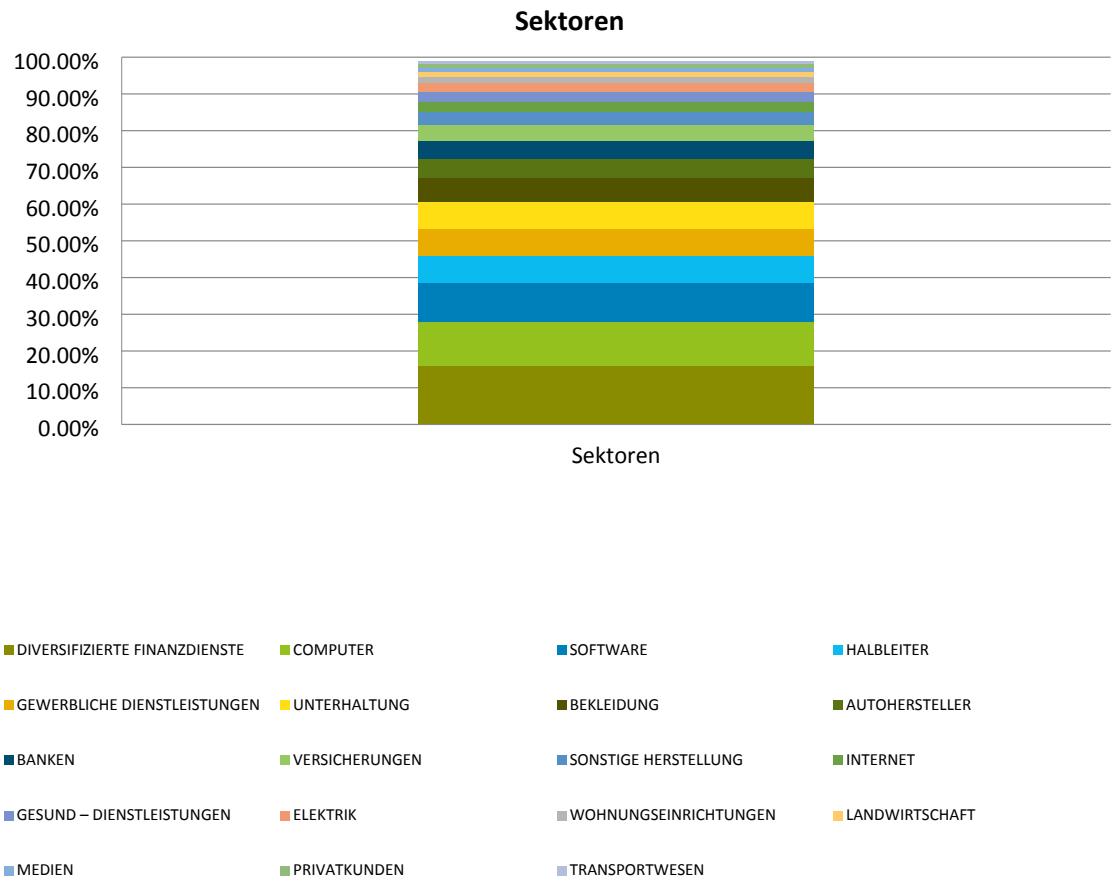
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

– Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,38 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

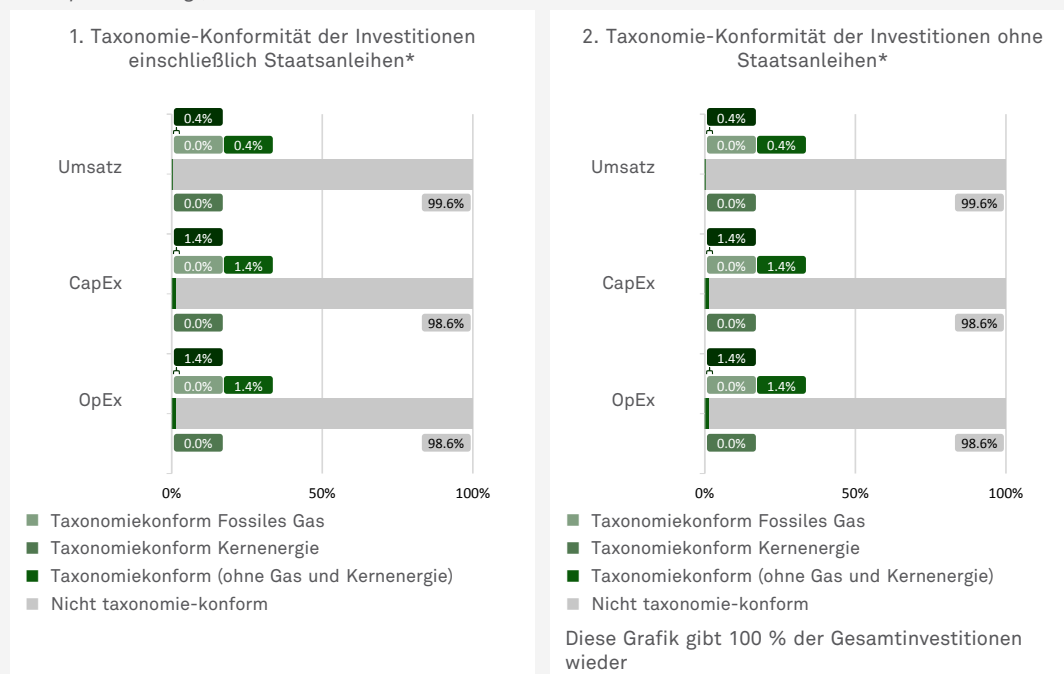
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissi-

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozensatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, stieg im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen an. Dies war auf die bessere Verfügbarkeit von Daten zurückzuführen, die von den Unternehmen gemeldet wurden, im Gegensatz zu der Verwendung geschätzter Daten externer Datenanbieter.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

onswerte aufweisen,
die den besten
Leistungen
entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 31,65 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



sind nachhaltige
Investitionen mit einem
Umweltziel, die die
Kriterien für ökologisch
nachhaltige Wirt-
schaftstätigkeiten
gemäß der Verordnung
(EU) 2020/852 nicht
berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 48,34 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 1,56 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

1,56 % in ausschließlich zu Liquiditätszwecken gehaltene Barmittel. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 10 % in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen. Wie nachstehend näher beschrieben, veräußerte der Anlageverwalter eine Position in einem Unternehmen, weil er feststellte, dass dieses nicht mehr seinen ESG- und Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

– Mindestens 80 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds waren in Digital-Assets-Unternehmen investiert. Digital-Assets-Unternehmen sind Unternehmen, die voraussichtlich von den sich ergebenden oder laufenden Umsatz- und/oder Kosteneinsparungsmöglichkeiten profitieren werden, die die Blockchain-Technologie (auch bekannt unter dem Begriff Distributed-Ledger-Technologie) bietet, oder Unternehmen, die Blockchain-Technologien unterstützen. Die Blockchain-Technologie bezeichnet integrierte Software und Hardware, durch die Unternehmen in die Lage versetzt werden, digitale Transaktionsdaten in einem Standardformat unabhängig zu pflegen und auszutauschen.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Efficient US Fallen Angels Beta Fund

Unternehmenskennung: 213800YL6BXGT6FIQ433

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ mit einem sozialen Ziel
	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete.

Zu den von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Best Practices gehörten die Verringerung der Nutzung von Teersanden und Kraftwerkskohle, die Verringerung der Herstellung umstrittener Waffen und die Reduzierung von CO₂-Emissionen.

Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten, vom Anlageverwalter festgelegten Prozentsatz ihres Umsatzes aus dem Bereich Teersande oder dem Abbau von Kraftwerkskohle bezogen. Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.

Der Teilfonds investierte nicht in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR.

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der folgende Nachhaltigkeitsindikator wird verwendet, um zu messen, ob der Teilfonds die von ihm geförderten ökologischen und/oder sozialen Merkmale bewirbt:

Ausschlusspolitik: Eine Bewertung, ob der Teilfonds erfolgreich und beständig seine Ausschlusspolitik ausführte, die darin bestand, nicht in Wertpapiere zu investieren, die von Unternehmen ausgegeben wurden, auf die einer der folgenden Punkte zutraf:

Der Nachhaltigkeitsindikator hat folgendermaßen abgeschnitten:

Die Ausschlusspolitik wurde eingehalten, weil der Teilfonds nicht in Wertpapiere investierte, die von Unternehmen ausgegeben wurden:

- die mehr als 30 % ihres Umsatzes mit Teersanden oder Kraftwerkskohle erzielten,
- umstrittene Waffen herstellten,
- die gemäß der Daten Dritter unter ein vorgegebenes Umweltrating fielen, wenn dieses Umweltrating vom Anlageverwalter als relevant angesehen wurde, oder die gemäß der Daten Dritter unter ein vorgegebenes Rating bei Schlüsselfragen zu Themen des Klimawandels fielen,
- die vom Anlageverwalter als in schwerwiegende Kontroversen im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung verwickelt erachtet wurden (einschließlich erheblicher Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze),
- die von externen Datenanbietern in Bezug auf ein wichtiges Umweltkriterium mit einer „Red Flag“ (oder einer gleichwertigen Kennzeichnung) gekennzeichnet worden sind;

Zum 31. Dezember 2023 waren die Investitionen des Teilfonds zu 99,9 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 0,1 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Berichtszeitraum	Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (UN SDGs)	Ausschlusspolitik
1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022	waren die Investitionen des Teilfonds zu 99 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 1 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.	Der Fonds hat seine Ausschlusspolitik wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Fonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.
1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023	waren die Investitionen des Teilfonds zu 99,9 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 0,1 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.	Der Fonds hat seine Ausschlusspolitik wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Fonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend. In Übereinstimmung mit den vorvertraglichen Informationen gemäß SFDR tätigte der Teilfonds im Bezugszeitraum keine Investitionen, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht zutreffend.

- *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Nicht zutreffend.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Bezugszeitraum nicht.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Western Digital Corp 4.75% 15feb2026 (callable 15nov25)	Technologie	5,65 %	USA
Vodafone Group Plc 7% 04apr2079 (callable 04jan29)	Telekommunikation	3,76 %	GBR
Sprint Capital Corp 6.875% 15nov2028	Telekommunikation	2,44 %	USA
Rogers Communications Inc 5.25% 15mar2082 (callable 15mar27) 144a	Telekommunikation	2,07 %	CAN
Intesa Sanpaolo Spa 5.017% 26jun2024 144a	Banks	1,73 %	ITA
Sprint Capital Corp 8.75% 15mar2032	Telekommunikation	1,63 %	USA
Las Vegas Sands Corp 3.5% 18aug2026 (callable 18jun26)	Konsumgüter und Dienstleistungen	1,58 %	USA
Unicredit Spa 7.296% 02apr2034 (callable 02apr29) 144a	Banken	1,52 %	ITA
United Rentals North Am 3.875% 15nov2027 (callable 10apr23)	Konsumgüter und Dienstleistungen	1,51 %	USA
Sands China Ltd 5.9% 08aug2028 (callable 08may28)	Konsumgüter und Dienstleistungen	1,38 %	MAC

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Office Ppty Income Trst 4.5% 01feb2025 (callable 01nov24)	Immobilien	1,35 %	USA
Las Vegas Sands Corp 3.2% 08aug2024 (callable 08jul24)	Konsumgüter und Dienstleistungen	1,35 %	USA
Sands China Ltd 5.625% 08aug2025 (callable 08jun25)	Konsumgüter und Dienstleistungen	1,34 %	MAC
Dresdner Fndg Trust I 8.151% 30jun2031 (callable 30jun29) 144a	Banken	1,23 %	USA
Perrigo Finance Unlimite 4.375% 15mar2026 (callable 15dec25)	Gesundheitswesen	1,17 %	USA

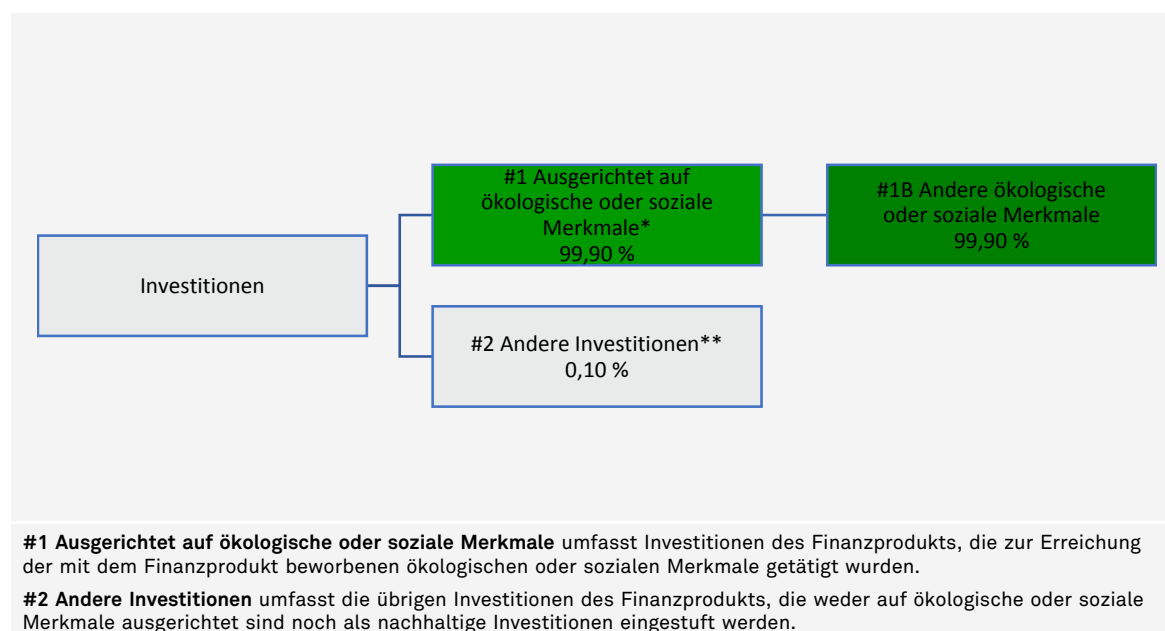


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale, indem er einen ausschließenden Ansatz verfolgte. Der nachstehende Zahlenwert unter #1 und #1B stellt den Portfolioanteil dar, der bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Die Prozentangaben in diesem Abschnitt, wie in der nachstehenden Grafik angegeben, entsprechen dem Stand vom 31. Dezember 2023 und daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

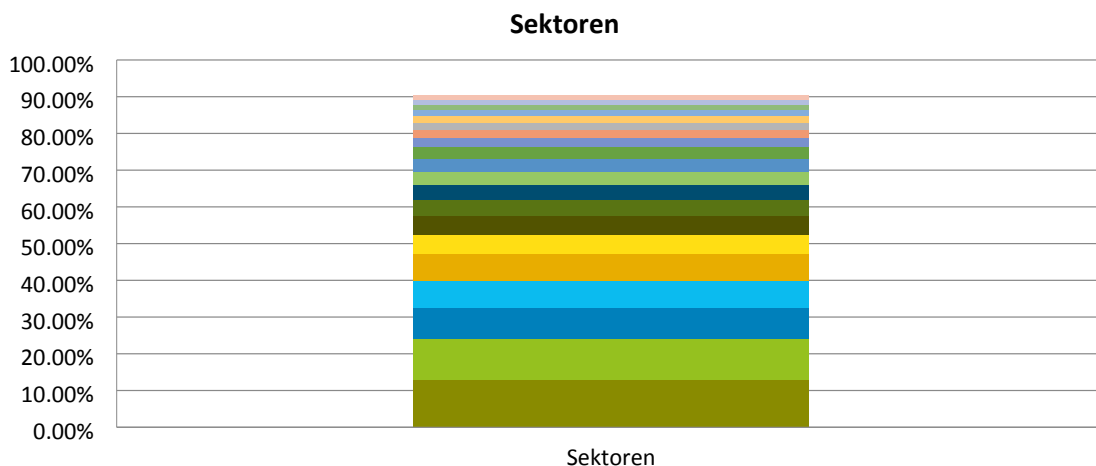


* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel und Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Telekommunikation, Einzelhandel sowie Pipelines und REITs engagiert, wie nachstehend dargestellt.



■ TELEKOMMUNIKATION	■ PRIVATKUNDEN	■ PIPELINES
■ REITS	■ BEHERBERGUNG	■ LUFT-UND RAUMFAHRT/VERTEIDIGUNG
■ BANKEN	■ ÖL UND GAS	■ COMPUTER
■ ELEKTRIK	■ PHARMAUNTERNEHMEN	■ AUTOHERSTELLER
■ FLUGGESELLSCHAFTEN	■ MEDIEN	■ VERSICHERUNGEN
■ HAUSHALTSGÜTER	■ GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	■ UNTERHALTUNG
■ VERPACKUNGEN UND BEHÄLTER	■ GESUND – DIENSTLEISTUNGEN	

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossilem Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

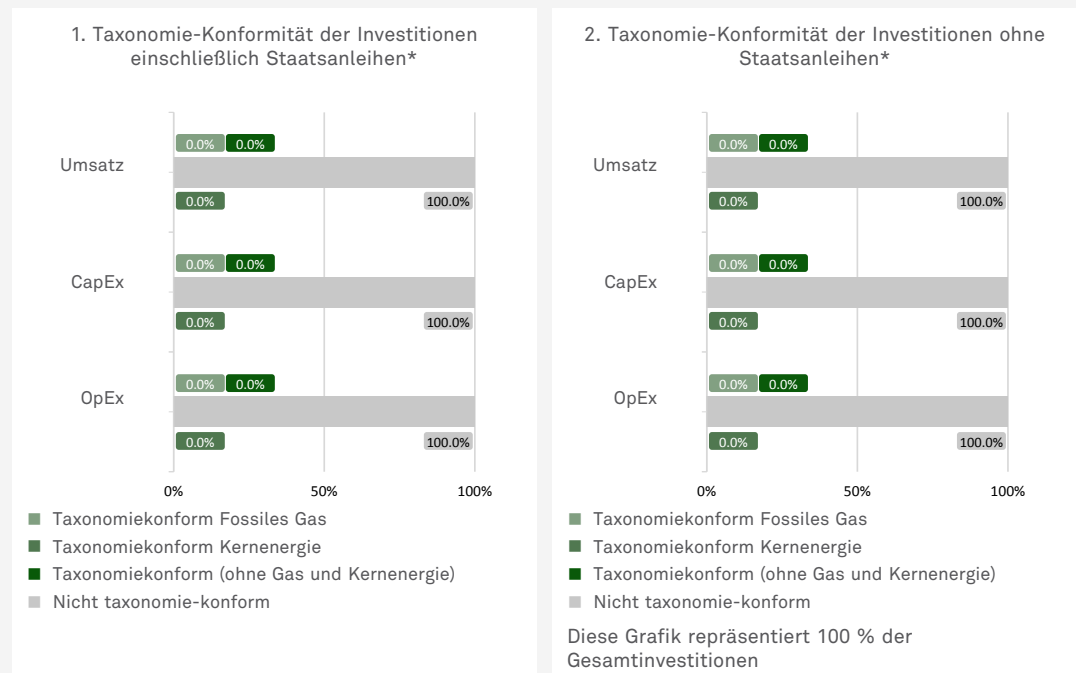
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Grafiken ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Der Anlageverwalter verwendete Ausschlusskriterien wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben.
- Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Ausschlusskriterien durch Ausschluss bestimmter Emittenten wie im Nachtrag (und vorstehend) angegeben erfüllt wurden. Dies wurde überwacht, indem die verbindlichen Elemente (Ausschlüsse) in die Handelssysteme einprogrammiert wurden.
- Der Anlageverwalter verwendete außerdem die folgenden internen Kontrollmechanismen, um zu überwachen, ob der Teilfonds die einprogrammierten verbindlichen Elemente im Bezugszeitraum beachtete:
 1. Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.
 2. Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.
 3. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen wurden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Elemente sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Emerging Markets
Corporate Debt Fund

Unternehmenskennung: 213800UJQ2JMWP13VU32

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nach-haltige Inves-ti-tion** ist eine Inves-ti-tion in eine Wirt-schaft-stätig-keit, die zur Erreichung eines Umwelt-ziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vor-aus-ge-setzt, dass diese Inves-ti-tion keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich be-ein-trächtigt und die Unter-nehmen, in die inves-tiert wird, Ver-fahrens-weisen einer guten Unter-nehmens-führung an-wen-den.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifi-kations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeich-nis von **ökologisch nach-haltigen Wirt-schafts-tätig-keiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Ver-zeich-nis der sozial nach-haltigen Wirt-schaftstätig-keiten. Nach-haltige Investi-tionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒	☐ Ja	☒ ☐	☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%			☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
			☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
			☐ mit einem sozialen Ziel
		☒	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 31. Mai 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete.

Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus der Gewinnung von Kraftwerksohle, Teersanden und der Herstellung umstrittener Waffen erzielten.

– Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.

Der Teilfonds investierte nicht in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanz-

produkt beworbenen
ökologischen oder
sozialen Merkmale
erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der folgende Nachhaltigkeitsindikator wird verwendet, um zu messen, ob der Teilfonds die von ihm geförderten ökologischen und/oder sozialen Merkmale bewirbt:

Ausschlusspolitik: Eine Bewertung, ob der Teilfonds erfolgreich und beständig seine Ausschlusspolitik ausführte, die darin bestand, nicht in Wertpapiere zu investieren, die von Unternehmen ausgegeben wurden, auf die einer der folgenden Punkte zutraf:

Der Nachhaltigkeitsindikator hat folgendermaßen abgeschnitten:

Die Ausschlusspolitik wurde eingehalten, weil der Teilfonds nicht in Wertpapiere investierte, die von Unternehmen ausgegeben wurden:

- die mehr als 30 % ihres Umsatzes mit Teersanden oder Kraftwerkskohle erzielten,
- umstrittene Waffen herstellten,
- die gemäß der Daten Dritter unter ein vorgegebenes Umweltrating fielen, wenn dieses Umweltrating vom Anlageverwalter als relevant angesehen wurde, oder die gemäß der Daten Dritter unter ein vorgegebenes Rating bei Schlüsselfragen zu Themen des Klimawandels fielen,
- die von externen Datenanbietern in Bezug auf ein wichtiges Umweltkriterium mit einer „Red Flag“ (oder einer gleichwertigen Kennzeichnung) gekennzeichnet worden sind – die von dritten Datenanbietern als gegen die Grundsätze des UN Global Compact (einschließlich der Prinzipien in Bezug auf Umwelt und Governance, zu denen auch diejenigen in Bezug auf Arbeit, Menschenrechte, Bestechung und Korruption gehören) verstoßend eingestuft wurden.

Zum 31. Dezember waren die Investitionen des Teilfonds zu 96 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 4 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend. In Übereinstimmung mit den vorvertraglichen Informationen gemäß SFDR tätigte der Teilfonds im Bezugszeitraum keine Investitionen, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Nicht zutreffend.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Bezugszeitraum nicht.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 31. Mai 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INSIGHT-USD LIQUIDITY FD-	AKTIEN	1,72 %	IRE
Woori Ban 4.75% 04/30/24	BANKEN	1,31 %	SOK
US TS 3.875% 05/15/43	STAATSANLEIHEN	1,23 %	USA
MEGlobal 5% 05/18/25	CHEMIKALIEN	1,21 %	KUW
PLDT INC 2.5% 01/23/31	TELEKOMMUNIKATION	1,19 %	PHI
GC Treasu 2.98% 03/18/31	CHEMIKALIEN	1,1 %	THI
First Abu VAR 04/04/34	BANKEN	1,08 %	UAE
HDFC Bank 5.686% 03/02/26	BANKEN	1,08 %	IND
Prosus NV 4.193% 01/19/32	INTERNET	1,08 %	CHN
Teva Phar 3.75% 05/09/27	PHARMAUNTERNEHMEN	1,06 %	ISR
UNITED OV VAR 04/15/29	BANKEN	1,06 %	SIN
Medco Map 8.96% 04/27/29	ÖL UND GAS	1,0 %	INO
Galaxy Pi 2.94% 09/30/40	PIPELINES	0,97 %	UAE
ORLEN SA 4.75% 07/13/30	ÖL UND GAS	0,97 %	POL
Standard VAR 09/23/31	BANKEN	0,96 %	UKK



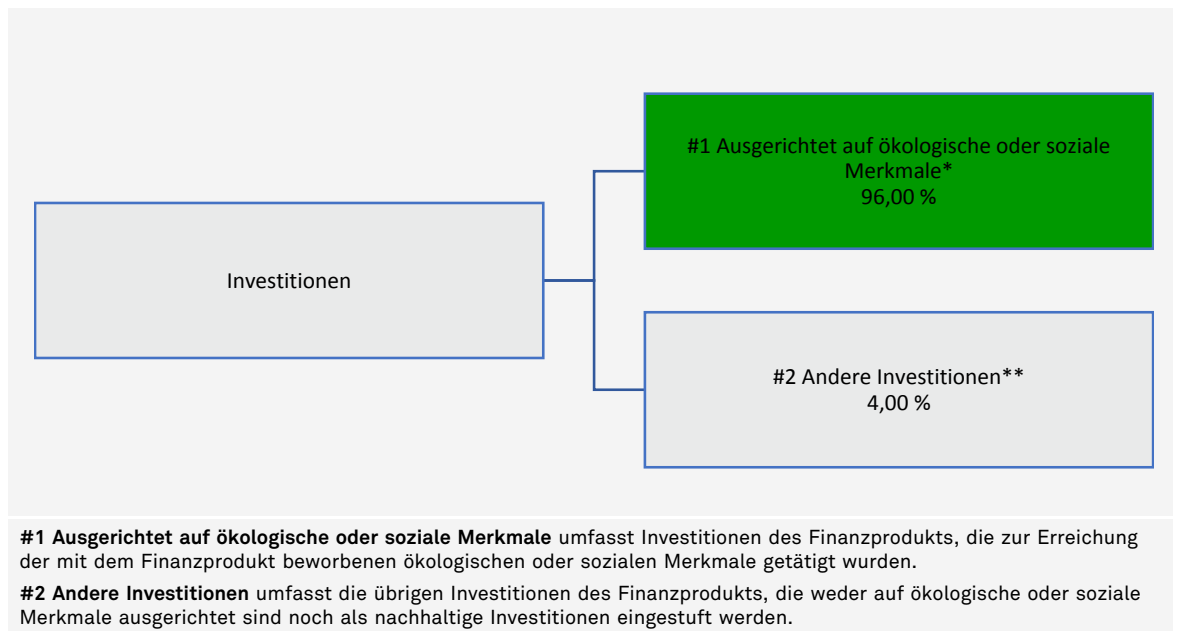
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale, indem er einen ausschließenden Ansatz verfolgte. Der nachstehende Zahlenwert unter #1 und #1B stellt den Portfolioanteil dar, der bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Die Prozentangaben in diesem Abschnitt, wie in nachstehendem Diagramm angegeben, entsprechen dem Stand vom 31. Dezember 2023 und daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

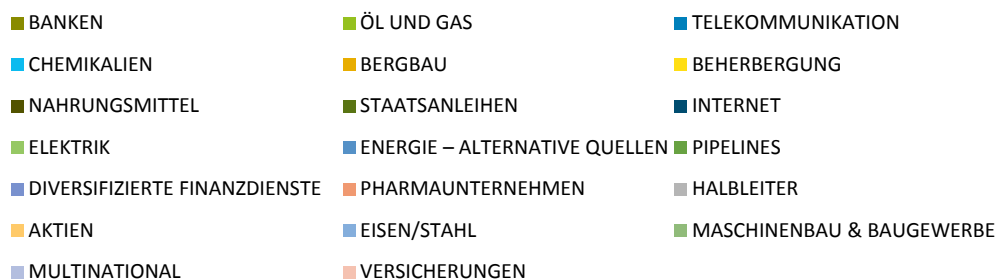
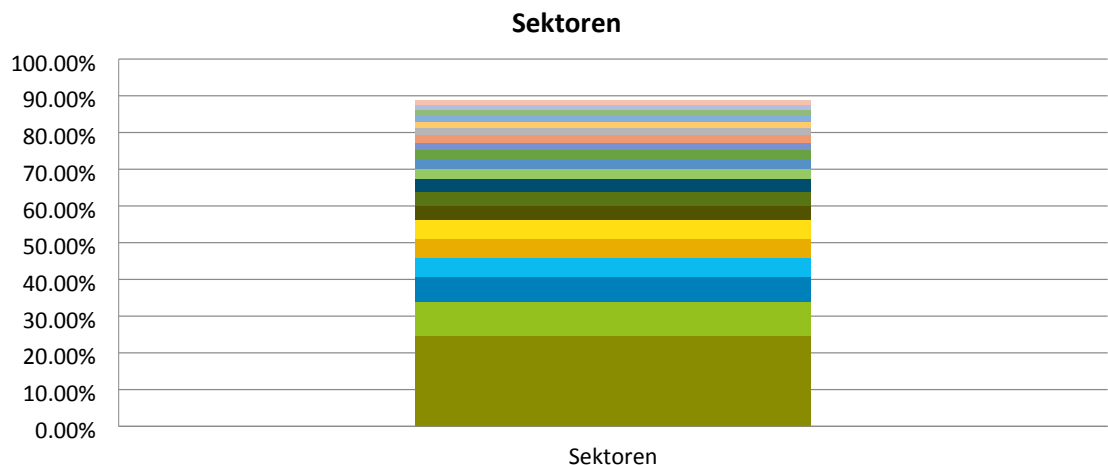


* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel und Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds überwiegend im Sektor Banken sowie in Öl und Gas engagiert, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

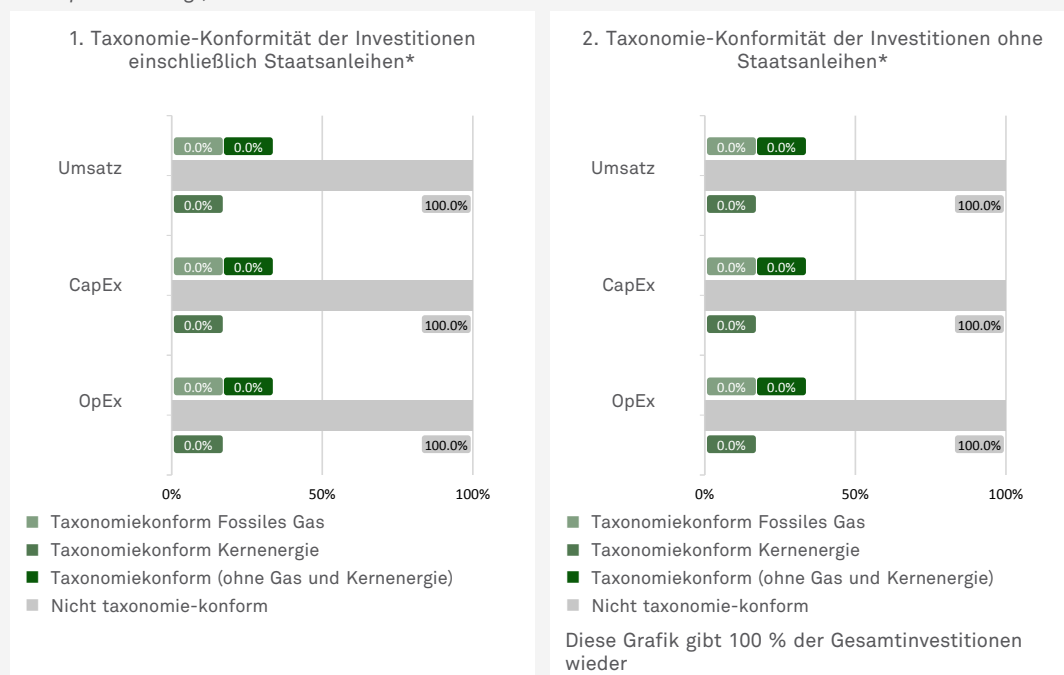
Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomeikon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Der Anlageverwalter verwendete Ausschlusskriterien wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben.
- Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Ausschlusskriterien durch Ausschluss bestimmter Emittenten wie im Nachtrag (und vorstehend) angegeben erfüllt wurden. Dies wurde überwacht, indem die verbindlichen Elemente (Ausschlüsse) in die Handelssysteme einprogrammiert wurden.
- Der Anlageverwalter verwendete außerdem die folgenden internen Kontrollmechanismen, um zu überwachen, ob der Teilfonds die einprogrammierten verbindlichen Elemente im Bezugszeitraum beachtete:
 1. Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.
 2. Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

3. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen wurden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Elemente sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Floating Rate Credit Fund

Unternehmenskennung: 213800XU3DU834Z4IR30

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vor-aus-gesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 13,00 % an nachhaltigen Investitionen. ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 26. Juni 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt:

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete. Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus den Bereichen Tabak, Rüstung, Glücksspiel, Kohleförderung und der Herstellung umstrittener Waffen bezogen. Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.
- Der Teilfonds fokussierte sich auf Emittenten mit höheren Werten in Bezug auf ihr ESG-Profil, indem er nicht in Wertpapiere investierte, die nach Maßgabe des Anlageverwalters das niedrigste ESG-Rating (einen Wert von 5) aufwiesen. So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 34 % des Nettoinventarwerts des Portfolios in Emittenten mit einem Rating von 1 und 2 investiert. Der verbleibende Teil war in Emittenten mit einem ESG-Rating von 3 oder 4 oder in Anlagen ohne ESG-Rating investiert (bei denen es sich um liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen einschließlich Barmittel sowie um Derivate (FDI) handelte, die eigens zu

Absicherungszwecken verwendet wurden). Angaben zum vermögensgewichteten Gesamt-ESG-Rating gegenüber dem Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index sind der nächsten Frage zu entnehmen;

- Der Teilfonds fokussierte sich auf Emittenten, deren Kohlenstoffintensität der Anlageverwalter nach seinem alleinigen Ermessen als niedriger erachtete. Einzelheiten zur vermögensgewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität gegenüber dem Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index sind der nächsten Frage zu entnehmen.

Außerdem investierte der Teilfonds in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR (wie vom Anlageverwalter festgelegt) („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind und die nach Auffassung des Anlageverwalters positiv zum Erreichen der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beitragen. Der Teilfonds hatte zum 31. Dezember 2023 13 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft werden.

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie,
- Industrie, Innovation und Infrastruktur,
- Nachhaltige Städte und Gemeinden,
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion,
- Klimaschutzmaßnahmen,
- Leben an Land

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass dieser Teilfonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewirbt und nachhaltige Investition nicht zu seinen Anlagezielen gehören. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten,
- Partnerschaften zur Erreichung des Ziels.

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

insgesamt 13 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des Mindestanteils).

- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:
- (a) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 20 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen;
 - (b) im Falle eines jeden solchen Use-of-Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen.
- Ausschlusspolitik: Der Teilfonds hat seine Ausschlusspolitik wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds zu erfüllen.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, die der Teilfonds teilweise tätigte, bestand in positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu Umweltzielen oder sozialen Zielen bei durch Investitionen in:

Use-of-Proceeds Impact Bonds: Die Erlöse wurden verwendet, um Projekte mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen zu finanzieren oder zu refinanzieren, wobei die UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele herangezogen wurden. Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Von Impact Issuers emittierte Schuldtitel: Mindestens 20 % der Umsatzströme dieser Investitionen standen anhand der UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele in Zusammenhang mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen. Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Gesundheit und Wohlergehen
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten
- Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investitionen nicht ausdrücklich berücksichtigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzten.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen und ausschließlich im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das vom Teilfonds gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.
- Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI-Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Soweit möglich hat der Teilfonds hat die folgenden PAIs aus Tabelle 1 im Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission berücksichtigt:

10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

– Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:

4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen

Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:

16. Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung.
- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden.
 - Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an diesen Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 26. Juni 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ILF-EUR LIQUIDITY-2	AKTIEN	6,74 %	IRE
Avantor F 3.875% 07/15/28	GESUNDHEIT – PRODUKTE	1,84 %	USA
BANIJAY ENTERTAI TL 03/28	BANKKREDITE	1,67 %	FRC
Electrici VAR 06/01/72	ELEKTRIK	1,65 %	FRC
WP/AP TELECOM HO TL 03/29	BANKKREDITE	1,65 %	NET
VILLA DUTCH BIDC TL 11/29	BANKKREDITE	1,64 %	EMU
WINDSOR HOLDINGS TL 06/30	BANKKREDITE	1,63 %	EMU
Villa Dutch B 11/03/29 TL	BANKKREDITE	1,61 %	BEL
Albion Finan 08/2026 TL	BANKKREDITE	1,61 %	LUX
PEARLS NETHERLAN TL 02/29	BANKKREDITE	1,6 %	NET
Pinnacle 10% 10/11/28	LEISURE TIME	1,52 %	UKK
Avis Budg 7.25% 07/31/30	GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	1,5 %	USA
ARCONIC CORP TL 07/27/30	BANKKREDITE	1,5 %	USA

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
InPost SA 2.25% 07/15/27	TRANSPORT	1,46 %	POL
Ytinrete FRN 07/12/28	COMPUTER	1,45 %	SWE



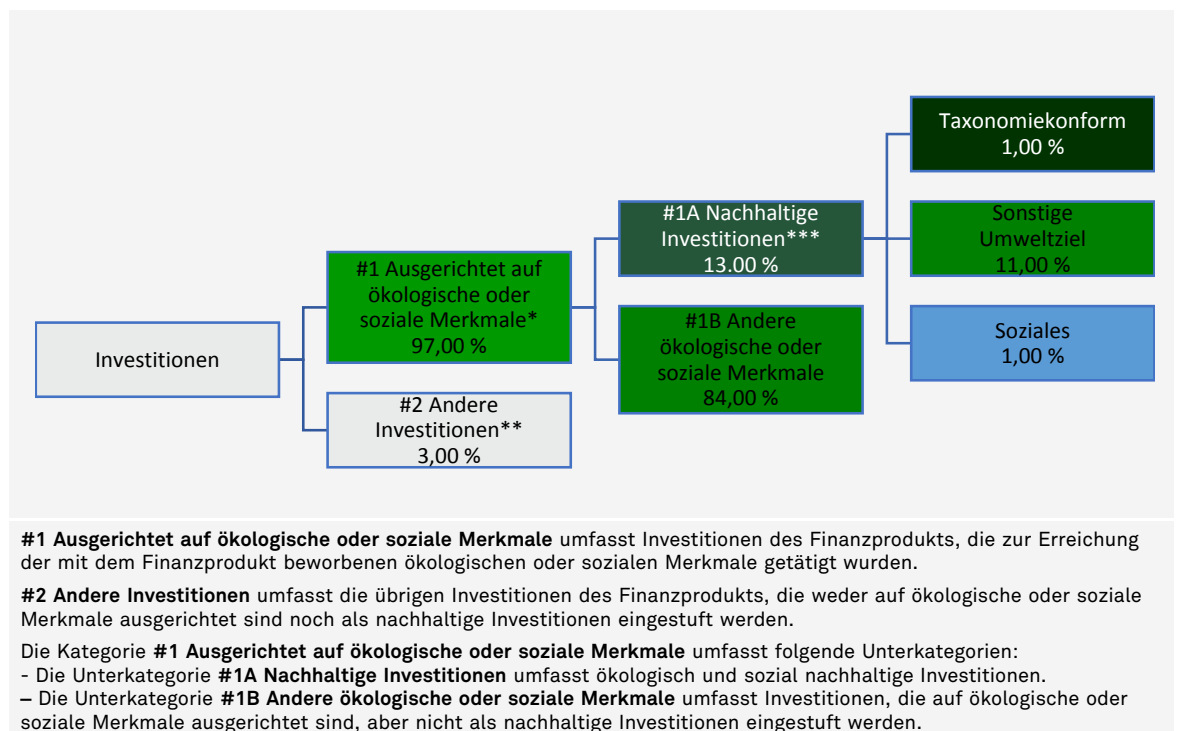
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale durch einen ausschließenden Ansatz und Allokationen in bestimmten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, Emittenten mit besseren Werten und Emittenten mit geringerer Kohlenstoffintensität.

Die Angaben in #1 stellen eine Kombination aus beiden Ansätzen dar. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1A angegeben. Der nachstehende Zahlenwert unter #1B stellt den Portfolioanteil dar, den der Anlageverwalter nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet, jedoch bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie im der nachstehenden Grafik angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



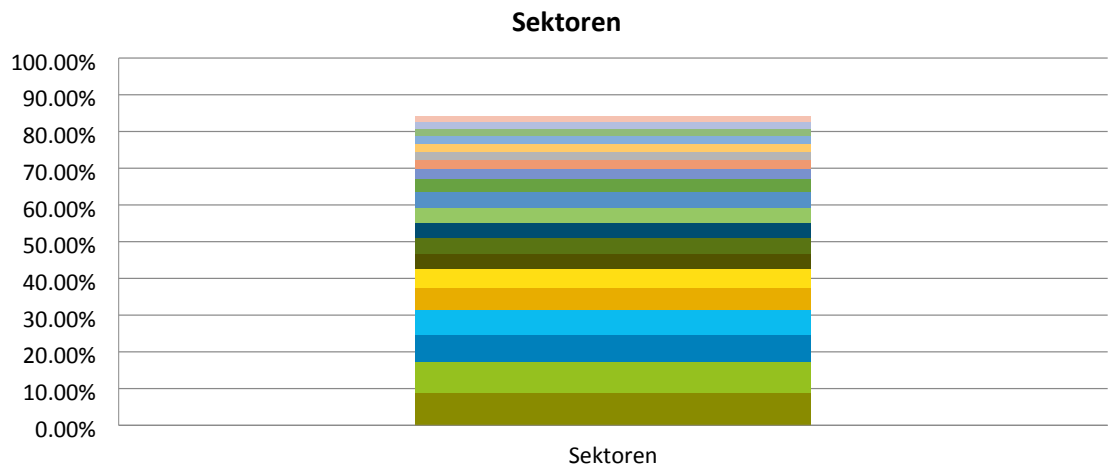
* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Investitionen zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass zu diesen Investitionen nur begrenzte Daten vorlagen. Daher war die Datenabdeckung für manche Investitionen des Teilfonds (etwa zum CO₂-Fußabdruck) sehr gering und in Ermangelung relevanter Daten ging der Anlageverwalter davon aus, dass solche Investitionen auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

*** Zum 31. Dezember 2023 trugen 4 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei. Nach Auffassung des Anlageverwalters schreibt die SFDR jedoch für jede nachhaltige Investition gemäß SFDR die Berücksichtigung eines einzelnen Umweltziels oder sozialen Ziels vor. Trug daher eine von dem Teilfonds gehaltene nachhaltige Investition gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei, wurde eine solche nachhaltige Investition gemäß SFDR in der vorstehenden Grafik unter „ökologisch“ aufgeführt.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds, wie unten dargestellt, hauptsächlich in den Bereichen gewerbliche Dienstleistungen, Banken sowie Verpackungen und Behälter engagiert.



■ GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	■ BANKKREDITE	■ VERPACKUNGEN UND BEHÄLTER
■ AKTIEN	■ TELEKOMMUNIKATION	■ ELEKTRIK
■ TRANSPORT	■ AUTOTEILE & AUSRÜSTUNG	■ MEDIEN
■ PRIVATKUNDEN	■ CHEMIKALIEN	■ PHARMAUNTERNEHMEN
■ MASCHINENBAU & BAUGEWERBE	■ MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	■ GESUNDHEIT – PRODUKTE
■ SONSTIGE ABS	■ SOFTWARE	■ VERSICHERUNGEN
■ INVESTMENTGESELLSCHAFTEN	■ LEISURE TIME	

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die Taxonomie-Verordnung der EU ausgerichtet sind. Aus den Allokationen des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR waren jedoch 11 % der nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die mit der Taxonomie konformen Investitionen trugen zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomeikonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls

im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitions-ausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

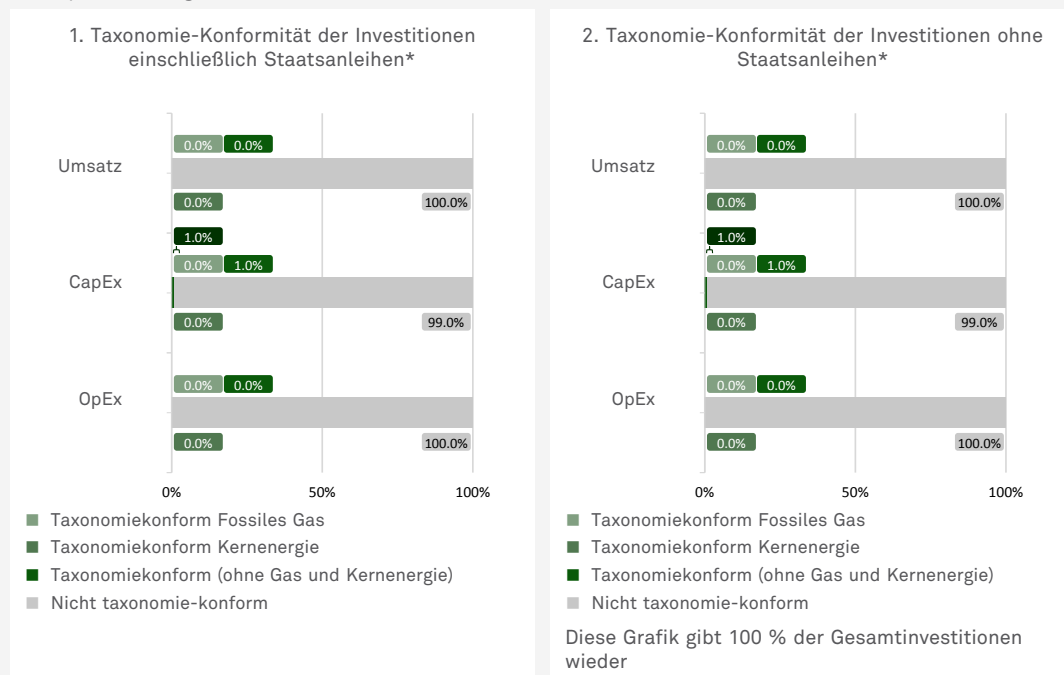
– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

89 % der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2022 1 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

* Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die spezifisch zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

– Der Anlageverwalter:

(a) Investierte in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ (wie vom Anlageverwalter festgelegt) erachtet wurden.

(b) Stellte sicher, dass das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Teilfonds, wie vom Anlageverwalter bestimmt, zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter war als das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index (der „Referenzwert“).

(c) Stellte sicher, dass die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Teilfonds um mindestens 25 % niedriger war als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Referenzwerts im Bezugszeitraum.

(d) Setzte eine Ausschlusspolitik ein wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angeben.

Diese verbindlichen Elemente des Teilfonds wurden in die Handelssysteme einprogrammiert und herangezogen, um die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale im Bezugszeitraum zu überwachen.

– Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.

Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung der beworbenen Merkmale verwendet werden, erfolgte durch die Responsible Investment Group. Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen werden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Kriterien sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.

– Im Bezugszeitraum war eine Mitwirkung bei den Emittenten, in die der Teilfonds investiert, weder erforderlich, noch wurde sie unternommen, weil es nicht zu Verstößen gegen verbindliche Elemente gekommen war, die im Nachtrag für den Teilfonds aufgeführt sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Food Innovation Fund

Unternehmenskennung: 2138005A42Y4JNQR4L23

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nach-haltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweise einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 90,40 % an nachhaltigen Investitionen. ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 2. Februar 2023 bis zum 10. November 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

- Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.
- Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.
- Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.
- bessere ökologische oder soziale Ergebnisse durch Investitionen in Unternehmen entlang der Lebensmittelversorgungskette, die ökologische und/oder soziale Faktoren gut managen oder Lösungen für ökologische und/oder soziale Probleme bieten. Dazu gehören beispielsweise Unternehmen, die Emissionen im Zusammenhang mit der Intensivtierhaltung reduzieren, oder Unternehmen, deren Tätigkeiten ertragssteigernde Innovationen unterstützen.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR trugen zu Umweltzielen bei, die nicht mit der EU-Taxonomie übereinstimmen. Die entsprechenden Einzelheiten sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR trugen auch zu sozialen Zielen bei, die nicht mit der EU-Taxonomie übereinstimmen. Die entsprechenden Einzelheiten sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1 - Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:

– in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und

– eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die

– keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2 - 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 – Verbesserte ökologische und/oder soziale Ergebnisse in der gesamten Nahrungsmittelversorgungskette, wie aus qualitativen Fallstudien hervorgeht.

Ohne zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltene Instrumente stellte sich die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren folgendermaßen dar:

Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 - 98,84 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - 96 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 – Qualitative Fallstudien sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Mittel
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	Qualitative Fallstudien sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR trugen auch zu sozialen Zielen bei, die nicht mit der EU-Taxonomie übereinstimmen. Die entsprechenden Einzelheiten sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu dem in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Ziel des Klimaschutzes bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR trugen zu Umweltzielen bei, die nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Die entsprechenden Einzelheiten sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAIs berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2. Februar 2023 bis 10. November 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA-REG CHF 0.1	NAHRUNGSMITTEL	4,39 %	SWI
COSTCO WHOLESAL USD 0.005	PRIVATKUNDEN	4,27 %	USA
PEPSICO INC USD 0.017	GETRÄNKE	4,06 %	USA
DEERE & CO USD 1	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	3,62 %	USA
ARCHER-DANIELS-MI USD NPV	LANDWIRTSCHAFT	3,54 %	USA
AGCO CORP USD 0.01	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	3,5 %	USA
WALMART DE MEXICO MXN NPV	PRIVATKUNDEN	3,27 %	MEX
KERRY GROUP PLC EUR 0.125	NAHRUNGSMITTEL	3,24 %	IRE
SPROUTS FARMERS USD 0.001	NAHRUNGSMITTEL	3,13 %	USA
BLACKROCK INST US DOL HRT	AKTIEN	3,02 %	USA
KONINKLIJKE AHOL EUR 0.01	NAHRUNGSMITTEL	2,91 %	NET
DANAHER CORP USD 0.01	GESUNDHEIT – PRODUKTE	2,84 %	USA
NOVOZYMES A/S-B SHA DKK 2	CHEMIKALIEN	2,79 %	DEN
TRIMBLE INC USD 0.001	ELEKTRONIK	2,77 %	USA
UNILEVER P GBP 0.00031111	KOSMETIK/KÖRPERPFLEGE	2,67 %	UKK

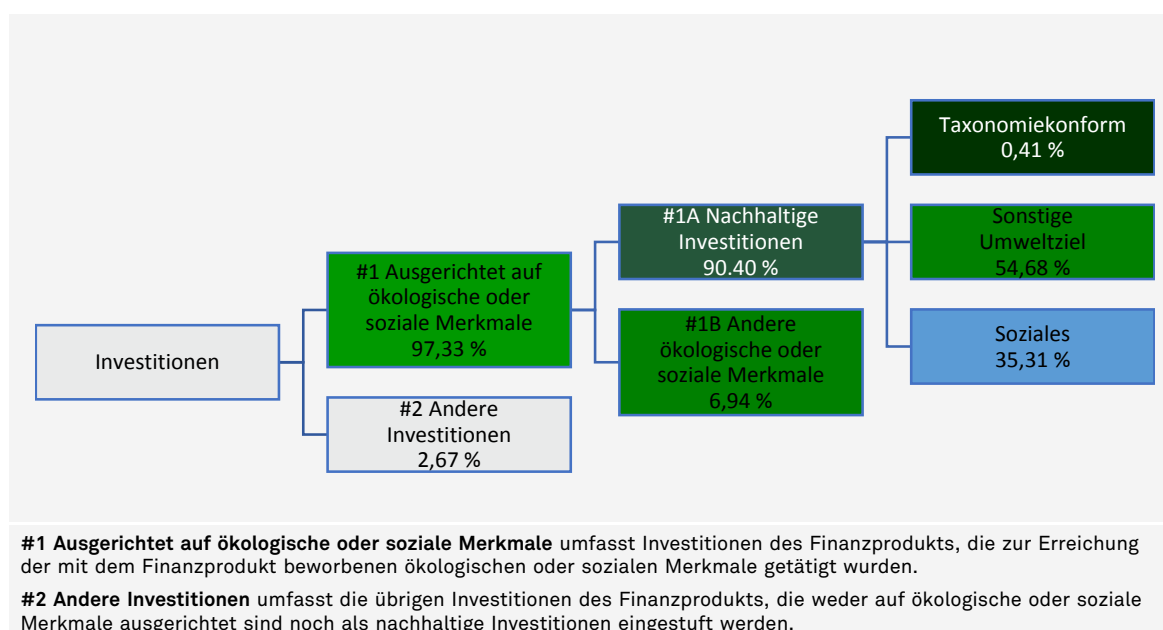


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

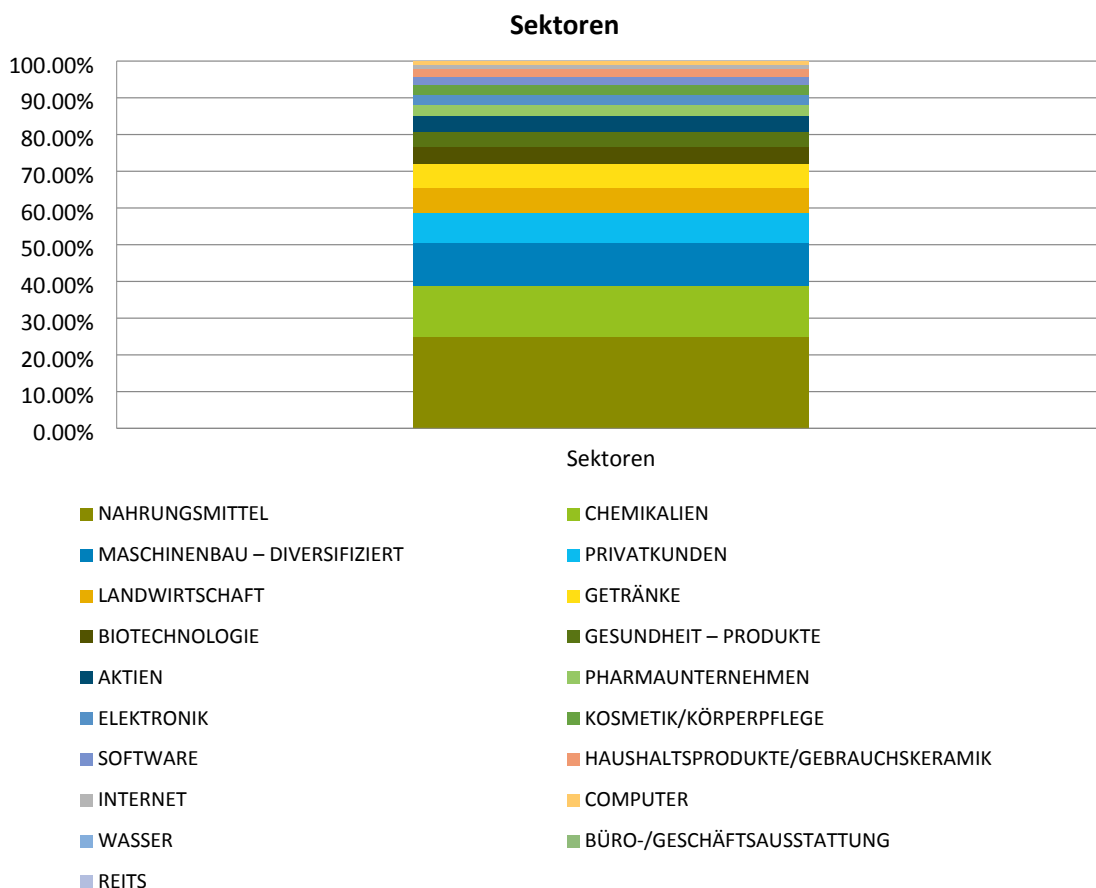
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 97,33 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 90,40 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Davon hatten 54,68 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 35,31 % ein soziales Ziel. 0,41 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.



Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
– Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 10. November 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,41 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

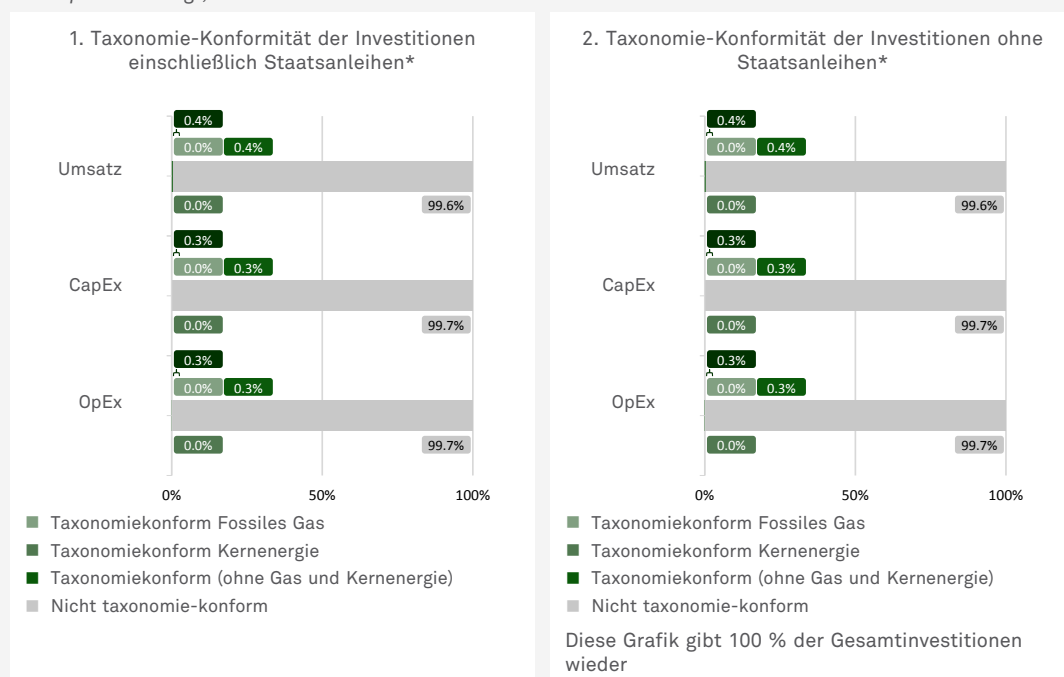
- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitions-ausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 54,68 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 35,31 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 2,67 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

2,67 % in Barmitteln und einem Vehikel für das Liquiditätsmanagement, das ausschließlich zu diesem Zweck gehalten wird. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen

- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.
- investierte mindestens 75 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Unternehmen weltweit, die in der Position sind, von den Anlagechancen im Zusammenhang mit der Nachfrage nach neuen Nahrungsmitteln und technischen Innovationen in der Landwirtschaft über die globale Nahrungsmittellieferkette hinweg zu profitieren.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Future Earth Fund

Unternehmenskennung: 213800QE71BVU06AG026

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nach-haltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umwelt-ziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vor-aus-ge-setzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrens-weisen einer guten Unternehmens-führung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeichnis von **ökologisch nach-haltigen Wirtschaftstätig-keiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Ver-zeichnis der sozial nach-haltigen Wirtschaftstätig-keiten. Nach-haltige Investitionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☒ Ja	●○ ☐ Nein
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 98,35 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen
☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00 %	☐ mit einem sozialen Ziel
	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 10. November 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erreicht.

Der Teilfonds strebt langfristiges Kapitalwachstum mit einem nachhaltigen Investitionsziel an. Insbesondere strebt der Teilfonds einen Beitrag zu einem Umweltziel an, indem er in Wertpapiere von Unternehmen weltweit investiert, die Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, die die Belastung der Umwelt und der natürlichen Ressourcen auf unserer Erde reduzieren.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zum nachhaltigen Investitionsziel bei, indem in Unternehmen investiert wurde, die auf das vom Anlageverwalter entwickelte Rahmenwerk Future Earth ausgerichtet sind, das positive Auswirkungen auf die Erde und Umwelt nachweist.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu dem in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Ziel des Klimaschutzes bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Elektrifizierung
- Klimaneutralität

- Optimierung der Ressourcennutzung, die den ökologischen Fußabdruck und die Kohlenstoffintensität verbessert
- Abfallverringerung, Wiederverwendung und Recycling
- Erzeugung erneuerbarer Energie oder Erbringung wichtiger Teildienste zum Einsatz im Sektor erneuerbare Energie
- Verringerung von Schadstoffen oder Emissionen durch naturnahe Lösungen
- Wasseraufbereitung und Wasserschutz

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu sozialen Zielen bei.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds erreicht wurde:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1: Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen anlegen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2: 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3: Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4: Alle Investitionen müssen sich an dem vom Anlageverwalter entwickelten Rahmenwerk Future Earth orientieren, das positive Auswirkungen auf die Erde und Umwelt nachweist, wie auch durch qualitative Fallstudien belegt.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 98,4 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag nach Gewichtung bei 94 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 100 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds zu erreichen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Schwach – auf einer gewichteten Durchschnittsbasis wurde der Teilfonds von einem Drittanbieter von Daten als mit einem geringen Maß an nicht gemanagten ESG-Risiken behaftet eingestuft.
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	100 % der Investitionen (ausgenommen die zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen) sind auf das vom Anlageverwalter entwickelte Rahmenwerk Future Earth ausgerichtet und wiesen positive Auswirkungen auf Erde und Umwelt nach, belegt durch qualitative Fallstudien, die diesem Dokument beigelegt sind. Die entsprechenden Einzelheiten sind für die Anleger auf Anfrage beim Anlageverwalter des Teilfonds erhältlich.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 10. November 2023	0 %	0 %	Schwach	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen)
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0 %	Mittel	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen)

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
- 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
- 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
- 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
- 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
- 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
- 8. Emissionen in Wasser
- 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
- 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
- 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
- 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
- 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat

Bei den **wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen** han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-faktoren in den Be-reich-en Um-welt, Sozia-les und Be-schäf-tigung, Achtung der Mensch-enrechte und Be-kämp-fung von Kor-rup-tion und Bestechung.

- 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

● ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAIs berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 10. November 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
VOLTRONIC POWER TE TWD 10	ELEKTRONIK	6,68 %	TAI
DANAHER CORP USD 0.01	GESUNDHEIT – PRODUKTE	5,98 %	USA
NEXTERA ENERGY I USD 0.01	ELEKTRIK	5,54 %	USA
SSE PLC GBP 0.5	ELEKTRIK	4,7 %	UKK
INGERSOLL-RAND I USD 0.01	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	4,69 %	USA
HUBBELL INC USD 0.01	ELEKTRONIK	4,61 %	USA
NOVOZYMES A/S-B SHA DKK 2	CHEMIKALIEN	3,7 %	DEN
ORSTED A/S DKK 10	ELEKTRIK	3,39 %	DEN
GREENCOAT UK WIND PLC	AKTIEN	3,16 %	UKK
INFINEON TECHNOLO EUR NPV	HALBLEITER	3,11 %	GER
DEERE & CO USD 1	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	3,04 %	USA
TE CONNECTIVITY CHF 0.57	ELEKTRONIK	2,98 %	USA
TRANE TECHNOLOGIES USD 1	BAUSTOFFE	2,9 %	USA
NESTE OYJ EUR NPV	ÖL UND GAS	2,89 %	FIN
DARLING INGREDIE USD 0.01	LANDWIRTSCHAFT	2,83 %	USA

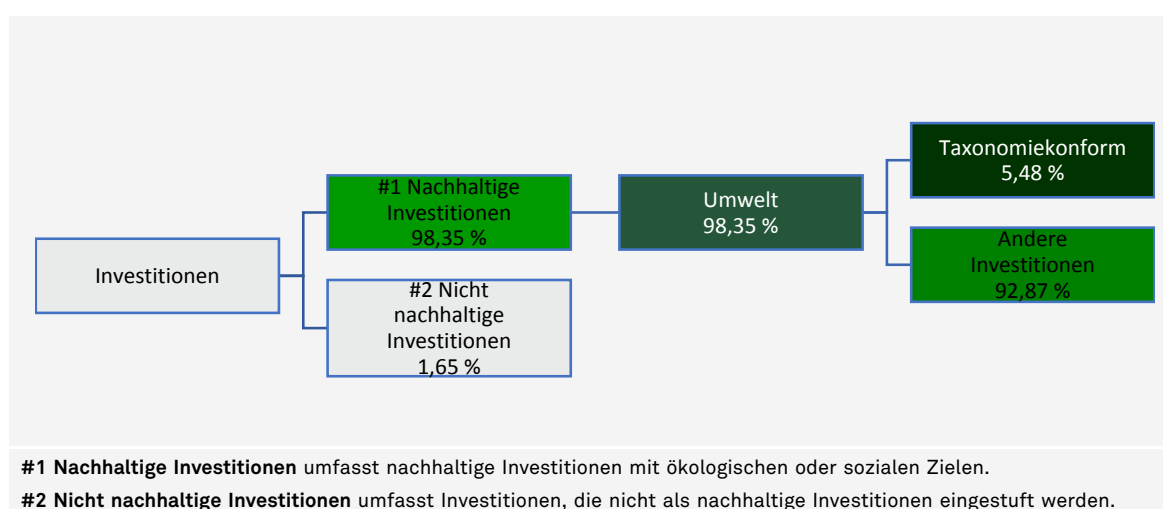


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

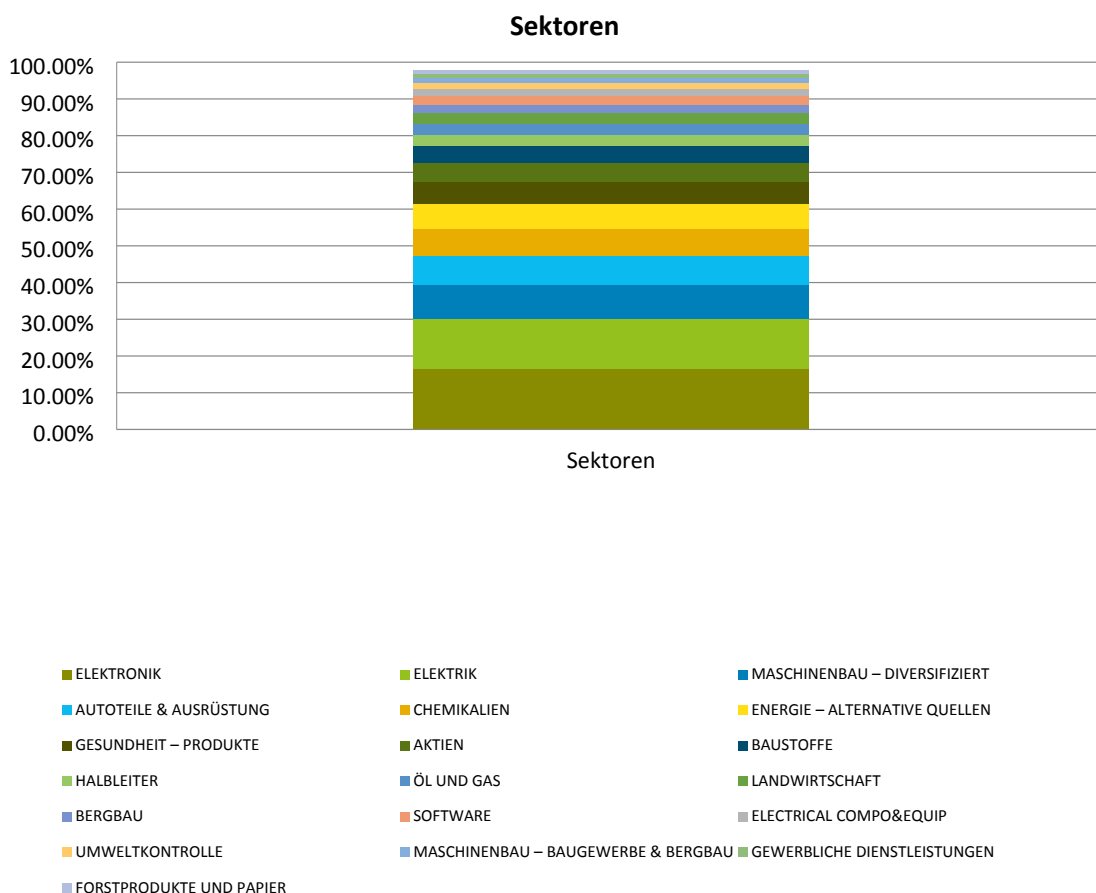
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 98,35 % des Nettoinventarwerts waren in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert. 98,35 % des Nettoinventarwerts waren in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert. 5,48 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 10. November 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

5,48 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

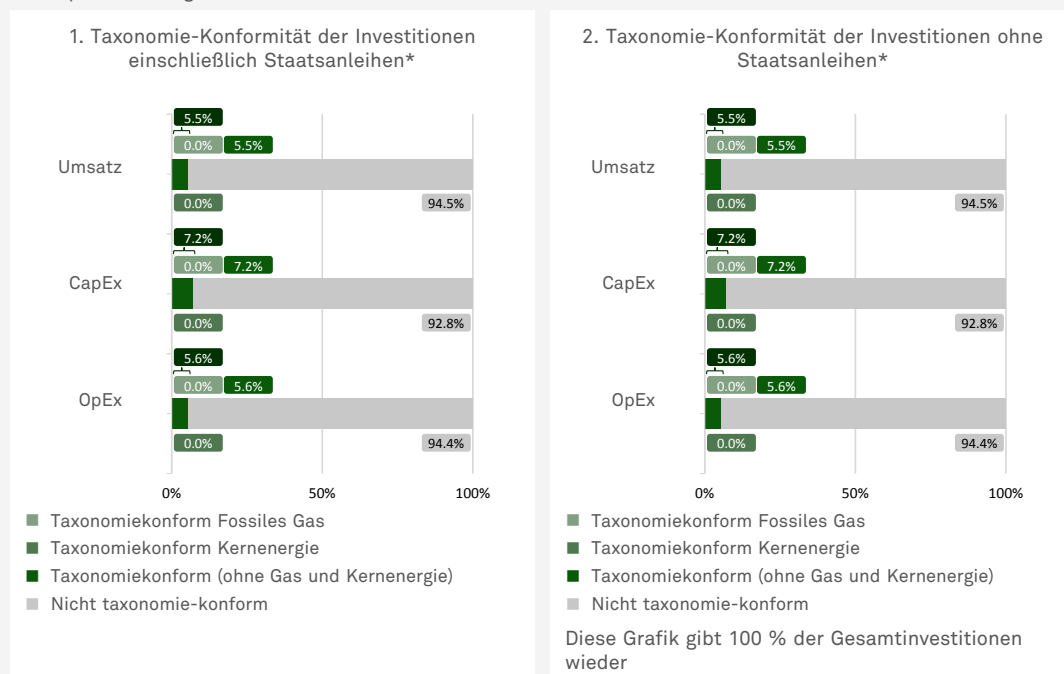
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissi-

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprocentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, stieg im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen an. Dies war auf die bessere Verfügbarkeit von Daten zurückzuführen, die von den Unternehmen gemeldet wurden, im Gegensatz zu der Verwendung geschätzter Daten externer Datenanbieter.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

onswerte aufweisen,
die den besten
Leistungen
entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 92,87 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



sind nachhaltige
Investitionen mit einem
Umweltziel, die die
Kriterien für ökologisch
nachhaltige Wirt-
schaftstätigkeiten
gemäß der EU-
Taxonomie **nicht**
berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 1,65 % de Nettoinventarwerts in die Kategorie #2 (Nicht nachhaltige Investitionen), die die ausschließlich zu Liquiditätszwecken gehaltenen Instrumente umfasste, darunter Barmittel und Barmitteln gleichgestellte Mittel. Diese Instrumente wurden gehalten, um sicherzustellen, dass der Teilfonds über ausreichende Liquidität verfügte. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Um das nachhaltige Investitionsziel zu erreichen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.
- Er investierte mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen, die zur Erreichung des Umweltziels beitragen, die Belastung der Umwelt und der natürlichen Ressourcen auf unserer Erde zu verringern.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Global Credit Fund

Unternehmenskennung: 213800FUW383MBX2J760

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nach-haltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswegen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 24. November 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Zu den von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Best Practices gehörten die Verringerung der Nutzung von Teersanden und Kraftwerkskohle, die Verringerung der Herstellung umstrittener Waffen und die Reduzierung von CO₂-Emissionen.

Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus den Bereichen Tabak, der Herstellung umstrittener Waffen und dem Abbau von Kraftwerkskohle bezogen.

– Emittenten, die nach Ansicht des Anlageverwalters in schwerwiegende ökologische, soziale oder Governance-Kontroversen verwickelt waren (einschließlich erheblicher Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze) wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Der Teilfonds investierte nicht in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR.

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit

die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurde der folgende Nachhaltigkeitsindikator eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

Der folgende Nachhaltigkeitsindikator wird verwendet, um zu messen, ob der Teilfonds die von ihm geförderten ökologischen und/oder sozialen Merkmale bewirbt:

Ausschlusspolitik: Eine Bewertung, ob der Teilfonds erfolgreich und beständig seine Ausschlusspolitik ausführte, die darin bestand, nicht in Wertpapiere zu investieren, die von Unternehmen ausgegeben wurden, auf die einer der folgenden Punkte zutraf:

Der Nachhaltigkeitsindikator hat folgendermaßen abgeschnitten:

Die Ausschlusspolitik wurde eingehalten, weil der Teilfonds nicht in Wertpapiere investierte, die von Unternehmen ausgegeben wurden:

- mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Produktion von Tabak erzielen,
- an der Produktion von kontroversen Waffen beteiligt sind,
- mehr als 5 % ihres Umsatzes aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und/oder mehr als 10 % ihres Umsatzes aus der Verstromung von Kraftwerkskohle erzielen, es sei denn: a) bei der erworbenen Emission handelt es sich um einen Use of Proceeds Impact Bond wie im Nachtrag beschrieben und/oder b) der Emittent verfügt über einen soliden und klar definierten Plan zum Ausstieg aus dem Kohlebergbau und/oder der Kohleverstromung vor (i) 2030 im Fall von Emittenten mit Sitz in einem entwickelten Markt oder (ii) 2040 im Fall von Emittenten mit Sitz in einem aufstrebenden Markt,
- Als in schwerwiegende Kontroversen im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung verwickelt erachtet werden (einschließlich erheblicher Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze).

Zum 31. Dezember 2023 waren die Investitionen des Teilfonds zu 89 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 11 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend. In Übereinstimmung mit den vorvertraglichen Informationen gemäß SFDR tätigte der Teilfonds im Bezugszeitraum keine Investitionen, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Nicht zutreffend.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Bezugszeitraum nicht.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 24. November 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ISHARES USD CORP BOND USD	AKTIEN	4,76 %	UKK
US TSY 4.75% 11/15/43	STAATSANLEIHEN	4,2 %	USA
US TSY 3.5% 01/31/28	STAATSANLEIHEN	3,84 %	USA
ISHARES CORE EURO CORP BO	AKTIEN	2,52 %	UKK
US TS 2.875% 08/15/28	STAATSANLEIHEN	2,43 %	USA
US TSY 4.5% 11/15/33	STAATSANLEIHEN	2,43 %	USA
US TSY 2.75% 02/15/28	STAATSANLEIHEN	1,05 %	USA
BUNDES 1.7% 08/15/32	STAATSANLEIHEN	0,95 %	GER
BPCE SA VAR 10/19/34	BANKEN	0,95 %	FRC
US TSY 2.5% 04/30/24	STAATSANLEIHEN	0,73 %	USA
BNI Finan 3.875% 12/01/30	GETRÄNKE	0,72 %	UKK
Banco San VAR 09/14/27	BANKEN	0,71 %	SPA
Corebridg 5.75% 01/15/34	VERSICHERUNGEN	0,71 %	USA
CITIGROUP VAR 06/03/31	BANKEN	0,7 %	USA
Danone SA 3.706% 11/13/29	NAHRUNGSMITTEL	0,68 %	FRC



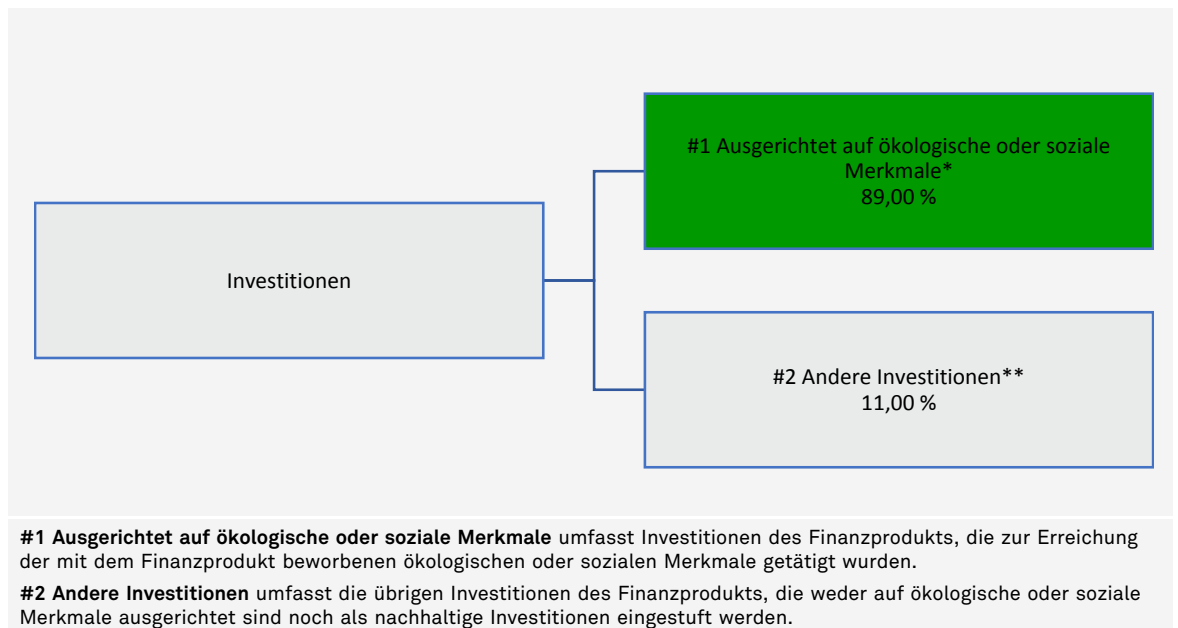
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale, indem er einen ausschließenden Ansatz verfolgte. Der nachstehende Zahlenwert unter #1 und #1B stellt den Portfolioanteil dar, der bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Die Prozentangaben in diesem Abschnitt, wie in der nachstehenden Grafik angegeben, entsprechen dem Stand vom 31. Dezember 2023 und daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

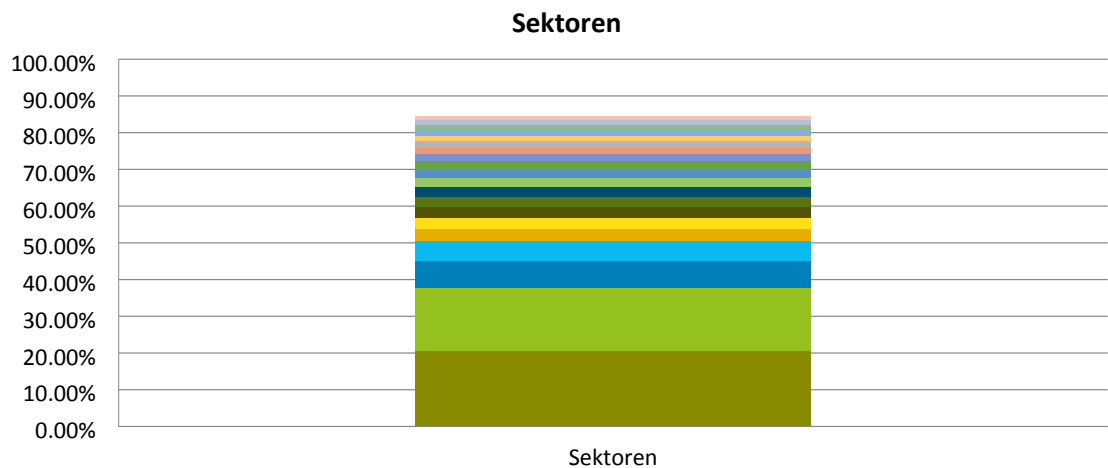
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel und Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

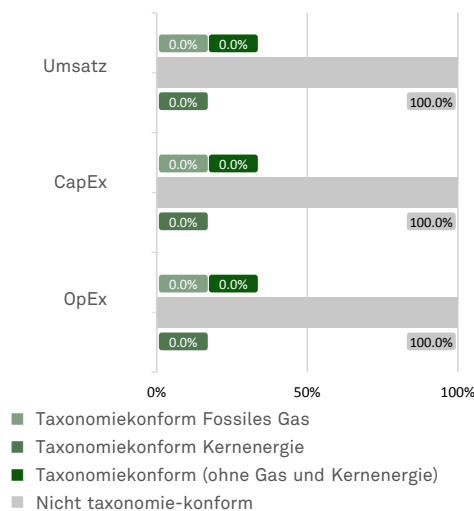
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

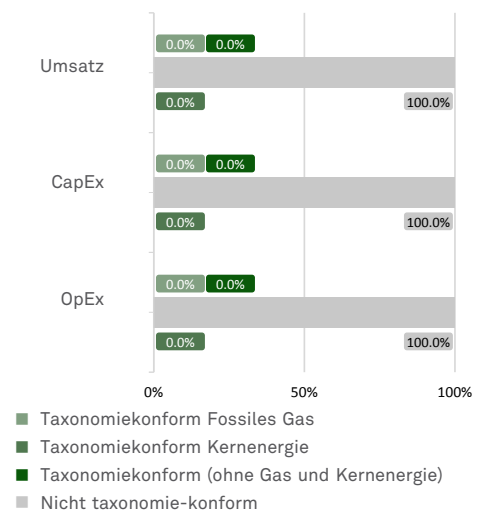
Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: – **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln – **Investitionsausgaben** (CapEx), die die von den Unternehmen, in die investiert wird, getätigten grünen Investitionen zeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. – **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Der Anlageverwalter verwendete Ausschlusskriterien wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben.
- Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Ausschlusskriterien durch Ausschluss bestimmter Emittenten wie im Nachtrag (und vorstehend) angegeben erfüllt wurden. Dies wurde überwacht, indem die verbindlichen Elemente (Ausschlüsse) in die Handelssysteme einprogrammiert wurden.
- Der Anlageverwalter verwendete außerdem die folgenden internen Kontrollmechanismen, um zu überwachen, ob der Teilfonds die einprogrammierten verbindlichen Elemente im Bezugszeitraum beachtete:
 1. Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.
 2. Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

3. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen wurden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Elemente sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Global Equity Income Fund

Unternehmenskennung: 213800SLXMIXN6BQFB77

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nach-haltige Inves-ti-tion** ist eine Inves-ti-tion in eine Wirt-schaftstätig-keit, die zur Erreichung eines Umwelt-ziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vor-aus-ge-setzt, dass diese Inves-ti-tion keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich be-ein-trächtigt und die Unter-nehmen, in die inves-tiert wird, Ver-fahrens-weisen einer guten Unter-nehmens-führung an-wen-den.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifi-kations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeichnis von **ökologisch nach-haltigen Wirt-schafts-tätig-keiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Ver-zeichnis der sozial nach-haltigen Wirt-schaftstätig-keiten. Nach-haltige Investi-tionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
☒ ☒ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem sozialen Ziel ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 24. November 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die:

- Einkünfte aus der Herstellung von Tabak erzielen
- 10 % oder mehr der Einkünfte mit Produkten erzielen, die die Tabakindustrie unterstützen, und/oder mit Tabakprodukten, die von anderen Unternehmen hergestellt werden;
- Einkünfte aus der Herstellung umstrittener Waffen erzielen;
- 10 % oder mehr der Einkünfte aus der Herstellung von alkoholischen Getränken erzielen;
- 10 % oder mehr der Einkünfte aus dem Besitz und/oder dem Betrieb einer Spielhalle erzielen;
- 10 % oder mehr der Einkünfte aus der Herstellung und/oder dem Betrieb von Vergnügungsstätten für Erwachsenenunterhaltung erzielen;
- 10 % oder mehr der Einkünfte aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen;
- die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt. Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden:

– Ausschlusspolitik: Eine Bewertung, ob der Teilfonds seine Ausschlusspolitik erfolgreich und konsistent umgesetzt hat.

Der Teilfonds hat seine Ausschlusspolitik wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A. – Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Investitionen gemäß der SFDR zu investieren.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A. – Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Investitionen gemäß der SFDR zu investieren.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter hat die Indikatoren für nachhaltige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren gemäß der SFDR nicht überprüft, da sich der Teilfonds nicht verpflichtet hat, einen Mindestanteil des Vermögens in Anlagen gemäß der SFDR zu investieren.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A. – Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Investitionen gemäß der SFDR zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte einige der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Produktebene. Der Anlageverwalter verwendete eine Kombination externer und interner Daten und Research zwecks der Identifikation von Unternehmen, die in Bereichen tätig sind, die aus ökologischer oder sozialer Sicht wesentliche Schäden verursachen. Der Anlageverwalter berücksichtigte folgende der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“):

- Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder dem Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind;
- Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen beteiligt waren.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 97,02 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds ist keine Verpflichtungen eingegangen, in nachhaltige Investitionen gemäß der SFDR zu investieren. 1,06 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale: 97,02 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 1,06 % des Nettoinventarwerts

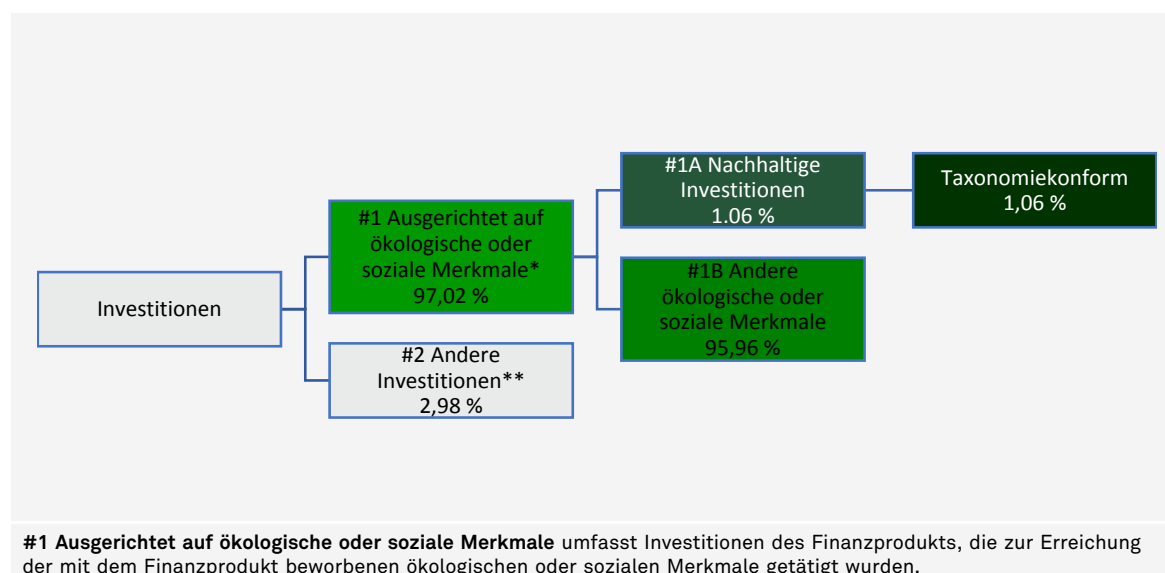
- Taxonomiekonform: 1,06 % des Nettoinventarwerts

- Umwelt: 0 % des Nettoinventarwerts

- Soziales: 0 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 95,96 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 2,98 % des Nettoinventarwerts



#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel und Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssectoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

1,06 % des Nettoinventarwerts des Fonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

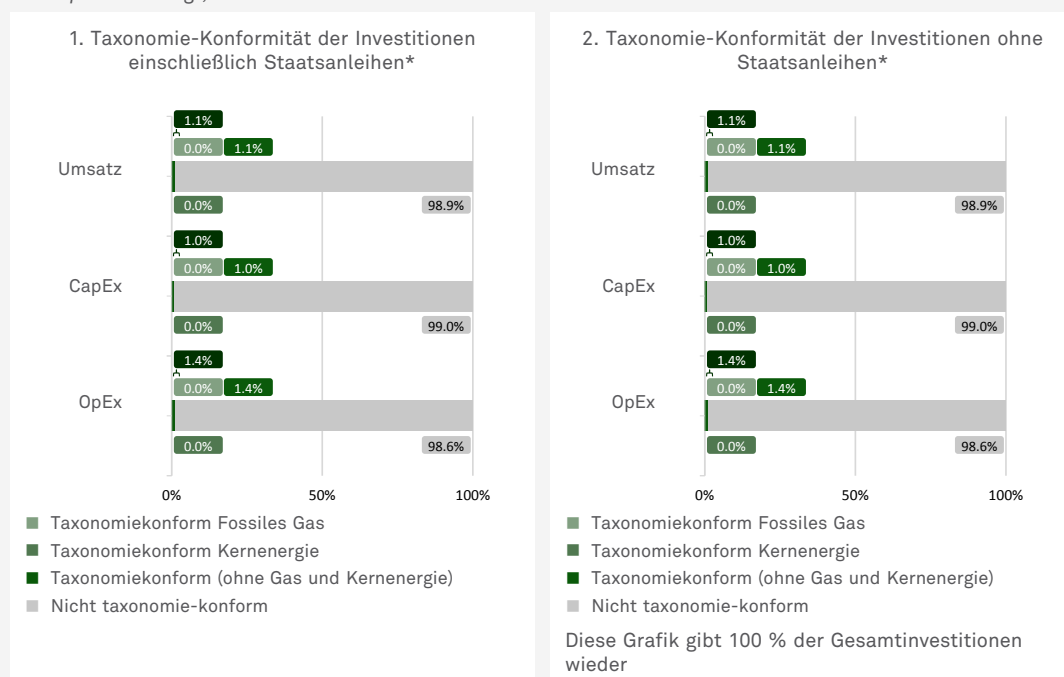
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

0 %

- Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

0 %



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

0 %



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 2,98 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), d. h. 2,98 % in Barmittel, die ausschließlich zu Liquiditätszwecken gehalten wurden. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die umstrittene Waffen herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit der Produktion von Alkohol erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit Glücksspiel erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Unternehmenskennung: 213800B8FEADSCHQLG79

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ Ja		●○ ☒ Nein	
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 11,00 % an nachhaltigen Investitionen.	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%		☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt	



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 3. April 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt:

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete. Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus den Bereichen Tabak, Rüstung, Glücksspiel, Kohleförderung und der Herstellung umstrittener Waffen bezogen. Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.
- Der Teilfonds fokussierte sich auf Emittenten mit höheren Werten in Bezug auf ihr ESG-Profil, indem er nicht in Wertpapiere investierte, die nach Maßgabe des Anlageverwalters das niedrigste ESG-Rating (einen Wert von 5) aufwiesen. So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 29 % des Nettoinventarwerts des Portfolios in Emittenten mit einem Rating von 1 und 2 investiert. Der verbleibende Teil war in Emittenten mit einem ESG-Rating von 3 oder 4 oder in Anlagen ohne ESG-Rating investiert (bei denen es sich um liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen einschließlich Barmittel sowie um Derivate (FDI) handelte, die eigens zu

Absicherungszwecken verwendet wurden). Angaben zum vermögensgewichteten Gesamt-ESG-Rating gegenüber dem Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index sind der nächsten Frage zu entnehmen;

- Der Teilfonds fokussierte sich auf Emittenten, deren Kohlenstoffintensität der Anlageverwalter nach seinem alleinigen Ermessen als niedriger erachtete. Einzelheiten zur vermögensgewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität gegenüber dem Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index sind der nächsten Frage zu entnehmen.

Außerdem investierte der Teilfonds in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR (wie vom Anlageverwalter festgelegt) („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind und die nach Auffassung des Anlageverwalters positiv zum Erreichen der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beitragen. Der Teilfonds hatte zum 31. Dezember 2023 11 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft werden.

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie,
- Industrie, Innovation und Infrastruktur,
- Nachhaltige Städte und Gemeinden,
- Klimaschutzmaßnahmen.

Die nachhaltigen Investitionen können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung der EU genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass dieser Teilfonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewirbt und nachhaltige Investition nicht zu seinen Anlagezielen gehören. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 11 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des Mindestanteils).
- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:

(a) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 20 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen;

(b) im Falle eines jeden solchen Use-of-Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen.

- Ausschlusspolitik: Der Teilfonds hat seine Ausschlusspolitik wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds zu erfüllen.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, die der Teilfonds teilweise tätigte, bestand in positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu Umweltzielen oder sozialen Zielen bei durch Investitionen in:

Use-of-Proceeds Impact Bonds: Die Erlöse wurden verwendet, um Projekte mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen zu finanzieren oder zu refinanzieren, wobei die UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele herangezogen wurden. Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Von Impact Issuers emittierte Schuldtitel: Mindestens 20 % der Umsatzströme dieser Investitionen standen anhand der UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele in Zusammenhang mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen. Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion

- Klimaschutzmaßnahmen

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Gesundheit und Wohlergehen
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten
- Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investitionen nicht ausdrücklich berücksichtigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzten.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen und ausschließlich im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das vom Teilfonds gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.
- Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI-Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Soweit möglich hat der Teilfonds hat die folgenden PAIs, wie in Tabelle 1 im Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission beschrieben, berücksichtigt:

10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden.
 - Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an diesen Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 3. April 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INSIGHT-USD LIQUIDITY FD-	AKTIEN	1,98 %	IRE
Ithaca En 9% 07/15/26	ÖL UND GAS	1,95 %	UKK
NBM US HO 7% 05/14/26	NAHRUNGSMITTEL	1,82 %	BRA
TRIVIUM P 3.75% 08/15/26	VERPACKUNGEN UND BEHÄLTER	1,7 %	NET
Renk AG/F 5.75% 07/15/25	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	1,64 %	GER
AXALTA CO 4.75% 06/15/27	CHEMIKALIEN	1,63 %	USA
OI Europe 2.875% 02/15/25	VERPACKUNGEN UND BEHÄLTER	1,63 %	USA
INEOS Qua 3.75% 07/15/26	CHEMIKALIEN	1,57 %	UKK
ALTICE FI 2.25% 01/15/25	MEDIEN	1,56 %	LUX
TECHEM VE 6% 07/30/26	GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	1,5 %	GER
Ford Moto FRN 03/06/26	AUTOHERSTELLER	1,49 %	USA
ZF Financ 5.75% 08/03/26	AUTOTEILE & AUSRÜSTUNG	1,49 %	GER
CPUK FINA 6.5% 08/28/26	UNTERHALTUNG	1,44 %	UKK
OI Europe 6.25% 05/15/28	VERPACKUNGEN UND BEHÄLTER	1,43 %	USA
Forvia SE 7.25% 06/15/26	AUTOTEILE & AUSRÜSTUNG	1,43 %	FRC



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

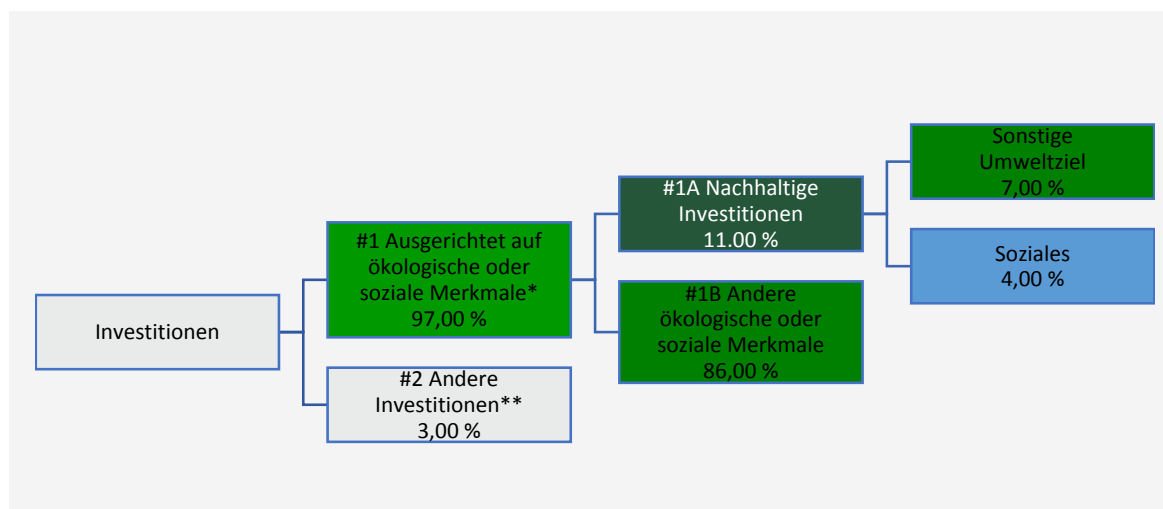
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale durch einen ausschließenden Ansatz und Allokationen in bestimmten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, Emittenten mit besseren Werten und Emittenten mit geringerer Kohlenstoffintensität.

Die Angaben in #1 stellen eine Kombination aus beiden Ansätzen dar. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1A angegeben. Der nachstehende Zahlenwert unter #1B stellt den Portfolioanteil dar, den der Anlageverwalter nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet, jedoch bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie in der nachstehenden Grafik angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

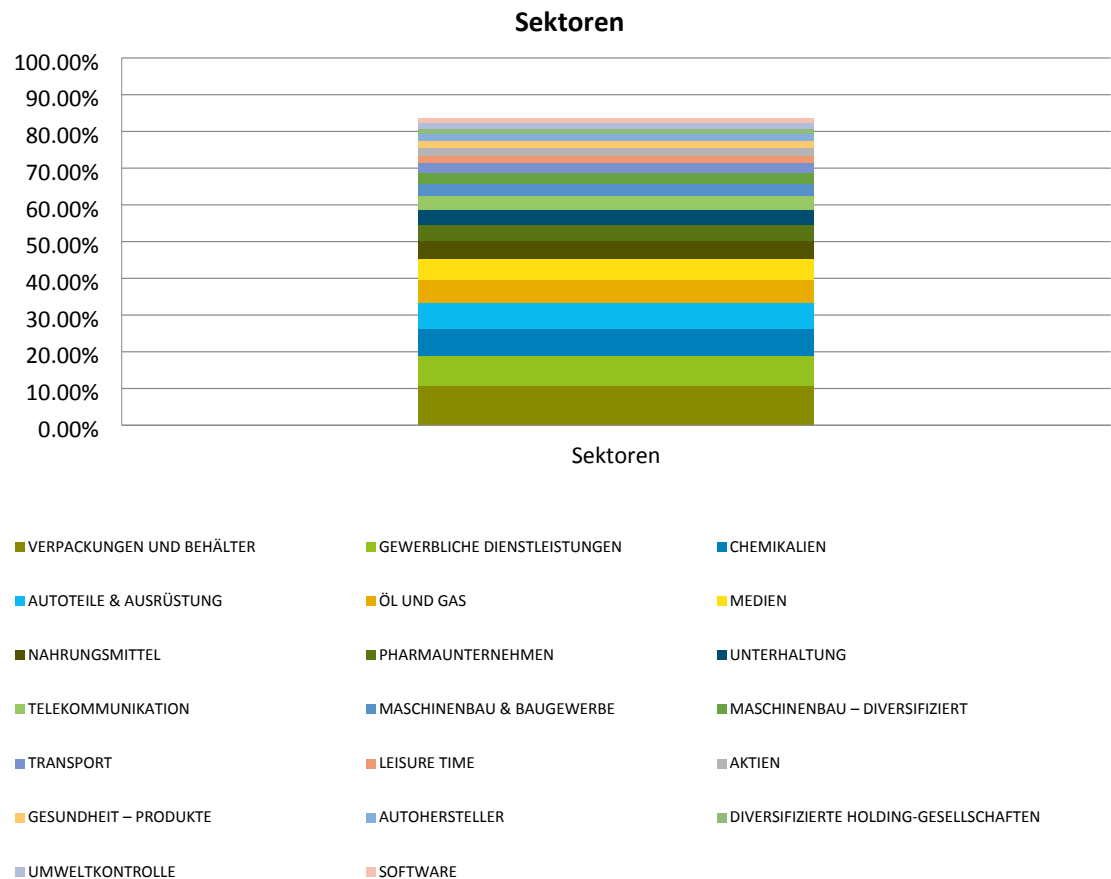
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

** Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Investitionen zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass zu diesen Investitionen nur begrenzte Daten vorlagen. Daher war die Datenabdeckung für manche Investitionen des Teilfonds (etwa zum CO2-Fußabdruck) sehr gering und in Ermangelung relevanter Daten ging der Anlageverwalter davon aus, dass solche Investitionen auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.*

*** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.*

● In welchen Wirtschaftssectoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds, wie unten dargestellt, hauptsächlich in den Bereichen Verpackungen und Behälter sowie Chemikalien engagiert.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Aus den Allokation des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR sind 4 % der nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die mit der Taxonomie konformen Investitionen trugen zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

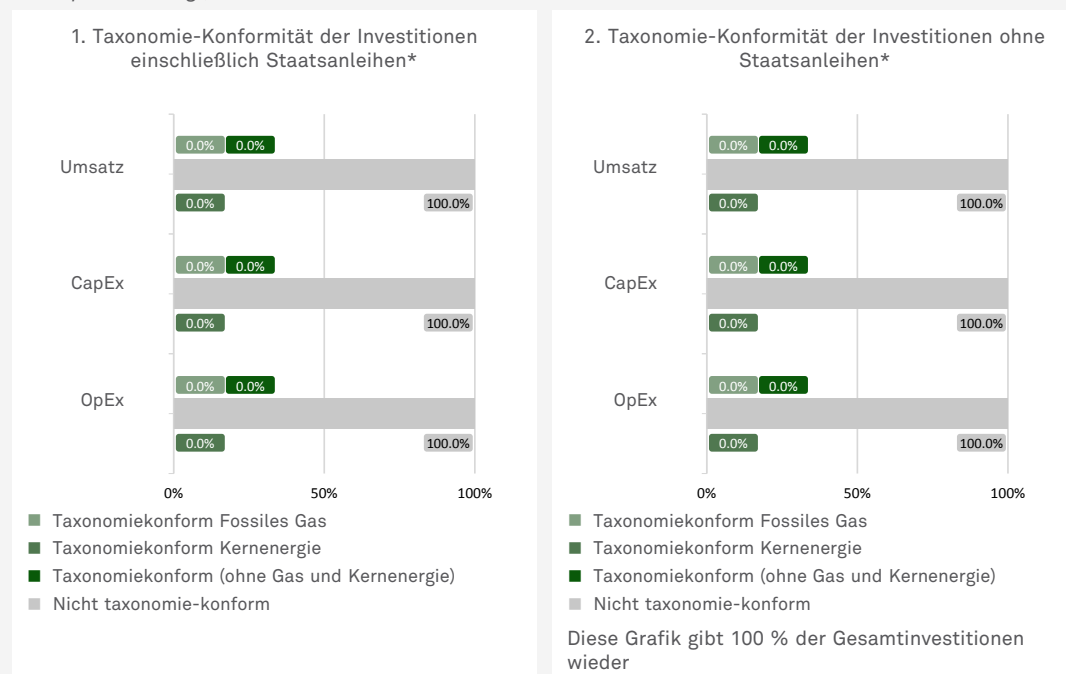
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissi-

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In s Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

onswerte aufweisen,
die den besten
Leistungen
entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

96 % der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2023 4 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die spezifisch zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

– Der Anlageverwalter:

(a) Investierte in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ (wie vom Anlageverwalter festgelegt) erachtet wurden.

(b) Stellte sicher, dass das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Teilfonds, wie vom Anlageverwalter bestimmt, zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter war als das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index (der „Referenzwert“).

(c) Stellte sicher, dass die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Teilfonds um mindestens 25 % niedriger war als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Referenzwerts im Bezugszeitraum.

(d) Setzte eine Ausschlusspolitik ein wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben.

Diese verbindlichen Elemente des Teilfonds wurden in die Handelssysteme einprogrammiert und herangezogen, um die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale im Bezugszeitraum zu überwachen.

– Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.

Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung der beworbenen Merkmale verwendet werden, erfolgte durch die Responsible Investment Group. Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen werden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Kriterien sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.

– Im Bezugszeitraum war eine Mitwirkung bei den Emittenten, in die der Teilfonds investiert, weder erforderlich, noch wurde sie unternommen, weil es nicht zu Verstößen gegen verbindliche Elemente gekommen war, die im Nachtrag für den Teilfonds aufgeführt sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Long-Term European Equity Fund

Unternehmenskennung: 2138004XGCRR77P7N117

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
☒ ☒ Ja	☒ ☐ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 11,2 % an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ mit einem sozialen Ziel
	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Bezugszeitraum für diesen regelmäßigen Bericht ist der Zeitraum vom 17. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

Im Bezugszeitraum bewarb dieser Teilfonds gute Umwelt-, Sozial- und Governance (ESG)-Praktiken oder -Merkmale, indem er bewusst Investitionen in Unternehmen vermied, deren ESG-Eigenschaften [wie vom Anlageverwalter definiert] unterhalb der Schwellenwerte lagen. Im Allgemeinen setzte sich das Portfolio des Teilfonds aus Unternehmen zusammen, die hohe Standards in Bezug auf ESG-Praktiken einhielten oder aufgrund ihrer fortschrittlichen ökologischen und sozialen Praxis attraktiv waren und eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Zu den berücksichtigten ökologischen und sozialen Eigenschaften gehörten die nachstehend aufgeführten Themen:

Umwelt

- Treibhausgasemissionen
- Biodiversität und natürliche Ressourcen
- Klima- und Übergangsrisiken
- Umweltverschmutzung und Abfallmanagement

Soziales

- Geschäftsethik, Bestechung und Korruption
- Datenschutz und -sicherheit
- Arbeitspraktiken und Menschenrechtsschutz
- Diversität, Gleichstellung und Integration

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Es war nicht beabsichtigt, dass die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds mit einem sozialen Ziel waren auf Ziel 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet. Die nachhaltige Investition des Teilfonds gemäß SFDR mit einem Umweltziel war auf Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet – „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Teilfonds zog 14 Datenpunkte in Bezug auf die nachstehend aufgeführten Themen als Nachhaltigkeitsindikatoren heran, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Umwelt:

- Treibhausgasemissionen:
 1. Kohlenstoffintensität 1 und 2
- Biodiversität und natürliche Ressourcen:
 2. Das Unternehmen hat Standorte in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität und ist in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt
 3. Betriebsstätten, die in geschützten Gebieten oder angrenzend an geschützte Gebiete und Gebiete mit einer hohen Biodiversität außerhalb geschützter Gebiete liegen, gepachtet sind oder verwaltet werden
- Klima- und Übergangsrisiken:
 4. Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe
- Umweltverschmutzung und Abfallmanagement:
 5. Score für ökologische Kontroversen

Soziales:

- Geschäftsethik, Bestechung und Korruption
 6. Umstrittene Waffen jeder Art
 7. Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstößen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften
- Datenschutz und -sicherheit
 8. - Kunden – Score für Datenschutz und Datensicherheit
 9. Kontroversen im Zusammenhang mit Verstößen gegen die Datensicherheit
- Arbeitspraktiken und Menschenrechtsschutz
 10. Einhaltung der Arbeitsgesetze - Allgemein
 11. Einhaltung von Menschenrechten
 12. Menschenrechte - Score für die Auswirkungen auf lokale Gemeinschaften
 13. - Kunden - Score für Produktqualität und Sicherheit
- Diversität, Gleichstellung und Integration
 14. Kontroversen im Zusammenhang mit Diskriminierung und Diversität

Jede der Aktieninvestitionen des Teilfonds wurde vor der ihrer Umstellung auf einen SFDR-Teilfonds gemäß Artikel 8 anhand der oben aufgeführten 14 Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Darüber hinaus werden sie außerdem vierteljährlich und am Ende des Bezugszeitraums sowie bei jedem Kauf eines neuen Unternehmens gemessen. Die Daten wurden mit hausintern festgelegten Schwellenwerten verglichen und es wurde, sobald ein Schwellenwert erreicht wurde, ein Warnsignal

ausgelöst, das eine Analyse erforderte. Dies würde dann wiederum den „Stock Champion“ (eines Mitglieds des für die Analyse der Aktiengesellschaft zuständigen Researchteams des Anlageverwalters) zu einem Kommentar oder eine Schlussfolgerung veranlassen und gegebenenfalls eine weitere Überprüfung durch die Additional Objectives Portfolios Group, ein internes Unternehmensführungsforum, erfordern.

Im Bezugszeitraum wurden infolge der Analysen gegenüber den vorstehend angegebenen Nachhaltigkeitsindikatoren keine Positionen abgestoßen.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Nachfolgend finden Sie Angaben zu allen Unternehmen, bei denen während des Bezugszeitraums ein oder mehrere neue Warnsignale angezeigt wurden, die als potenziell wesentliche Änderungen der Daten betrachtet wurden:

1. Unternehmen A

Bei einem Unternehmen gab es während des Bezugszeitraums ein oder mehrere neue Warnsignale, die als potenziell wesentliche Änderungen der Daten betrachtet wurden. Für diese Investition erstellte der Stock Champion eine Analyse der Informationen, die von der Additional Objectives Portfolios Group und dem Investment Executive geprüft wurden. Die Investition wurde weiterhin als geeignet für die Aufnahme in den Teilfonds erachtet.

Warum wurde im Rahmen des Umweltthemas „Umweltverschmutzung und Abfallmanagement“ ein Warnsignal ausgelöst?: Das Schweizer Konsumgüterunternehmen operiert in den Bereichen Ernährung, Gesundheit und Wellness und beschäftigt sich mit der Herstellung, dem Vertrieb und der Produktion von Fertiggerichten und Kochhilfen, Milchprodukten, Pharmazeutika und augenoptischen Produkten, Babynahrung und Cerealien.

Die Kritik von Nichtregierungsorganisationen (NRO) an zwei Themen hat bei diesem Unternehmen zu einer weiteren Analyse geführt: eine angebliche Verbindung zwischen der Palmölgewinnung und der Abholzung von Wäldern und der angebliche Beitrag zur weltweiten Plastikverschmutzung.

Analyse des Stock Champion:

Palmöl wird als Zutat in einer Reihe von Produkten des Unternehmens verwendet. Das Unternehmen gibt sich große Mühe, um die Nachhaltigkeit seiner Palmölbeschaffung zu verbessern. 96 % des im Jahr 2022 bezogenen Palmöls wird als „entwaldungsfrei“ eingestuft, und diese Zahl wird auf 100 % steigen.

Das Unternehmen hat sich verpflichtet, bis 2025 den Anteil an Neuplastik in seinen Verpackungen um ein Drittel zu reduzieren. Durch die Reduzierung unnötiger und die Entwicklung besserer Verpackungen für die Wiederverwendung sowie von Recyclingsystemen, der Gestaltung eines fairen Sammel Systems und der Unterstützung einer guten Regulierung will das Unternehmen den Übergang zu abfallfreien Deponien bzw. einer abfallfreien Natur unterstützen.

Die folgende Tabelle zeigt die prozentuale Gewichtung des Teilfonds, der in Unternehmen investiert ist, die zum Ende des Bezugszeitraums ein Warnsignal in Bezug auf jeden Nachhaltigkeitsindikator hatten.

Indikator Nr.	Beschreibung	% Gewichtung von markierten Unternehmen
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	Kohlenstoffintensität 1 & 2	3,5
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	Das Unternehmen hat Standorte in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität und ist in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Betriebsstätten, die in geschützten Gebieten oder angrenzend an geschützte Gebiete und Gebiete mit einer hohen Biodiversität außerhalb geschützter Gebiete liegen, gepachtet sind oder verwaltet werden	3,5
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe	2,3
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 5	Score für ökologische Kontroversen	1,9
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 6	Umstrittene Waffen jeder Art	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 7	Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstößen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften	4,1
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 8	Kunden – Score für Datenschutz & Datensicherheit	0,0

Indikator Nr.	Beschreibung	% Gewichtung von markierten Unternehmen
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 9	Kontroversen im Zusammenhang mit Verstößen gegen die Datensicherheit (Ja/Nein)	2,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 10	Einhaltung der Arbeitsgesetze – Allgemein	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 11	Einhaltung von Menschenrechten	2,3
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 12	Menschenrechte – Score für die Auswirkungen auf lokale Gemeinschaften	2,3
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 13	Kunden – Score für Produktqualität & Sicherheit	7,8
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 14	Kontroversen im Zusammenhang mit Diskriminierung und Diversität (Ja/Nein)	0,0

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Das soziale Ziel, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR beitrugen, waren die Ziele 1 („Keine Armut“) und 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung. Das Umweltziel, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR beitrugen, war Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung – „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“.

Eine nachhaltige Investition gemäß SFDR trug zu diesem Ziel bei, wenn mindestens 30 % der Umsätze auf die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet waren. Die fünf nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu den Zielen wie folgt bei:

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel

- Novo Nordisk: globales Pharmaunternehmen mit Hauptschwerpunkt auf Diabetes und Adipositas: 90 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- Recordati: ein globales, diversifiziertes biopharmazeutisches Unternehmen, das in den Segmenten „Specialty Care“ und „Primary Care“ sowie im Bereich der seltenen Krankheiten tätig ist. 46 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- Novartis: ein globales, diversifiziertes Pharmaunternehmen, das im Bereich innovativer Arzneimitteln tätig ist. 59 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- Roche: globales Pharma- und Diagnostikunternehmen, weltweit führend im Geschäftsfeld Onkologie: 44 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel

- Dassault Systemes: weltweit führender Produzent von 3D-Software für das Produktlebenszyklusmanagement: 35 % des Umsatzes sind auf Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“ ausgerichtet.

Es war nicht beabsichtigt, dass die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds, die die oben beschriebene Mindestumsatzschwelle erreichen, werden dann anhand einer Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) überprüft.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Die folgenden obligatorischen Indikatoren in Anhang I Tabelle 1 der technischen Regulierungsstandards für die SFDR („RTS“) und alle relevanten Indikatoren (nach Sektoren) in den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der RTS wurden im Bezugszeitraum folgendermaßen berücksichtigt:

– Relevante Indikatoren in Tabelle 1 von Anhang I der RTS:

1. Treibhausgasemissionen Scope 1, 2 und 3
3. Treibhausgasemissionen der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8. Emissionen in Wasser
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Der Teilfonds berücksichtigte alle in Anhang I Tabelle 1 der RTS enthaltenen obligatorischen Indikatoren mit Ausnahme von PAI 2, dem CO₂-Fußabdruck. Für die DNSH-Bewertung müssen die PAIs auf Unternehmensebene betrachtet werden. PAI 1 wurde für diese Analyse nicht als absolute Zahl herangezogen, sondern in ein Intensitätsmaß umgewandelt. Dies lag daran, dass die ursprüngliche PAI für die Betrachtung auf Portfolioebene und nicht für die Verwendung auf Unternehmensebene konzipiert ist, während die Analyse zur Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen auf Unternehmensebene erfolgen muss. PAI 2 wird nicht gesondert betrachtet, da PAI 2 nach der Umwandlung von PAI 1 in ein Intensitätsmaß lediglich die in PAI 1 und 3 enthaltenen Informationen wiederholen würde.

– Indikatoren in Tabelle 2 von Anhang I der RTS:

4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
8. Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress

– Indikatoren in Tabelle 3 von Anhang I der RTS:

4. Kein Verhaltenskodex für Lieferanten
6. Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
7. Fälle von Diskriminierung
9. Fehlende Menschenrechtspolitik
14. Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen
15. Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung

Die einzelnen Indikatoren wurden entweder einem Sektormedian oder einem absoluten Schwellenwert für alle Unternehmen gegenübergestellt, die den prozentualen Umsatzschwellenwert für die Einstufung als nachhaltige Investitionen gemäß der SFDR erfüllten.

Bei quantitativen Indikatoren wurde ein Warnsignal ausgelöst, sobald der festgelegte Schwellenwert für den Sektormedian überschritten wurde. In solchen Fällen wurden weitere Analysen durchgeführt, um festzustellen, ob die Investition keine erhebliche Beeinträchtigung verursachte und daher tatsächlich eine nachhaltige Anlage gemäß SFDR darstellte. Unter den fünf Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft wurden, wurden zum Ende des Bezugszeitraums 13 Warnsignale ausgelöst, von denen sich 11 auf Datenlücken bezogen.

Bei anderen Indikatoren wurde ein Warnsignal ausgelöst, sobald der Schwellenwert unterschritten wurde. In solchen Fällen wurden weitere Analysen durchgeführt, um festzustellen, ob die Investition keine erhebliche Beeinträchtigung verursachte und daher tatsächlich eine nachhaltige Anlage gemäß SFDR darstellte. Unter den fünf Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft wurden, wurden zum Ende des Bezugszeitraums sieben Warnsignale ausgelöst, von denen sich fünf auf Datenlücken bezogen.

Für alle (qualitativen und sonstigen) Indikatoren wurden, falls die Daten durch externe Datenanbieter des Anlageverwalters nicht verfügbar waren, vom Anlageverwalter Maßnahmen ergriffen, um die erforderlichen Informationen entweder zu beschaffen oder mit dem Unternehmen, in das investiert wurde, Kontakt aufzunehmen. Meldete das Unternehmen den Datenpunkt nicht, wurden ein Näherungswert oder alternative Kontextinformationen herangezogen.

In allen Fällen, in denen Warnsignale ausgelöst wurden, wurde nach weiterer Analyse festgestellt, dass kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Ziel erheblich beeinträchtigt wurde und dass die Unternehmen daher als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Die nachhaltige Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds werden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da keine Warnsignale in Bezug auf bestimmte Menschenrechte, Arbeitsbedingungen, Kontroversen und Einhaltung der Steuervorschriften, die entweder (i) direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder (ii) als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Entsprechend Artikel 7 der SFDR werden die nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Übereinstimmung mit der PAI-Regel für diesen Teilfonds unter dem Gesichtspunkt des Schadens berücksichtigt, den Anlagepositionen Nachhaltigkeitsfaktoren extern verursachen könnten. Der Teilfonds berücksichtigte 7 der in Anhang I Tabelle 1 der RTS enthaltenen Indikatoren auf Portfolioebene. Bei diesen handelte es sich um:

- PAI 2: CO₂-Fußabdruck
- PAI 3: Treibhausgasemissionen der Unternehmen, in die investiert wird
- PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
- PAI 10: Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
- PAI 13: Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat

- PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Auf Ebene des Gesamtportfolios wurden für jeden Indikator Schwellenwerte festgelegt. Der Ansatz zur „Berücksichtigung der PAIs“ bedeutet, dass der Anlageverwalter angemessene Schwellenwerte anwendet. Werden sie überschritten, so kann davon ausgegangen werden, dass der Teilfonds „wesentliche nachteilige Auswirkungen“ in Bezug auf eines der oben aufgeführten Kriterien hat. Der Teilfonds wurde diesen Schwellenwerten intern zu zwei Feststellungszeitpunkten gegenübergestellt. Keiner der Schwellenwerte wurde überschritten.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Novo Nordisk	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,1 %	Dänemark
Reply	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	2,5 %	Italien
ASML	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausüstung	2,4 %	Niederlande
Universal Music	Kommunikationsdienstleistungen - Medien und Unterhaltung	2,3 %	Niederlande
TotalEnergies	Energie - Energie	2,3 %	Frankreich
Carl Zeiss Meditec	Gesundheitswesen - Medizintechnik und -dienste	2,3 %	Deutschland
Atlas Copco	Industrie - Investitionsgüter	2,3 %	Schweden
VAT Group	Industrie - Investitionsgüter	2,3 %	Schweiz
Diploma	Industrie - Investitionsgüter	2,2 %	Vereinigtes Königreich
Recordati	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,2 %	Italien
Wolters Kluwer	Industrie - Gewerbliche und berufliche Dienstleistungen	2,2 %	Niederlande
Kuehne & Nagel	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,2 %	Schweiz
L'Oréal	Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2,1 %	Frankreich
Adidas	Nicht-Basiskonsumgüter - Gebrauchsgüter und Bekleidung	2,1 %	Deutschland
Amadeus IT Group	Nicht-Basiskonsumgüter - Verbraucher-dienstleistungen	2,0 %	Spanien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

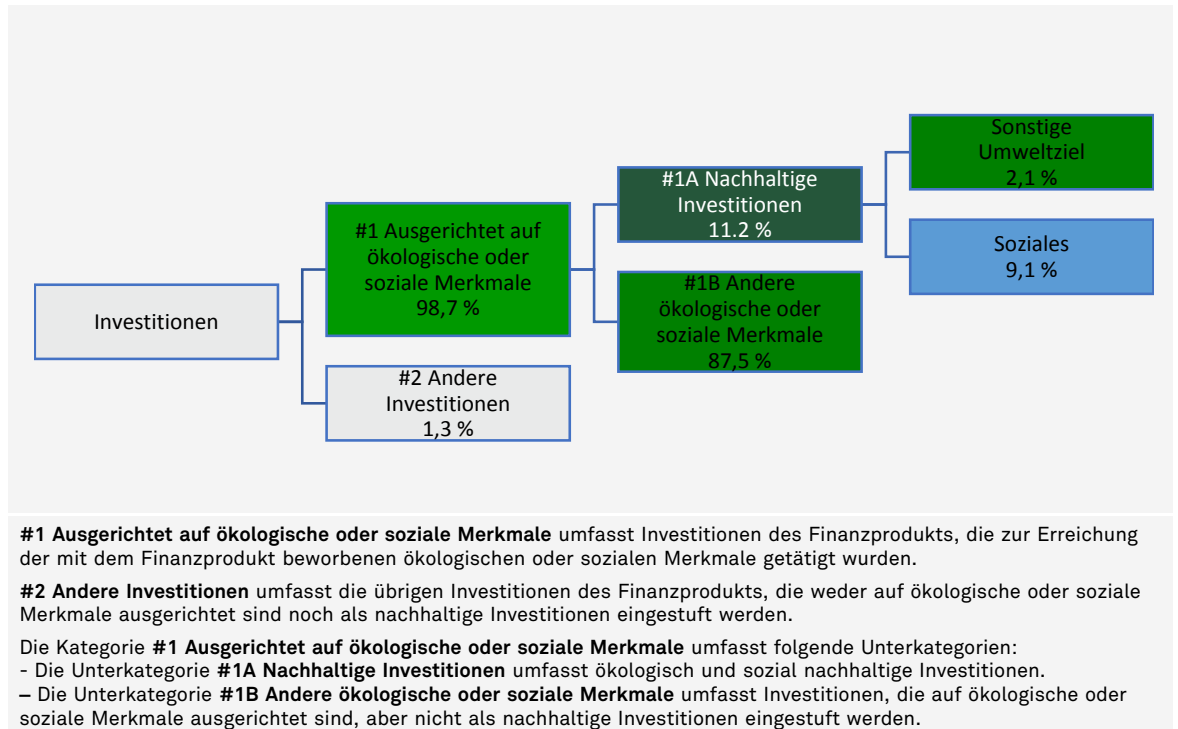
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 31. Dezember 2023 entsprach die Vermögensallokation des Teilfonds der Darstellung in der Grafik. Diese weicht von der Grafik zur Vermögensallokation in den vorvertraglichen Informationen (Anhang II) ab, denn das sollte lediglich die vorgesehene Vermögensallokation des Teilfonds illustrieren. Daraus gingen die im betreffenden Anhang erwähnten Mindestinvestitionen hervor.

Zum 31. Dezember 2023 waren 98,7 % des Nettoinventarwerts dieses Teilfonds in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere investiert, die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den „ESG-Kriterien“ des Anlageverwalters entsprachen. Der verbleibende Anteil am Teilfonds war in Barmittel investiert. Zur Klarstellung: Diese müssen die ESG-Kriterien nicht erfüllen.

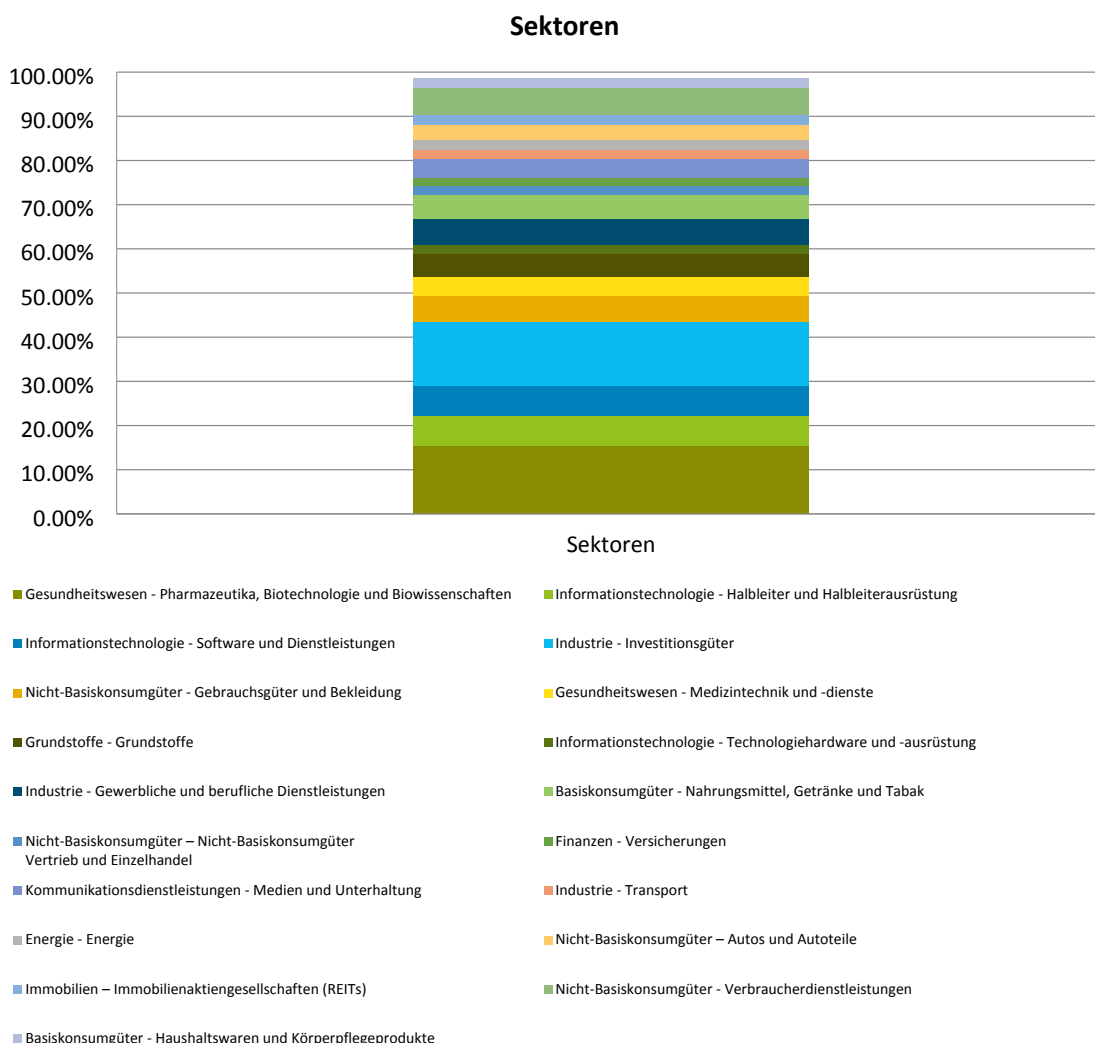
Der Teilfonds kam seiner Verpflichtung nach, mindestens 5 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR zu investieren, die zu einem Umweltziel oder sozialen Ziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 waren 11,2 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR investiert.

Die Vermögensallokation auf Umweltziele und soziale Ziele ist nicht festgeschrieben. Daher ist der Teilfonds nicht verpflichtet, einen Mindestprozentsatz des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR zu investieren, die spezifisch zu einem Umweltziel oder sozialen Ziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 waren 2,1 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert (ohne die Absicht, auf die EU-Taxonomie ausgerichtet zu sein) und 9,1 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 wurden die Investitionen des Teilfonds in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl es der Anlageverwalter nicht beabsichtigt, in Beteiligungen zu investieren, die an der EU-Taxonomie ausgerichtet sind, wurden die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel bis zu einem gewissen Grad an die EU-Taxonomie angepasst. 1,4 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds sind in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert. Zu Berichterstattungszwecken enthält die nachfolgende Tabelle eine Aufschlüsselung der Einnahmen, Betriebsausgaben und Investitionsausgaben des Unternehmens, die als mit der EU-Taxonomie konform gelten. Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

Unternehmen, die sich als nachhaltige Investitionen qualifizieren, müssen ein vom Anlageverwalter festgelegtes DNSH-Verfahren (Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen, „DNSH“) (unter Verwendung der obligatorischen und zusätzlichen PAI) durchlaufen sowie die zusätzlichen Mindestanforderungen an soziale Schutzmaßnahmen im Zusammenhang mit der Ausrichtung auf OECD/UNGP erfüllen. Ein Unternehmen qualifizierte sich als ein Beitrag zu einem Umweltziel (Dassault Systemes). In den Jahresberichten des Unternehmens wurden die laut der EU-Taxonomie zulässigen Zahlen verwendet und, wobei die Tatsache, dass Dassault das DNSH-Verfahren des Anlageverwalters durchlaufen hat, mit den Zahlen für die zulässigen

Einnahmen/OpEx/CapEx kombiniert. Diese Zahlen wurden mit der Gewichtung der Beteiligung innerhalb des Teilfonds multipliziert, um die an die EU-Taxonomie angepassten Gesamtwerte des Teilfonds zu erhalten.

Der Anlageverwalter war zum Teil auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Insbesondere die DNSH und die Bewertung der sozialen Schutzmaßnahmen stützte sich auf Daten externer Datenanbieter, so dass diese Bewertung den potenziellen Datenbeschränkungen unterlag, die im obigen Abschnitt über die negativen Auswirkungen beschrieben wurden. In Fällen, in denen die Daten begrenzt waren, führte der Anlageverwalter weitere Analysen durch (wie im obigen Abschnitt über nachhaltige Investitionen dargelegt), um potenzielle erhebliche Beeinträchtigungen und soziale Schutzmaßnahmen zu bewerten.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

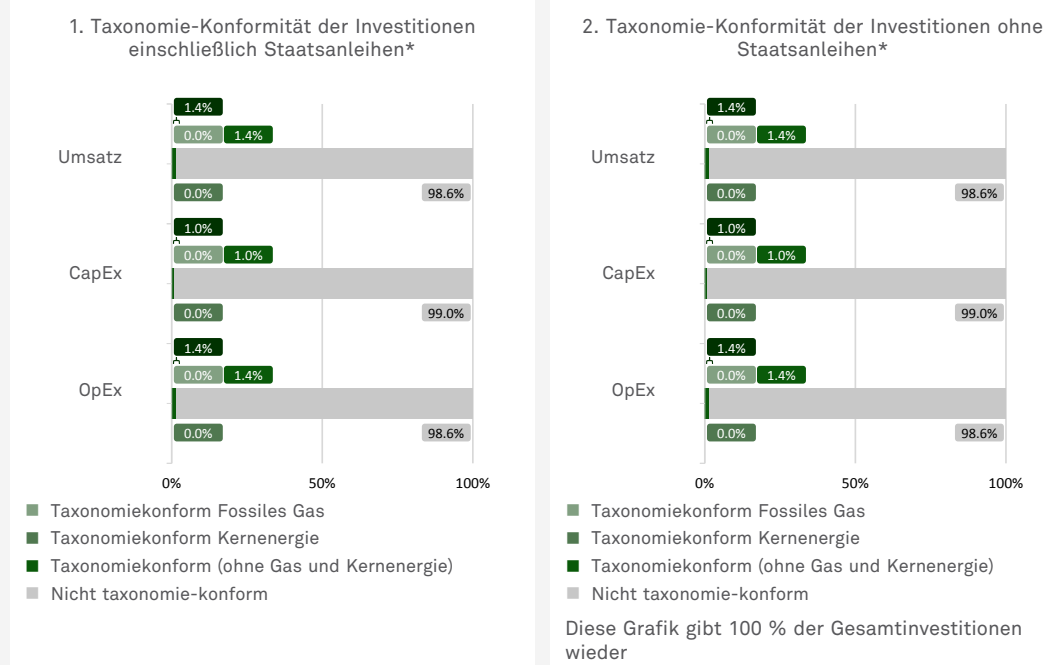
- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

34,2 % der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel waren nicht mit der EU-Taxonomie konform. Der Teilfonds ist in ein Unternehmen investiert, das als eine in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investition gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten gilt. Bei diesem Unternehmen beliefen sich die nach der EU-Taxonomie zulässigen Einnahmen auf 65,8 % (vom Anlageverwalter vollständig als an der EU-Taxonomie ausgerichtete Einnahmen angesehen), wie aus dem Jahresbericht des Unternehmens für das Jahr 2022 hervorgeht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte zum 31. Dezember 2023 aber 9,1 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31. Dezember 2023 hielt der Teilfonds 1,3 % des Nettoinventarwerts als zusätzliche Liquidität in Barmitteln. Es gibt keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz für diese Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Insgesamt wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Die Einhaltung des Anlageprozesses des Anlageverwalters in Bezug auf Titelauswahl und Portfolioaufbau.
- Jede potenzielle Anlageidee wurde einer umfassenden Bewertung unterzogen. Dabei wurden relevante und wesentliche Themen anhand eines einheitlichen Rahmens berücksichtigt – eine auf Wesentlichkeit basierende Bewertung von ESG-Faktoren.
- Die ESG-Datenpunkte und das Screening von Kontroversen stammten von dem externen Datenanbieter des Anlageverwalters.

- Überprüfung der Bewertung nachhaltiger Investitionen, der Leistungen von Nachhaltigkeitsindikatoren und die Bewertung gegenüber relevanten PAIs auf Portfolioebene durch ein internes Unternehmensführungsforum, die Additional Objectives Portfolios Group.
- Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden täglich über die Ausschlussliste überwacht. Die Einzelheiten zu der Ausschlussliste finden sich in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie des Teilfonds.
- Die für die dem Teilfonds zugrunde liegenden Vermögenswerte durchgeführte Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) umfasste die Prozesse von der Generierung einer potenziellen Anlageidee bis hin zum Portfolioaufbau. Die Additional Objectives Portfolios Group bewertete die potenziellen Anlageideen auf ihre Eignung zur Aufnahme in den Teilfonds und gibt dem Investment Executive eine Empfehlung. Der Investment Executive trägt die Gesamtverantwortung für die Zusammensetzung des Teilfonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund

Unternehmenskennung: 21380054NDC4BXEMBP84

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 11,0 % an nachhaltigen Investitionen. ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Bezugszeitraum für diesen regelmäßigen Bericht ist der Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

Im Bezugszeitraum bewarb dieser Teilfonds gute Umwelt-, Sozial- und Governance (ESG)-Praktiken oder -Merkmale, indem er bewusst Investitionen in Unternehmen vermied, deren ESG-Eigenschaften [wie vom Anlageverwalter definiert] unterhalb der Schwellenwerte lagen. Im Allgemeinen setzte sich das Portfolio des Teilfonds aus Unternehmen zusammen, die hohe Standards in Bezug auf ESG-Praktiken einhielten oder aufgrund ihrer fortschrittlichen ökologischen und sozialen Praxis attraktiv waren und eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Zu den berücksichtigten ökologischen und sozialen Eigenschaften gehörten die nachstehend aufgeführten Themen:

Umwelt

- Treibhausgasemissionen
- Biodiversität und natürliche Ressourcen
- Klima- und Übergangsrisiken
- Umweltverschmutzung und Abfallmanagement

Soziales

- Geschäftsethik, Bestechung und Korruption
- Datenschutz und -sicherheit
- Arbeitspraktiken und Menschenrechtsschutz
- Diversität, Gleichstellung und Integration

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Es war nicht beabsichtigt, dass die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds mit einem sozialen Ziel waren auf die Ziele 3 („Keine Armut“) und 1 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet. Die nachhaltige Investition des Teilfonds gemäß SFDR mit einem Umweltziel war auf Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet – „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Teilfonds zog 14 Datenpunkte in Bezug auf die nachstehend aufgeführten Themen als Nachhaltigkeitsindikatoren heran, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Umwelt:

- Treibhausgasemissionen:
 1. Kohlenstoffintensität 1 und 2
- Biodiversität und natürliche Ressourcen:
 2. Das Unternehmen hat Standorte in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität und ist in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt
 3. Betriebsstätten, die in geschützten Gebieten oder angrenzend an geschützte Gebiete und Gebiete mit einer hohen Biodiversität außerhalb geschützter Gebiete liegen, gepachtet sind oder verwaltet werden
- Klima- und Übergangsrisiken:
 4. Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe
- Umweltverschmutzung und Abfallmanagement:
 5. Score für ökologische Kontroversen

Soziales:

- Geschäftsethik, Bestechung und Korruption
 6. Umstrittene Waffen jeder Art
 7. Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstößen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften
- Datenschutz und -sicherheit
 8. - Kunden – Score für Datenschutz und Datensicherheit
 9. Kontroversen im Zusammenhang mit Verstößen gegen die Datensicherheit
- Arbeitspraktiken und Menschenrechtsschutz
 10. - Einhaltung der Arbeitsgesetze - Allgemein
 11. Einhaltung von Menschenrechten
 12. Menschenrechte - Score für die Auswirkungen auf lokale Gemeinschaften
 13. - Kunden - Score für Produktqualität und Sicherheit
- Diversität, Gleichstellung und Integration
 14. Kontroversen im Zusammenhang mit Diskriminierung und Diversität

Jede der Aktienanlagen des Teilfonds wurde vierteljährlich und am Ende des Bezugszeitraums sowie bei jedem Kauf eines neuen Unternehmens anhand der 14 oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Die Daten wurden mit hausintern festgelegten Schwellenwerten verglichen und es wurde, sobald ein Schwellenwert erreicht wurde, ein Warnsignal ausgelöst, das eine Analyse erforderte. Dies würde dann wiederum den „Stock Champion“ (eines

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Mitglieds des für die Analyse der Aktiengesellschaft zuständigen Researchteams des Anlageverwalters) zu einem Kommentar oder eine Schlussfolgerung veranlassen und gegebenenfalls eine weitere Überprüfung durch die Additional Objectives Portfolios Group, ein internes Unternehmensführungsforum, erfordern.

Im Bezugszeitraum wurden infolge der Analysen gegenüber den vorstehend angegebenen Nachhaltigkeitsindikatoren keine Positionen abgestoßen.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Nachfolgend finden Sie Angaben zu allen Unternehmen, bei denen während des Bezugszeitraums ein oder mehrere neue Warnsignale angezeigt wurden, die als potenziell wesentliche Änderungen der Daten betrachtet wurden:

1. Unternehmen A

Bei einem Unternehmen gab es während des Bezugszeitraums ein oder mehrere neue Warnsignale, die als potenziell wesentliche Änderungen der Daten betrachtet wurden. Für diese Investition erstellte der Stock Champion eine Analyse der Informationen, die von der Additional Objectives Portfolios Group und dem Investment Executive geprüft wurden. Die Investition wurde weiterhin als geeignet für die Aufnahme in den Teilfonds erachtet.

Warum wurde im Rahmen des Umweltthemas „Umweltverschmutzung und Abfallmanagement“ ein Warnsignal ausgelöst?: Das Schweizer Konsumgüterunternehmen operiert in den Bereichen Ernährung, Gesundheit und Wellness und beschäftigt sich mit der Herstellung, dem Vertrieb und der Produktion von Fertiggerichten und Kochhilfen, Milchprodukten, Pharmazeutika und augenoptischen Produkten, Babynahrung und Cerealien.

Die Kritik von Nichtregierungsorganisationen (NRO) an zwei Themen hat bei diesem Unternehmen zu einer weiteren Analyse geführt: eine angebliche Verbindung zwischen der Palmölgewinnung und der Abholzung von Wäldern und der angebliche Beitrag zur weltweiten Plastikverschmutzung.

Analyse des Stock Champion:

Palmöl wird als Zutat in einer Reihe von Produkten des Unternehmens verwendet. Das Unternehmen gibt sich große Mühe, um die Nachhaltigkeit seiner Palmölbeschaffung zu verbessern. 96 % des im Jahr 2022 bezogenen Palmöls wird als „entwaldungsfrei“ eingestuft, und diese Zahl wird auf 100 % steigen.

Das Unternehmen hat sich verpflichtet, bis 2025 den Anteil an Neuplastik in seinen Verpackungen um ein Drittel zu reduzieren. Durch die Reduzierung unnötiger und die Entwicklung besserer Verpackungen für die Wiederverwendung sowie von Recyclingsystemen, der Gestaltung eines fairen Sammel systems und der Unterstützung einer guten Regulierung will das Unternehmen den Übergang zu abfallfreien Deponien bzw. einer abfallfreien Natur unterstützen.

Die folgende Tabelle zeigt die prozentuale Gewichtung des Teilfonds, der in Unternehmen investiert ist, die zum Ende des Bezugszeitraums ein Warnsignal in Bezug auf jeden Nachhaltigkeitsindikator hatten.

Indikator Nr.	Beschreibung	% Gewichtung von markierten Unternehmen
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	Kohlenstoffintensität 1 & 2	2,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	Das Unternehmen hat Standorte in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität und ist in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Betriebsstätten, die in geschützten Gebieten oder angrenzend an geschützte Gebiete und Gebiete mit einer hohen Biodiversität außerhalb geschützter Gebiete liegen, gepachtet sind oder verwaltet werden	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe	6,9
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 5	Score für ökologische Kontroversen	1,8
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 6	Umstrittene Waffen jeder Art	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 7	Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstößen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften	5,8
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 8	Kunden – Score für Datenschutz & Datensicherheit	0,0
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 9	Kontroversen im Zusammenhang mit Verstößen gegen die Datensicherheit (Ja/Nein)	2,1

Indikator Nr.	Beschreibung	% Gewichtung von markierten Unternehmen
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 10	Einhaltung der Arbeitsgesetze – Allgemein	2,7
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 11	Einhaltung von Menschenrechten	2,7
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 12	Menschenrechte – Score für die Auswirkungen auf lokale Gemeinschaften	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 13	Kunden – Score für Produktqualität & Sicherheit	8,6
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 14	Kontroversen im Zusammenhang mit Diskriminierung und Diversität (Ja/Nein)	2,6

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator Nr.	Beschreibung	2022	2023
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Kohlenstoffintensität 1 & 2	4,9	2,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Das Unternehmen hat Standorte in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität und ist in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt	0,0	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Betriebsstätten, die in geschützten Gebieten oder angrenzend an geschützte Gebiete und Gebiete mit einer hohen Biodiversität außerhalb geschützter Gebiete liegen, gepachtet sind oder verwaltet werden	2,1	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe	6,4	6,9
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 5	Score für ökologische Kontroversen	0,5	1,8
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 6	Umstrittene Waffen jeder Art	0,0	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 7	Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstößen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften	5,6	5,8
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 8	Kunden – Score für Datenschutz & Datensicherheit	1,9	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 9	Kontroversen im Zusammenhang mit Verstößen gegen die Datensicherheit (Ja/Nein)	1,9	2,1
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 10	Einhaltung der Arbeitsgesetze – Allgemein	4,5	2,7
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 11	Einhaltung von Menschenrechten	4,5	2,7
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 12	Menschenrechte – Score für die Auswirkungen auf lokale Gemeinschaften	0,0	0,0
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 13	Kunden – Score für Produktqualität & Sicherheit	6,5	8,6
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 14	Kontroversen im Zusammenhang mit Diskriminierung und Diversität (Ja/Nein)	2,2	2,6

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR beitrugen, waren die Ziele 1 („Keine Armut“) und 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung. Das Umweltziel, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR beitrugen, war Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung – „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“.

Eine nachhaltige Investition gemäß SFDR trug zu diesem Ziel bei, wenn mindestens 30 % der Umsätze auf die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet waren. Die fünf nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu den Zielen wie folgt bei:

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel

- Novo Nordisk: globales Pharmaunternehmen mit Hauptschwerpunkt auf Diabetes und Adipositas: 90 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- Edwards Lifesciences: Marktführer für die Behandlung von Aortenstenose, einer schweren Erkrankung des Herzens, unter der weltweit Millionen Menschen leiden: 84 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- CSL: eines der größten Unternehmen in der globalen Branche der Blutplasmaprodukte, das auf die Therapie seltener, überwiegend chronischer Erkrankungen wie Immun- und Blutgerinnungsstörungen spezialisiert ist: 65 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.
- Roche: globales Pharma- und Diagnostikunternehmen, weltweit führend im Geschäftsfeld Onkologie: 44 % des Umsatzes sind auf die Ziele 1 („Keine Armut“) und Ziel 3 („Gesundheit und Wohlergehen“) der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel

- Dassault Systemes: weltweit führender Produzent von 3D-Software für das Produktlebenszyklusmanagement: 35 % des Umsatzes sind auf Ziel 12 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion“ ausgerichtet.

Es war nicht beabsichtigt, dass die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen beitragen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds, die die oben beschriebene Mindestumsatzschwelle erreichen, werden dann anhand einer Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) überprüft.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die folgenden obligatorischen Indikatoren in Anhang I Tabelle 1 der technischen Regulierungsstandards für die SFDR („RTS“) und alle relevanten Indikatoren (nach Sektoren) in den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der RTS wurden im Bezugszeitraum folgendermaßen berücksichtigt:

– Relevante Indikatoren in Tabelle 1 von Anhang I der RTS:

1. Treibhausgasemissionen Scope 1, 2 und 3
3. Treibhausgasemissionen der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8. Emissionen in Wasser
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Der Teilfonds berücksichtigte alle in Anhang I Tabelle 1 der RTS enthaltenen obligatorischen Indikatoren mit Ausnahme von PAI 2, dem CO₂-Fußabdruck. Für die DNSH-Bewertung müssen die PAIs auf Unternehmensebene betrachtet werden. PAI 1 wurde für diese Analyse nicht als absolute Zahl herangezogen, sondern in ein Intensitätsmaß umgewandelt. – Dies lag daran, dass die ursprüngliche PAI für die Betrachtung auf Portfolioebene und nicht für die Verwendung auf Unternehmensebene konzipiert ist, während die Analyse zur Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen auf Unternehmensebene erfolgen muss. PAI 2 wird nicht gesondert betrachtet, da PAI 2 nach der Umwandlung von PAI 1 in ein Intensitätsmaß lediglich die gleichen Informationen wiederholen würde, die von PAI 1 und 3 behandelt werden.

– Relevante Indikatoren in Tabelle 2 von Anhang I der RTS:

- 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- 8. Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress

– Indikatoren in Tabelle 3 von Anhang I der RTS:

- 4. Kein Verhaltenskodex für Lieferanten
- 6. Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
- 7. Fälle von Diskriminierung
- 9. Fehlende Menschenrechtspolitik

14. Anzahl der Fälle von schwerwiegenden Menschenrechtsverletzungen und sonstigen Vorfällen

15. Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung

Die einzelnen Indikatoren wurden entweder einem Sektormedian oder einem absoluten Schwellenwert für alle Unternehmen gegenübergestellt, die den prozentualen Umsatzschwellenwert für die Einstufung als nachhaltige Investitionen erfüllten.

Bei quantitativen Indikatoren wurde ein Warnsignal ausgelöst, sobald der festgelegte Schwellenwert für den Sektormedian überschritten wurde. In solchen Fällen wurden weitere Analysen durchgeführt, um festzustellen, ob die Investition keine erhebliche Beeinträchtigung verursachte und daher tatsächlich eine nachhaltige Anlage gemäß SFDR darstellte. Unter den fünf Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft wurden, wurden zum Ende des Bezugszeitraums 16 Warnsignale ausgelöst, die sich allesamt auf Datenlücken bezogen.

Bei anderen Indikatoren wurde ein Warnsignal ausgelöst, sobald der Schwellenwert unterschritten wurde. In solchen Fällen wurden weitere Analysen durchgeführt, um festzustellen, ob die Investition keine erhebliche Beeinträchtigung verursachte und daher tatsächlich eine nachhaltige Anlage gemäß SFDR darstellte. Unter den fünf Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft wurden, wurden zum Ende des Bezugszeitraums acht Warnsignale ausgelöst, von denen sich drei auf Datenlücken bezogen.

Für alle (qualitativen und sonstigen) Indikatoren wurden, falls die Daten durch externe Datenanbieter des Anlageverwalters nicht verfügbar waren, vom Anlageverwalter Maßnahmen ergriffen, um die erforderlichen Informationen entweder zu beschaffen oder mit dem Unternehmen, in das investiert wurde, Kontakt aufzunehmen. Meldete das Unternehmen den Datenpunkt nicht, wurden ein Näherungswert oder alternative Kontextinformationen herangezogen.

In allen Fällen, in denen Warnsignale ausgelöst wurden, wurde nach weiterer Analyse festgestellt, dass kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Ziel erheblich beeinträchtigt wurde und dass die Unternehmen daher als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Die nachhaltige Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds werden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da keine Warnsignale in Bezug auf bestimmte Menschenrechte, Arbeitsbedingungen, Kontroversen und Einhaltung der Steuervorschriften, die entweder (i) direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder (ii) als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Entsprechend Artikel 7 der SFDR werden die nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in Übereinstimmung mit der PAI-Regelung für diesen Teilfonds unter dem Gesichtspunkt des Schadens berücksichtigt, den Anlagepositionen Nachhaltigkeitsfaktoren extern verursachen könnten. Der Teilfonds berücksichtigte 7 der in Anhang I Tabelle 1 der RTS enthaltenen obligatorischen Indikatoren auf Portfolioebene. Bei diesen handelte es sich um:

- PAI 2: CO₂-Fußabdruck
- PAI 3: Treibhausgasemissionen der Unternehmen, in die investiert wird
- PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
- PAI 10: Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
- PAI 13: Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
- PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Auf Ebene des Gesamtportfolios wurden für jeden Indikator Schwellenwerte festgelegt. Der Ansatz zur „Berücksichtigung der PAIs“ bedeutet, dass der Anlageverwalter angemessene Schwellenwerte anwendet. Werden sie überschritten, so kann davon ausgegangen werden, dass der Teilfonds „wesentliche nachteilige Auswirkungen“ in Bezug auf eines der oben aufgeführten Kriterien hat. Der Teilfonds wurde hausintern vierteljährlich sowie bei jedem Kauf eines neuen Unternehmens anhand dieser Schwellenwerte überprüft. Beim Vergleich wurde keiner der Schwellenwerte überschritten.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corporation	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3,9 %	Vereinigte Staaten
Novo Nordisk	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,6 %	Dänemark
Adobe	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3,2 %	Vereinigte Staaten
Mastercard	Finanzwerte – Financial Services	2,7 %	Vereinigte Staaten
Alphabet	Kommunikationsdienstleistungen - Medien und Unterhaltung	2,6 %	Vereinigte Staaten
Costco Wholesale	Basiskonsumgüter – Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel	2,4 %	Vereinigte Staaten

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Intuitive Surgical	Gesundheitswesen - Medizintechnik und -dienste	2,4 %	Vereinigte Staaten
Alimentation Couche-Tard	Basiskonsumgüter – Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel	2,3 %	Kanada
L'Oréal	Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2,3 %	Frankreich
Inditex	Nicht-Basiskonsumgüter – Nicht-Basiskonsumgüter Vertrieb und Einzelhandel	2,2 %	Spanien
Canadian National Railway	Industrie - Transport	2,1 %	Kanada
LVMH	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,1 %	Frankreich
Waters Corporation	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,1 %	Vereinigte Staaten
Compass Group	Nicht-Basiskonsumgüter - Verbraucherdienstleistungen	2,1 %	Vereinigtes Königreich
CSL	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,0 %	Australien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

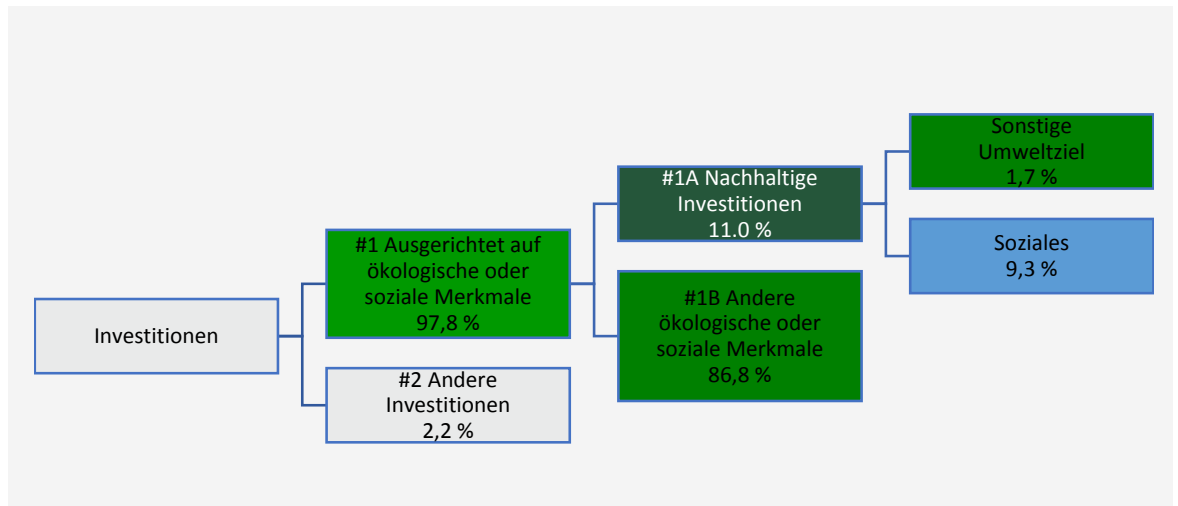
Zum 31. Dezember 2023 entsprach die Vermögensallokation des Teilfonds der Darstellung in der Grafik. Diese weicht von der Grafik zur Vermögensallokation in den vorvertraglichen Informationen (Anhang II) ab, denn das sollte lediglich die vorgesehene Vermögensallokation des Teilfonds illustrieren. Daraus gingen die im betreffenden Anhang erwähnten Mindestinvestitionen hervor.

Zum 31. Dezember 2023 waren 97,8 % des Nettoinventarwerts dieses Teilfonds in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere investiert, die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den „ESG-Kriterien“ des Anlageverwalters entsprachen. Der verbleibende Anteil am Teilfonds war in Barmittel investiert. Zur Klarstellung: Diese müssen die ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Der Teilfonds kam seiner Verpflichtung nach, mindestens 5 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR zu investieren, die zu einem Umweltziel oder sozialen Ziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 waren 11,0 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR investiert.

Die Vermögensallokation auf Umweltziele und soziale Ziele ist nicht festgeschrieben. Daher ist der Teilfonds nicht verpflichtet, einen Mindestprozentsatz des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR zu investieren, die spezifisch zu einem Umweltziel oder sozialen Ziel beitragen. Zum 31. Dezember 2023 waren 1,7 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert (ohne die Absicht, auf die EU-Taxonomie ausgerichtet zu sein) und 9,3 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

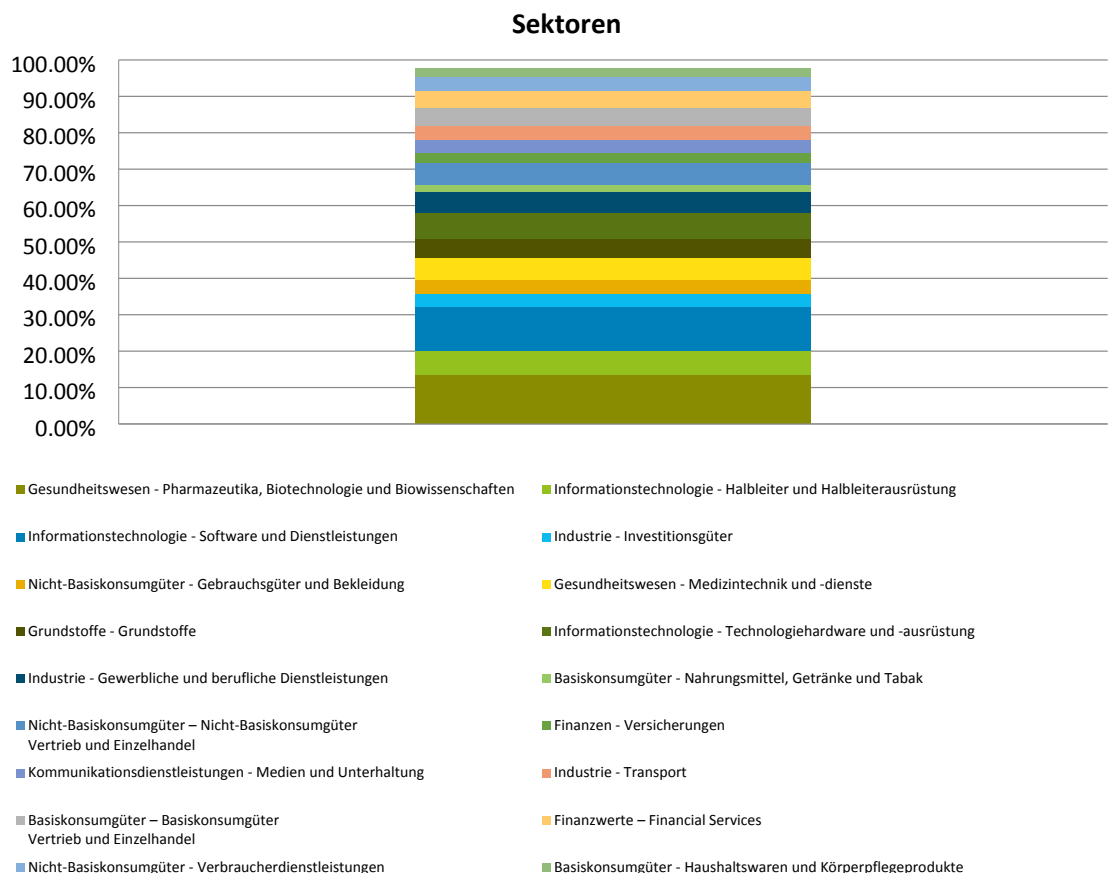
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 wurden die Investitionen des Teilfonds in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:





Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl es der Anlageverwalter nicht beabsichtigt, in Beteiligungen zu investieren, die an der EU-Taxonomie ausgerichtet sind, wurden die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel bis zu einem gewissen Grad an die EU-Taxonomie angepasst. 1,1 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds sind in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert. Zu Berichterstattungszwecken enthält die nachfolgende Tabelle eine Aufschlüsselung der Einnahmen, Betriebsausgaben und Investitionsausgaben des Unternehmens, die als mit der EU-Taxonomie konform gelten. Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

Unternehmen, die sich als nachhaltige Investitionen qualifizieren, müssen ein vom Anlageverwalter festgelegtes DNSH-Verfahren (Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen, „DNSH“) (unter Verwendung der obligatorischen und zusätzlichen PAI) durchlaufen sowie die zusätzlichen Mindestanforderungen an soziale Schutzmaßnahmen im Zusammenhang mit der Ausrichtung auf OECD/UNGP erfüllen. Ein Unternehmen qualifizierte sich als ein Beitrag zu einem Umweltziel (Dassault Systemes). In den Jahresberichten des Unternehmens wurden die laut der EU-Taxonomie zulässigen Zahlen verwendet und, wobei die Tatsache, dass Dassault das DNSH-Verfahren des Anlageverwalters durchlaufen hat und seinen sozialen Schutzmaßnahmen entspricht, mit den Zahlen für die zulässigen Einnahmen/OpEx/CapEx kombiniert. Diese Zahlen wurden mit der Gewichtung der Beteiligung innerhalb des Teilfonds multipliziert, um die an die EU-Taxonomie angepassten Gesamtwerte des Teilfonds zu erhalten.

Der Anlageverwalter war zum Teil auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Insbesondere die DNSH und die Bewertung der sozialen Schutzmaßnahmen stützte sich auf Daten externer Datenanbieter, so dass diese Bewertung den potenziellen Datenbeschränkungen unterlag, die im obigen Abschnitt über die negativen Auswirkungen beschrieben wurden. In Fällen, in denen die Daten begrenzt waren, führte der Anlageverwalter weitere Analysen durch (wie im obigen Abschnitt über nachteilige Auswirkungen dargelegt), um potenzielle erhebliche Beeinträchtigungen und soziale Schutzmaßnahmen zu bewerten.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

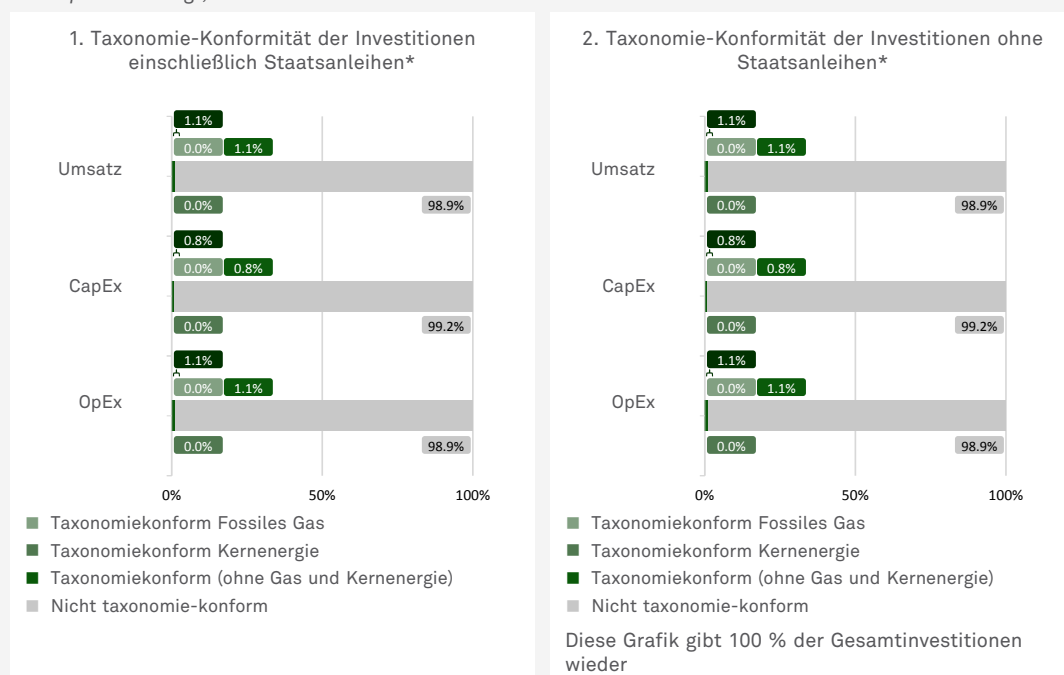
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxoniekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
0 %
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Prozentsatz der Investitionen, die als auf die EU-Taxonomie ausgerichtet angesehen werden, wurde für den regelmäßigen Bericht des Teilfonds für das Jahr 2022 nicht berechnet. Daher kann für diesen regelmäßigen Bericht kein vernünftiger Vergleich mit früheren Zeiträumen gezogen werden.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

34,2 % der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel waren nicht mit der EU-Taxonomie konform. Der Teilfonds ist in ein Unternehmen investiert, das als eine in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investition gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten gilt. Für dieses Unternehmen belief sich die jüngste Prozentsatzangabe der nach der EU-Taxonomie zulässigen Einnahmen zum Zeitpunkt der Erstellung dieser regelmäßigen Offenlegung auf 65,8 % (vom Anlageverwalter vollständig als an der EU-Taxonomie ausgerichtete Einnahmen angesehen), wie aus dem Jahresbericht des Unternehmens für das Jahr 2022 hervorgeht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht** berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte zum 31. Dezember 2023 aber 9,3 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31. Dezember 2023 hielt der Teilfonds 2,2 % des Nettoinventarwerts als zusätzliche Liquidität in Barmitteln. Es gibt keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz für diese Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Insgesamt wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Die Einhaltung des Anlageprozesses des Anlageverwalters in Bezug auf Titelauswahl und Portfolioaufbau.
- Jede potenzielle Anlageidee wurde einer umfassenden Bewertung unterzogen. Dabei wurden relevante und wesentliche Themen anhand eines einheitlichen Rahmens berücksichtigt – eine auf Wesentlichkeit basierende Bewertung von ESG-Faktoren.
- Die ESG-Datenpunkte und das Screening von Kontroversen stammten von dem externen Datenanbieter des Anlageverwalters.
- Überprüfung der Bewertung nachhaltiger Investitionen, der Leistungen von Nachhaltigkeitsindikatoren und die Bewertung gegenüber relevanten PAIs auf Portfolioebene durch ein internes Unternehmensführungsforum, die Additional Objectives Portfolios Group.
- Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden täglich über die Ausschlussliste überwacht. Die Einzelheiten zu der Ausschlussliste finden sich in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie des Teilfonds.
- Die für die dem Teilfonds zugrunde liegenden Vermögenswerte durchgeführte Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) umfasste die Prozesse von der Generierung einer potenziellen Anlageidee bis hin zum Portfolioaufbau. Die Additional Objectives Portfolios Group bewertete die potenziellen Anlageideen auf ihre Eignung zur Aufnahme in den Teilfonds und gibt dem Investment Executive eine Empfehlung. Der Investment Executive trägt die Gesamtverantwortung für die Zusammensetzung des Teilfonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Mobility Innovation Fund

Unternehmenskennung: 2138000BBVFZ8TN6N134

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nach-haltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswegen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 88,77 % an nachhaltigen Investitionen. ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

– Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.

– Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.

– Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.

– bessere Umweltergebnisse und andere gesellschaftliche Vorteile, die potenziell von Unternehmen erzielt werden, die sich auf Innovationen im Transportwesen und damit verbundene Technologien konzentrieren.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Elektrifizierung

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Verbesserte digitale Infrastruktur und Konnektivität, was sich auf den Verkehr und Verkehrssysteme auswirken kann
- Verbesserte Infrastruktur und Produkte, die zu mehr Fahrsicherheit beitragen
- Beitrag zu sozialen Zielen aufgrund der internen Geschäftspraktiken der Unternehmen, in die investiert wird, und dem erfolgreichen Umgang mit konkurrierenden Interessen wichtiger Stakeholder-Gruppen.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1 - Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2 - 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 - Alle Unternehmen, in die der Teilfonds investiert, müssen sich an dem CASE-Rahmen des Anlageverwalters ausrichten. Anhand dieses Rahmens wird ermittelt, welchem bzw. welchen der folgenden Themen ein Unternehmen zuzuordnen ist:

- Konnektivität: umfasst Unterthemen wie Cloud-Speicher und Hochgeschwindigkeitsmasten
- Autonome Fahrzeuge: umfasst Unterthemen wie fortschrittliche Fahrerassistenzsysteme und Autoteile der nächsten Generation
- Sharing: umfasst Unterthemen wie u. a. Ride-Hailing-Technologie
- Elektrifizierung: umfasst Unterthemen wie EV-Infrastruktur, intelligentes Stromnetz und Batterietechnologie

Ohne zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltene Instrumente stellte sich die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren folgendermaßen dar:

Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 - 98,59 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - 99 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 - 100 % des Teilfonds.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %

Mit Nachhaltigkeits-indikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Schwach – auf einer gewichteten Durchschnittsbasis wurde der Teilfonds von einem Drittanbieter von Daten als mit einem geringen Maß an nicht gemanagten ESG-Risiken behaftet eingestuft.
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungs-zwecken gehaltenen)

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 31. Dezember 2023	0 %	0 %	Schwach	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungs-zwecken gehaltenen)
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0 %	Mittel	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungs-zwecken gehaltenen)

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele der teilweise von dem Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sind vorstehend angeben.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen folgendermaßen zu den vorstehenden sozialen Zielen bei:

- Herstellung von Teilen, die in Anlagen eingesetzt werden, die zu mehr Fahrzeugsicherheit betragen oder diese ermöglichen
- Entwicklung von Produkten, die eine bessere und breiter vernetzte digitale Welt ermöglichen.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Elektrifizierung

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu Umweltzielen bei, die auf folgende Weise nicht mit der EU-Taxonomie konform sind:

- Elektrifizierung beziehungsweise die Ermöglichung von Batterien und Verkehr, was zur Emissionsverringerung beiträgt

Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt durch Effizienz, umweltfreundliche Technologien und verringerte Fahrzeugnutzung

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

Bei den **wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen** han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-faktoren in den Be-reich-en Um-welt, Sozia-les und Be-schäf-tigung, Achtung der Mensch-enrechte und Be-kämp-fung von Kor-rup-tion und Bestechung.

● *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich

den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Hauptinvestitionen (nach Gewichtung)	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ANSYS INC USD 0.01	SOFTWARE	4,23 %	USA
INFINEON TECHNOLOGIE EUR NPV	HALBLEITER	3,81 %	GER
ALBEMARLE CORP USD 0.01	CHEMIKALIEN	3,54 %	USA
APTIV PLC USD 0.01	AUTOTEILE & AUSTRÜSTUNG	3,04 %	USA
EATON CORP PLC USD 0.01	ELECTRICAL COMPONENTS & EQUIPMENT	2,72 %	USA
BYD CO LTD-H CNY 1	AUTOHERSTELLER	2,65 %	HKG
SUZUKI MOTOR CORP JPY NPV	AUTOHERSTELLER	2,58 %	JAP
MOBILEYE GLOBAL USD 0.01	AUTOTEILE & AUSTRÜSTUNG	2,45 %	USA

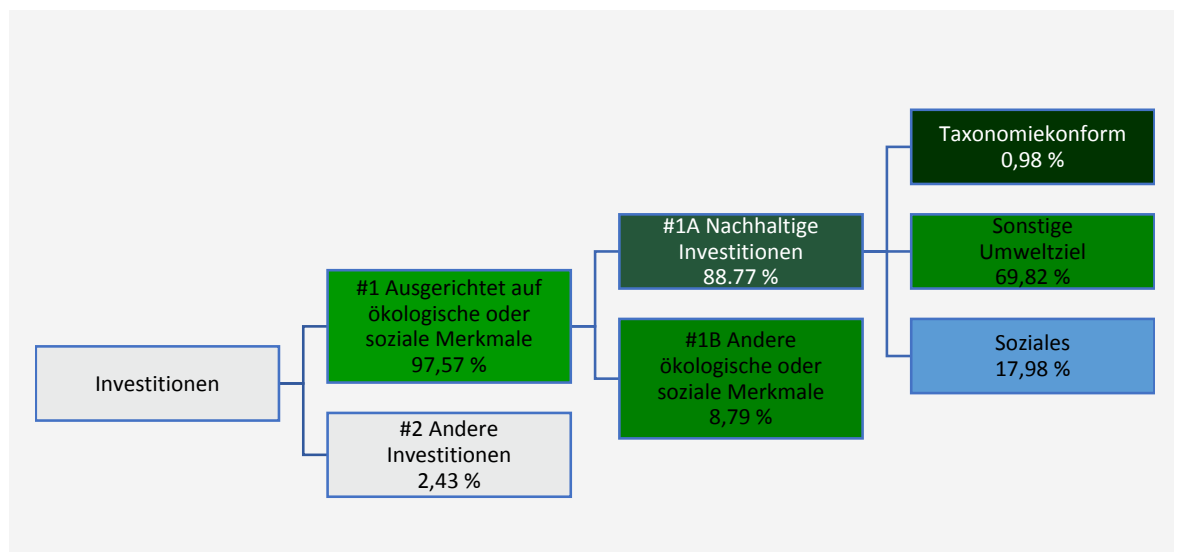
Hauptinvestitionen (nach Gewichtung)	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SCHNEIDER ELECTRIC EUR 4	ELECTRICAL COMPO&EQUIP	2,44 %	FRC
TRIMBLE INC USD 0.001	ELEKTRONIK	2,42 %	USA
SPLUNK INC USD 0.001	SOFTWARE	2,41 %	USA
VISTEON CORP USD NPV	AUTOTEILE & AUSRÜSTUNG	2,32 %	USA
MICHELIN (CGDE) EUR 0.50	AKTIEN	2,26 %	FRC
NVIDIA CORP USD 0.001	HALBLEITER	2,25 %	USA
CROWDSTRIKE HOLDI USD NPV	COMPUTER	2,24 %	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 97,57 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 88,77 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Davon hatten 69,82 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 17,98 % ein soziales Ziel. 0,98 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

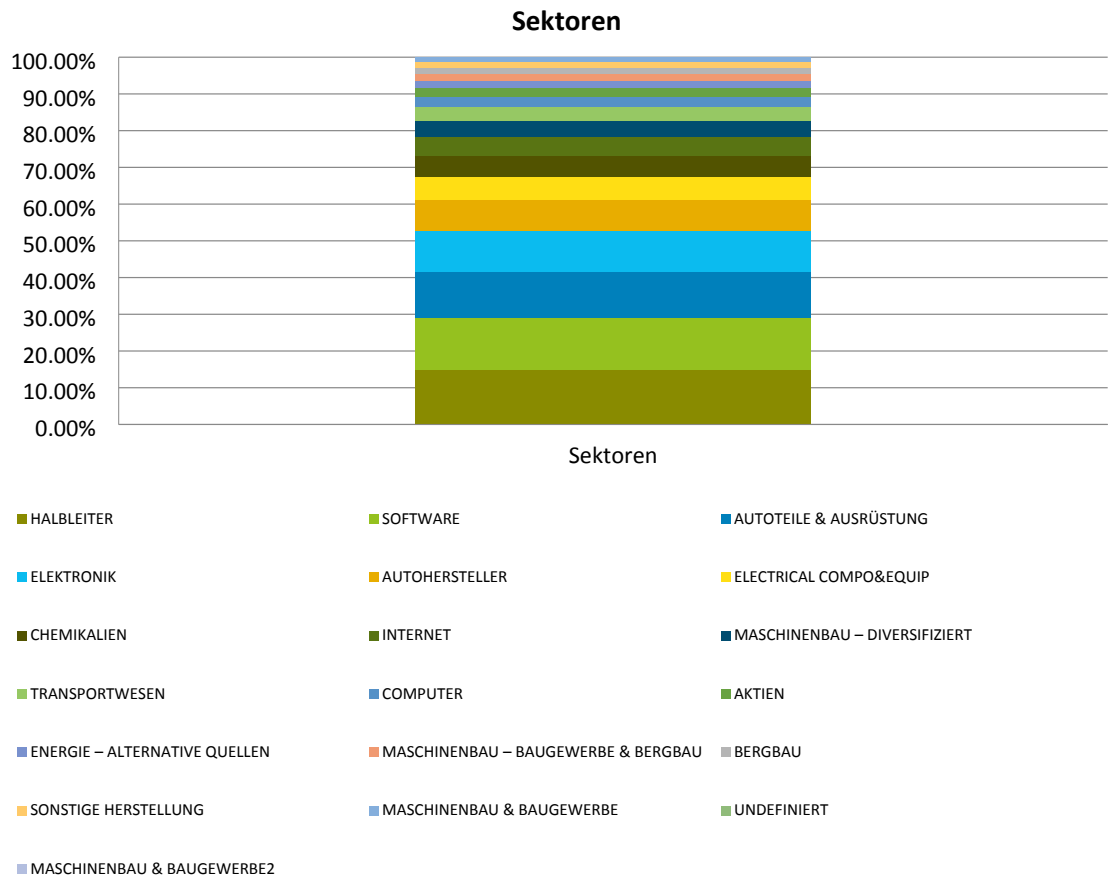
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

– Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,98 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

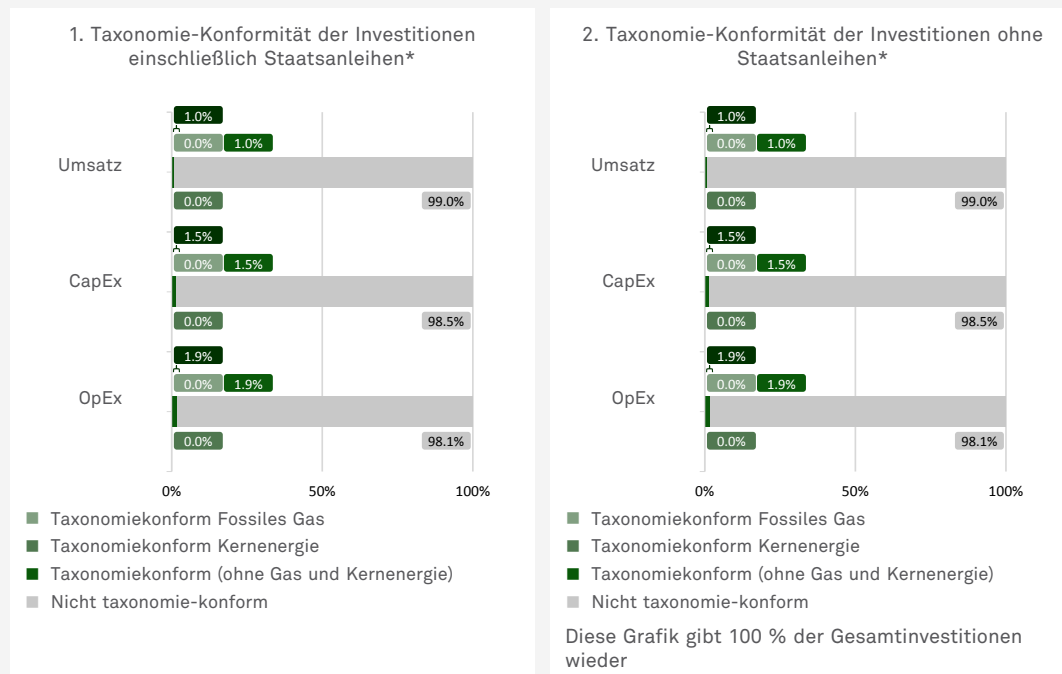
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissi-

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozensatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, stieg im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen geringfügig an. Dies war auf die bessere Verfügbarkeit von Daten zurückzuführen, die von den Unternehmen, in die investiert wird, gemeldet wurden, im Gegensatz zu der Verwendung geschätzter Daten externer Datenanbieter.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

onswerte aufweisen,
die den besten
Leistungen
entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 69,82 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



sind nachhaltige
Investitionen mit einem
Umweltziel, die die
Kriterien für ökologisch
nachhaltige Wirt-
schaftstätigkeiten
gemäß der Verordnung
(EU) 2020/852 nicht
berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 17,98 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 2,43 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

2,43 % in ausschließlich zu Liquiditätszwecken gehaltene Barmittel. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.
- Er investierte mindestens 80 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Mobility-Innovation-Unternehmen. Zu diesen Mobility-Innovation-Unternehmen zählen Automobilhersteller, Zulieferer und Technologieanbieter im Automobilbereich, die den Schwerpunkt auf Innovationen im Transportwesen mit

Bezug auf Verwendung, Kontrolle und Energie legen, wie beispielsweise verbesserte Fähigkeiten im Bereich Infrastruktur und Datenverarbeitung, Erzeugung sauberer Energie, Sicherheitsfragen fortgeschrittener Fahrerassistenzsysteme, sowie jene Unternehmen, die diese Innovationen im Bereich Mobilität nutzen oder möglich machen.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

Unternehmenskennung: 213800D07SNROTOSKR14

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☒ Ja	●○ ☐ Nein
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 0,00 % ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem sozialen Ziel
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 92,24 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 8. Dezember 2023 in folgendem Umfang erreicht.

Der Teilfonds strebt langfristiges Kapitalwachstum mit einem nachhaltigen Investitionsziel an. Insbesondere strebt der Teilfonds einen Beitrag zu einem sozialen Ziel an, indem er in Wertpapiere von Unternehmen weltweit investiert, welche die Angemessenheit und Effizienz der Gesundheitssysteme durch Innovationen in der Biotechnologie und im Gesundheitswesen verbessern.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zum nachhaltigen Investitionsziel bei, indem in Unternehmen investiert wurde, die die Angemessenheit und Effizienz der Gesundheitssysteme verbessern und dadurch langfristig eine hochwertige Gesundheitsversorgung ermöglichen, wie durch die Einhaltung bestimmter Schwellenwerte in Bezug auf den Prozentsatz ihrer Betriebsausgaben (OpEx) belegt, der für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen aufgewendet wurde, oder in bestimmten Fällen den Prozentsatz der OpEx, der für Investitionsausgaben (CapEx) aufgewendet wurde.

Insbesondere tragen die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Beschleunigte Entwicklung von Präzisionsarzneimitteln, Biologika und Impfstoffen gegen seltene und schwere Erkrankungen

- Früherkennung von Krankheiten
- Mehr Lebensqualität und Produktivität
- Besserer Zugang zu Gesundheitsversorgung
- Weniger bürokratische und finanzielle Belastung

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds erreicht wurde:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1: Sämtliche Unternehmen, in die investiert wird, müssen bestimmte Schwellenwerte erfüllen, d. h. in Bezug auf den Prozentsatz ihrer Betriebsausgaben (OpEx) (die täglichen Ausgaben eines Unternehmens zur Aufrechterhaltung seines Betriebs), die für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen aufgewendet werden, oder in bestimmten Fällen den Prozentsatz der OpEx, der für Investitionsausgaben (CapEx) aufgewendet wird (die Ausgaben eines Unternehmens, um durch Investitionen in langfristige Anlagegüter einen künftigen Nutzen zu schaffen).

Konkret:

- Klinische Vorreiter: Ausgaben von mindestens 30 % der OpEx für das Research und die Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten, was regelmäßig überprüft wird
- Supporting-Cast-Unternehmen: Ausgaben von mindestens 15 % der OpEx für das Research und die Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten, was regelmäßig überprüft wird, oder
- Supporting-Cast-Unternehmen, die das Research und die Entwicklung nicht als Kosten ausweisen: Sie müssen in den vorangegangenen 12 Monaten mindestens 5 % der OpEx für Investitionsausgaben ausgegeben haben, was regelmäßig überprüft wird

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2: Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen anlegen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3: 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4: Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 lag bei 100 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 97 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	100 % der Unternehmen, in die investiert wird (auf der Grundlage der im Teilfonds gehaltenen Unternehmen zum 31. Dezember 2022) hielten bestimmte Schwellenwerte in Bezug auf den Prozentsatz ihrer OpEx ein, die für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen verwendet werden oder in bestimmten Fällen den auf CapEx verwendeten OpEx-Prozentsatz. Konkret: - Klinische Vorreiter (Clinical Pioneers) Ausgaben von mindestens 30 % der OpEx für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten 76 % der im Teilfonds gehaltenen Unternehmen, die zum 31. Dez. 2022 diesen Schwellenwert einhielten - Unterstützende Akteure (Supporting Cast) Ausgaben von mindestens 15 % der OpEx für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten 17 % der im Teilfonds gehaltenen Unternehmen, die zum 31. Dez. 2022 diesen Schwellenwert einhielten - Supporting-Cast-Unternehmen, die Forschung und Entwicklung nicht als Aufwand erfassen Ausgaben von mindestens 5 % der OpEx für CapEx in den vorangegangenen 12 Monaten 7 % der im Teilfonds gehaltenen Unternehmen, die zum 31. Dez. 2022 diesen Schwellenwert einhielten
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	Mittel

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 8. Dezember 2023	100 %	0 %	0 %	Mittel
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	97 %	0 %	0 %	Mittel

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:

1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3

Bei den wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-faktoren in den Be-reich-en Um-welt, Sozia-les und Be-schäf-tigung, Achtung der Mensch-enrechte und Be-kämp-fung von Kor-rup-tion und Bestechung.

2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8. Emissionen in Wasser
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften

● ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des

Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbare erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbaren erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BIOMARIN PHARMA USD 0.001	BIOTECHNOLOGIE	7,1 %	USA
SAREPTA THERAP USD 0.0001	BIOTECHNOLOGIE	4,63 %	USA
CRINETICS PHARM USD 0.001	BIOTECHNOLOGIE	4,5 %	USA
ALNYLAM PHARMACE USD 0.01	BIOTECHNOLOGIE	4,3 %	USA
IMMUNOGEN INC USD 0.01	BIOTECHNOLOGIE	4,17 %	USA
LEGEND BIO USD 0.0001 ADR	BIOTECHNOLOGIE	4,01 %	USA
SANOFI-ADR USD NPV ADR	PHARMAUNTERNEHMEN	3,84 %	USA
ILLUMINA INC USD 0.01	BIOTECHNOLOGIE	3,65 %	USA
GILEAD SCIENCES USD 0.001	BIOTECHNOLOGIE	3,52 %	USA
REGENERON PHARM USD 0.001	BIOTECHNOLOGIE	3,5 %	USA
ULTRAGENYX PHAR USD 0.001	BIOTECHNOLOGIE	3,44 %	USA
PACIFIC BIOSCI USD 0.0001	GESUNDHEIT – PRODUKTE	3,39 %	USA
INSMED INC USD 0.01	BIOTECHNOLOGIE	3,39 %	USA
DANAHER CORP USD 0.01	GESUNDHEIT – PRODUKTE	3,36 %	USA
UCB SA EUR NPV	PHARMAUNTERNEHMEN	3,28 %	BEL



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

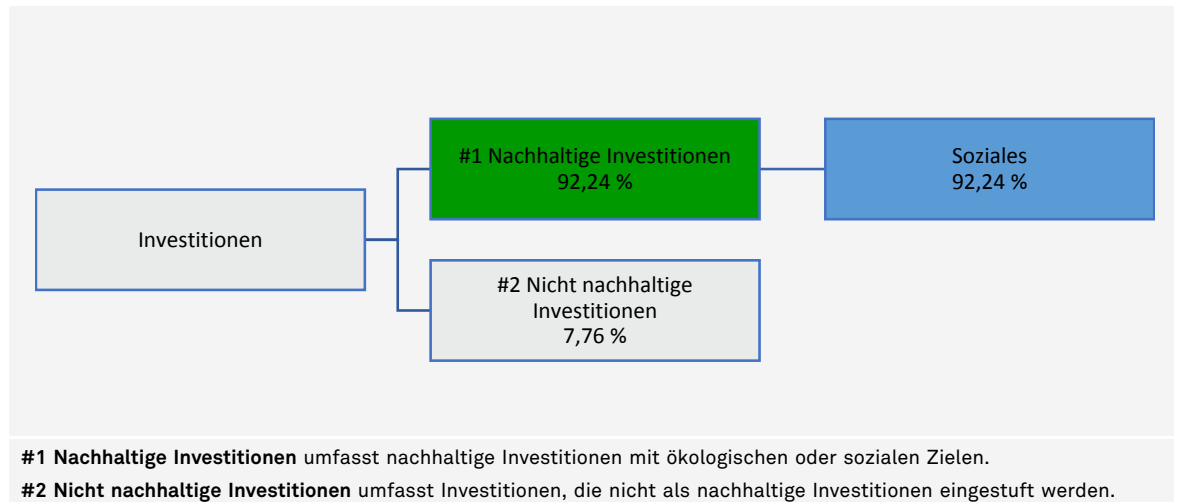
Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 92,24 % des Nettoinventarwerts waren in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel investiert. 0 % des Nettoinventarwerts waren in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert. 0 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.

#1 Nachhaltige Investitionen: 92,24 % des Nettoinventarwerts

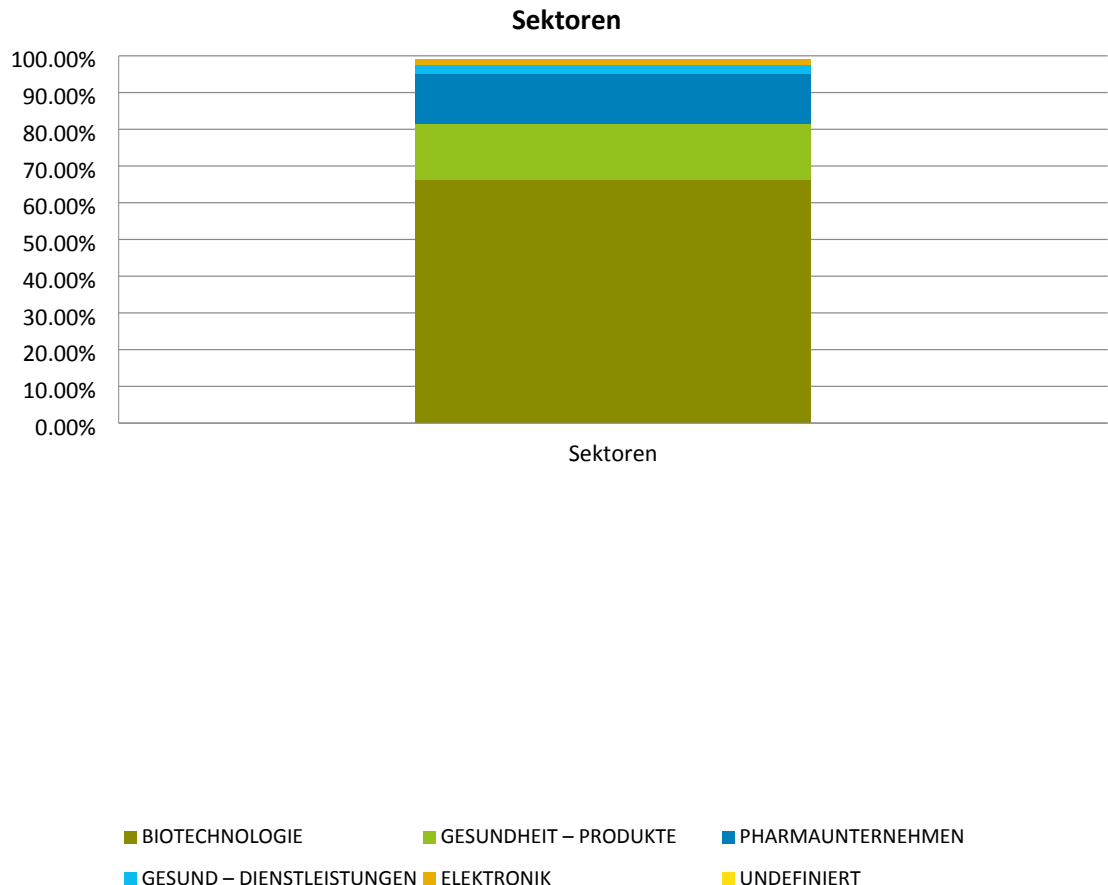
– Sonstige Umweltziele: 0 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 92,24 % des Nettoinventarwerts

#2 Nicht nachhaltige Investitionen: 7,76 % des Nettoinventarwerts



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 8. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

k. A.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In fossilem Gas

☒ Nein

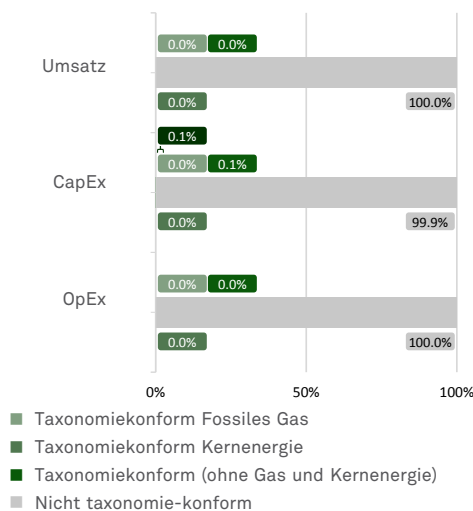
Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: – **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln – **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

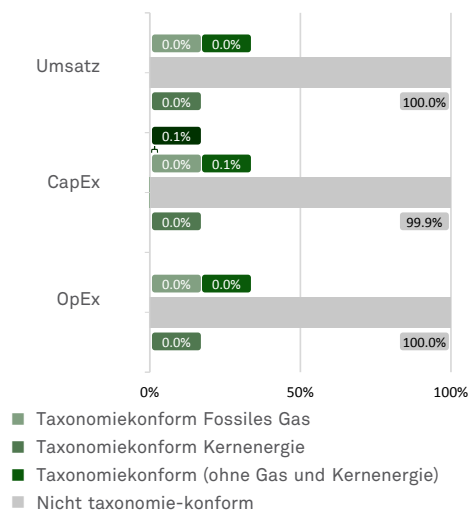
– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

0 %

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, blieb mit 0 % im Vergleich zu dem vorherigen Bezugszeitraum unverändert.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds investierte 92,24 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 7,76 % de Nettoinventarwerts in die Kategorie #2 (Nicht nachhaltige Investitionen), die die ausschließlich zu Liquiditätszwecken gehaltenen Instrumente umfasste, darunter Barmittel und Barmitteln gleichgestellte Mittel. Diese Instrumente wurden gehalten, um sicherzustellen, dass der Teilfonds über ausreichende Liquidität verfügte. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Um das nachhaltige Investitionsziel zu erreichen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.

- investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen, die zu sozialen Zielen beitragen, indem sie die Angemessenheit und Effizienz der Gesundheitssysteme durch Innovationen in der Biotechnologie und im Gesundheitswesen verbessern („Smart-Cures-Innovation-Unternehmen“)

Mitwirkung ist nicht Teil der sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds bestimmt.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

VERORD-
NUNG
ÜBER
NACH-
HALTIGK-
EITSBEZ-
OGENE
OFFEN-
LEGUNG-
SPFLICH-
TEN IM
FINANZ-
DIENST-
LEISTUN-
GSSEKT-
OR
(UNGEPRÜFT)

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Sustainable Global
Dynamic Bond Fund

Unternehmenskennung: 2138003QS1W6U007GI98

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nach-haltige Inves-ti-tion ist eine Inves-ti-tion in eine Wirt-schaftstätig-keit, die zur Erreichung eines Umwelt-ziels oder eines sozialen Ziels be-trägt, vor-aus-ge-setzt, dass diese Inves-ti-tion keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich be-ein-trächtigt und die Unter-nehmen, in die inves-tiert wird, Ver-fahrens-weisen einer guten Unter-nehmens-führung an-wen-den.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifi-kations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeichnis von ökologisch nach-haltigen Wirt-schafts-tätig-keiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Ver-zeichnis der sozial nach-haltigen Wirt-schaftstätig-keiten. Nach-haltige Investi-tionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 28,70 % an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ mit einem sozialen Ziel
	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen
ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

- Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.
- Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.
- Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.
- Anlagen in staatliche Emittenten, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.

Im Bezugszeitraum erfüllte der Teilfonds Merkmale im Zusammenhang mit der Investition in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen; der Investition in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen und Investitionen in staatliche Emittenten, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Kreislaufwirtschaft und Recycling

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Zugang zu Finanzprodukten und -dienstleistungen
- Konnektivität und digitaler Zugang
- Finanzielle Absicherung
- Zugang zu Wohnraum

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1 - Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2 - 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 - Alle Anlagen in staatlichen Emittenten müssen entweder eine starke aktuelle Positionierung aufweisen und/oder Fortschritte im Hinblick auf das Management von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren nachweisen, wie im Rahmen des vom Anlageverwalter entwickelten Nachhaltigkeitsrahmens für staatliche Emittenten ermittelt.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 100 % (nach Gewichtung) der Investitionen des Teilfonds in Unternehmensanleihen (ausgenommen staatliche Emittenten, FDI, Barmittel und Barmitteln gleichgestellter Mittel).

Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 33 % (nach Gewichtung) der Investitionen des Teilfonds.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 100 % (nach Gewichtung) der von dem Teilfonds gehaltenen staatlichen Emittenten.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Schwach – auf einer gewichteten Durchschnittsbasis wurde der Teilfonds von einem Drittanbieter von Daten als mit einem geringen Maß an nicht gemanagten ESG-Risiken behaftet eingestuft.
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	100 %

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 31. Dezember 2023	0 %	0 %	Schwach	100 %
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0,41 % Der Teilfonds hielt eine Position in einem Autounternehmen, das nach dem Kauf durch den externen Datenanbieter des Anlageverwalters als gegen die Grundsätze des UNGC verstoßend eingestuft wurde. Die Position wurde anschließend abgestoßen.	Schwach	100 %

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele der teilweise von dem Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sind vorstehend angeben.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen folgendermaßen zu den vorstehenden sozialen Zielen bei:

- Ermöglichung von Zugang zu Finanzprodukten, die zu finanzieller Sicherheit und finanziellem Wohlergehen beitragen
- Bereitstellung von sozialem Wohnraum an unterversorgte Bevölkerungsgruppen
- Bereitstellung von Technologielösungen für die Biowissenschaftsbranche, die die klinische Entwicklung von Behandlungsmöglichkeiten für seltene Erkrankungen ermöglichen und beschleunigen
- Förderung digitaler Infrastruktur in Schwellenländern

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Kreislaufwirtschaft und Recycling

Die nachhaltigen Investitionen trugen folgendermaßen zu diesen Umweltzielen bei:

- Förderung umweltfreundlicher Finanzinstrumente (grüner Hypotheken) und Nutzung von Instrumenten wie grüne Anleihen zur Weiterfinanzierung CO2-armer Anlagen

- Verbesserung der Wasserqualität und Eindämmung von Verschwendung
- Einrichtung von Strategien, Programmen und Zielen zur Verringerung von Emissionen und zur Eindämmung von Verschwendung im eigenen Betrieb
- Festlegung von Klimaneutralitätszielen, um durch ein verringertes Engagement in die Finanzierung fossiler Brennstoffe finanzierte Emissionen zu reduzieren
- Bereitstellung von Verpackungslösungen, die leichter recycelbare Alternativen zu Kunststoffen darstellen, sowie Abzielung auf 100 % Recyclingfähigkeit für alle Produkte
- Verringerung der THG-Emissionen und Umsetzung einer Klimawandelstrategie, um aus Chancen im CO₂-armen Transport Kapital zu schlagen

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen

Bei den **wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen** han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-faktoren in den Be-reich-en Um-welt, Sozia-les und Be-schäf-tigung, Achtung der Mensch-enrechte und Be-kämp-fung von Kor-rup-tion und Bestechung.

- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften. 19. Score für Meinungsfreiheit 23. Score für politische Stabilität 24. Score für Rechtsstaatlichkeit

● ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengekommen ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen. So wiesen beispielsweise Daten darauf hin, dass ein Unternehmen, in das investiert wurde, gegen die UNGC-Grundsätze verstieß (PAI Nr. 10), was zum Abzug von Kapital aus diesem Emittenten führte.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im

Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAls auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
US TR FRN 01/31/25	STAATSANLEIHEN	4,64 %	USA
US TS 2.625% 01/31/26	STAATSANLEIHEN	4,47 %	USA
US TS 1.125% 01/15/25	STAATSANLEIHEN	3,91 %	USA
US TSY 3% 11/15/45	STAATSANLEIHEN	2,82 %	USA
US TS 2.125% 02/15/41 IFL	STAATSANLEIHEN	2,74 %	USA
BRAZIL 0% 07/01/27	STAATSANLEIHEN	2,69 %	BRA
European FRN 03/05/24	MULTINATIONAL	2,54 %	LUX
N ZEAL 0.5% 05/15/24	STAATSANLEIHEN	2,09 %	NEZ
MEXICO 0% 10/03/24	STAATSANLEIHEN	2,07 %	MEX
UNITE 0.125% 03/22/26 IFL	STAATSANLEIHEN	2,02 %	UKK
US TSY 2% 02/15/50	STAATSANLEIHEN	1,96 %	USA
US TR FRN 10/31/23	STAATSANLEIHEN	1,96 %	USA
AUSTRA 2.75% 05/21/41	STAATSANLEIHEN	1,91 %	AST
US TS 0.125% 04/15/27 IFL	STAATSANLEIHEN	1,81 %	USA
MEXICO 8% 11/07/47	STAATSANLEIHEN	1,68 %	MEX



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 94,64 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 28,7 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Davon hatten 16,67 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 11,9 % ein soziales Ziel. 0 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale: 94,64 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 28,70 % des Nettoinventarwerts

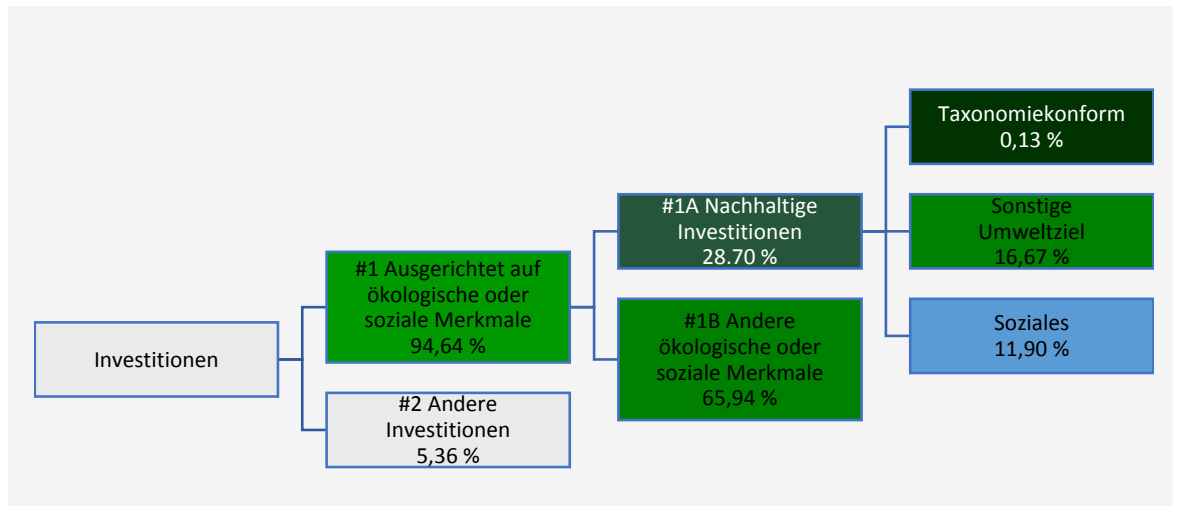
– Taxonomiekonform: 0,13 % des Nettoinventarwerts

– Umwelt: 16,67 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 11,90 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 65,94 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 5,36 % des Nettoinventarwerts



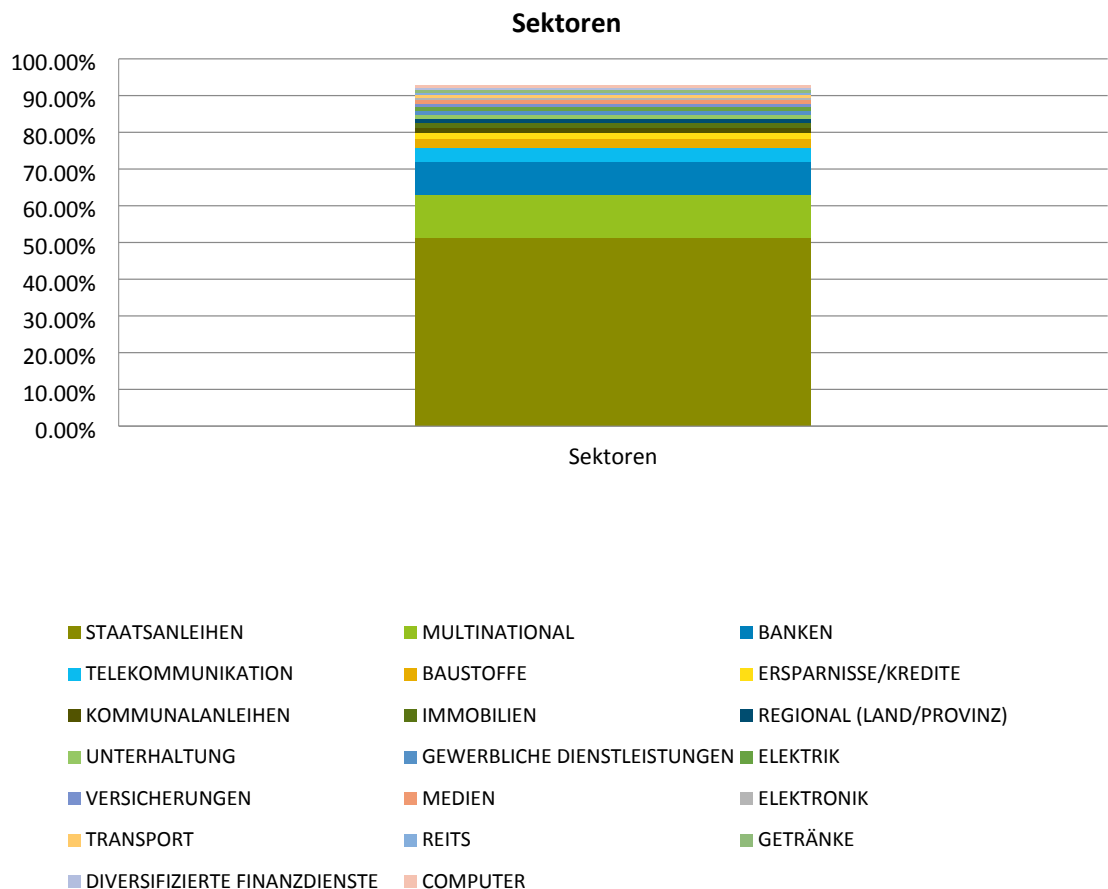
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,13 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

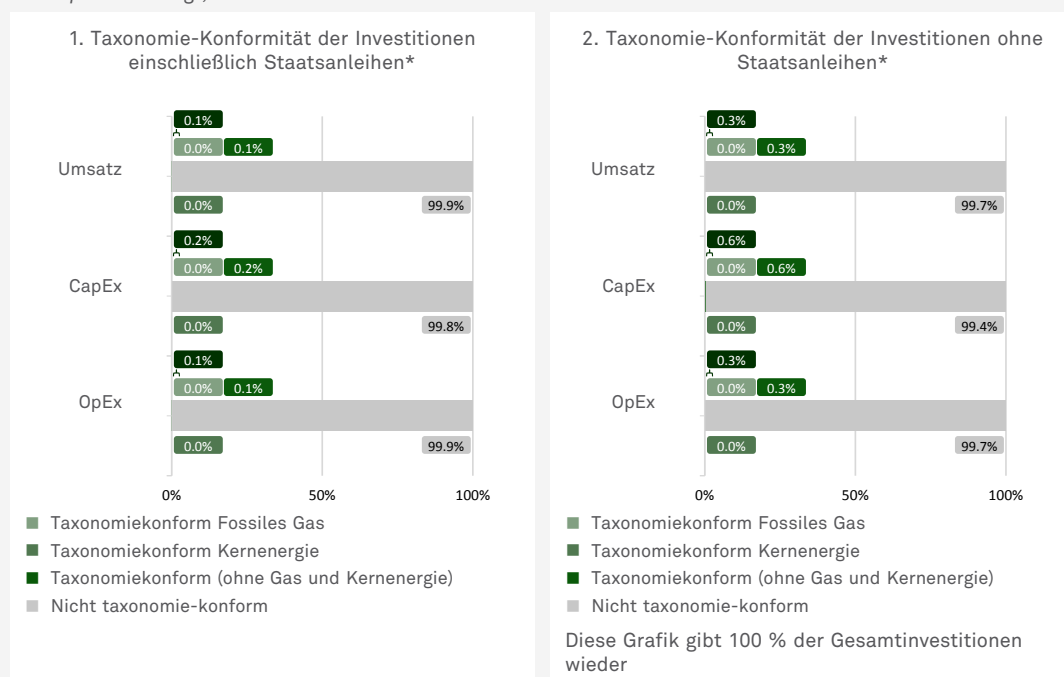
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
0 %
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, stieg im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen geringfügig an. Dies war auf die bessere Verfügbarkeit von Daten zurückzuführen, die von den Unternehmen gemeldet wurden, im Gegensatz zu der Verwendung geschätzter Daten externer Datenanbieter.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 16,67 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-Taxonomiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 11,9 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 5,36 % des Nettoinventarwerts in die Kategorie #2 („Andere Investitionen“), die nur aus FDI-, Liquiditäts- und Absicherungsinstrumenten besteht. Dazu gehören Barmittel, Barmitteln gleichgestellte Mittel, Währungspositionen, währungsbezogene FDI und der Absicherung dienende FDI. Diese Instrumente wurden entweder gehalten, um (a) sicherzustellen, dass der Teilfonds über ausreichende Liquidität verfügt, und/oder (b) zur Absicherung gegen potenzielle Wechselkursbewegungen. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 10 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält). Vom externen Datenanbieter des Anlageverwalters wurde festgestellt, dass ein im Teilfonds mit einer Gewichtung von 0,41 % gehaltener Emittenten neuerdings gegen die UNGC-Grundsätze verstieß. Daher ergriff der Anlageverwalter im Anschluss die Maßnahme, sein Kapital aus dem Emittenten abzuziehen, da dieser nicht mehr auf die ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters ausgerichtet war
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen

gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Sustainable Global
Emerging Markets Fund

Unternehmenskennung: 213800C4HLFO7W5C5209

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☒ Ja	●○ ☐ Nein
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 36,67 % ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 57,30 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem sozialen Ziel ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nach-haltige Inves-ti-tion** ist eine Inves-ti-tion in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umwelt-ziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vor-aus-ge-setzt, dass diese Inves-ti-tion keines dieser Ziele erheblich be-ein-trächtigt und die Unter-nehmen, in die inves-tiert wird, Ver-fahrens-weisen einer guten Unter-nehmens-führung an-wen-den.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifi-kations-system, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Ver-zeich-nis von **ökologisch nach-haltigen Wirt-schafts-tätig-keiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Ver-zeich-nis der sozial nach-haltigen Wirt-schaftstätig-keiten. Nach-haltige Investi-tionen mit einem Um-welt-ziel könnten taxonomie-konform sein oder nicht.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erreicht.

Der Teilfonds strebt langfristiges Kapitalwachstum mit einem nachhaltigen Investitionsziel an. Insbesondere zielt der Teilfonds darauf ab, zu sozialen Zielen und Umweltzielen durch Investitionen in Wertpapiere von Schwellenländerunternehmen beizutragen, die attraktive Anlageattribute aufweisen und eine nachhaltige Entwicklung fördern. Mit Ausnahme der zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen Instrumente investierte der Teilfonds im Verlauf des Bezugszeitraums ausschließlich in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zum nachhaltigen Investitionsziel bei, indem sie durch Beiträge zu den Zielen der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs) eine nachhaltige Entwicklung fördern.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

– SDG #7: Bezahlbare und saubere Energie

- SDG #9: Industrie, Innovation und Infrastruktur
- SDG #11: Nachhaltige Städte und Gemeinden
- SDG #13: Klimaschutzmaßnahmen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- SDG #2: Kein Hunger
- SDG #3: Gesundheit und Wohlergehen
- SDG #4: Hochwertige Bildung
- SDG #5: Geschlechtergleichheit
- SDG #6: Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- SDG #7: Bezahlbare und saubere Energie
- SDG #8: Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- SDG #9: Industrie, Innovation und Infrastruktur
- SDG #10: Weniger Ungleichheiten
- SDG #11: Nachhaltige Städte und Gemeinden
- SDG #12: Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds erreicht wurde:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1: Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen anlegen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2: 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3: Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4: Alle Anlagen müssen nachweislich auf eines oder mehrere der UN SDGs ausgerichtet sein, wie durch qualitative Fallstudien belegt.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 100 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der für FDI und zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 98 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der für FDI und zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 100 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der für FDI und zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Mittel
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	100 % der Unternehmen waren auf eines oder mehrere der UN SDGs ausgerichtet, wie durch eine Stichprobe qualitativer Fallstudien für die fünf Top-Positionen am Ende des Bezugszeitraums belegt, die diesem Dokument beigelegt ist.

Qualitative Fallstudien – Nachweis der Ausrichtung der fünf Top-Positionen (nach Gewichtung) des Fonds auf die Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung zum 31. Dezember 2023.

1. HDFC Bank Holding Limited, 5,85 % Gewichtung im Fonds. Ausgerichtet auf Ziel 8 der SDG – Förderung von dauerhaftem inklusivem und nachhaltigem Wirtschaftswachstum, produktiver Vollbeschäftigung und menschenwürdiger Arbeit für alle. HDFC Bank ist die größte Privatbank (nach der Bilanzsumme) in Indien und bietet eine umfassende Palette von Finanzprodukten und -dienstleistungen für einen breit gefächerten Kundenstamm. Ihre unvergleichliche Reichweite in Verbindung mit ihren digitalen Fähigkeiten ermöglicht es der Bank, die sich entwickelnden Bedürfnisse ihrer Kunden im ganzen Land zu erfüllen. HDFC Bank verfügt über ein robustes Vertriebsnetz, zu dem Bankstellen, Geldautomaten, Bareinzahlungs- und -abhebungsautomaten (CDMs) sowie Händler gehören. Die Bankstellen umfassen Zweigstellen und Bankvertreter (Business Correspondents, „BCs“) an festen Standorten. HDFC Bank verfügt über insgesamt 21.360 Bankstellen, von denen sich 11.720 in ländlichen Gebieten befinden. Von den insgesamt 5.608 Bankfilialen befinden sich 1.053 in ländlichen Gebieten.
2. Taiwan Semiconductor Manufacturing Co, 5,72 % Gewichtung im Fonds. Ausgerichtet auf:
 - a. SDG 7 – Sicherstellung von Zugang zu bezahlbarer, zuverlässiger, nachhaltiger und moderner Energie für alle. TSMC ist führend bei hochleistungsfähigen, energiesparenden Halbleitertechnologien, die es Kunden ermöglichen, energieeffiziente Produkte zu liefern. Berechnungen anhand des Modells des Industry, Science, and Technology International Strategy Centre ergaben, dass TSMC der Welt 2020 zu Energieeinsparungen von 4kWh je 1kWh in der Produktion verbrauchter Energie verholfen hat. Die Halbleiter von TSMC werden in Anwendungen neuer Technologien realisiert und unterstützen die Zunahme globaler, inklusiver Zuwächse bei intelligenter Fertigung, intelligenter Energie und intelligenten Gebäuden.
 - b. SDG 4 – Sicherstellung inklusiver und gleichberechtigter hochwertiger Ausbildung und Förderung von Chancen für lebenslanges Lernen für alle. In Zusammenarbeit mit führenden Universitäten aus Taiwan und eigens dafür aufgelegten Forschungsfonds hat TSMC Forschungszentren eingerichtet, um für Universitätsprofessoren Anreize für bahnbrechende Projekte in der Halbleiterforschung zu schaffen. Die Forschungszentren arbeiten engagiert an der Entwicklung modernster Technologien für Halbleiterbauteile, Werkstoffwissenschaft, Produktionsprozesse und IC-Design. TSMC arbeitet ferner mit Universitäten in Taiwan und anderen Ländern zusammen, um gemeinschaftliche Entwicklungsprojekte in einem breiten Spektrum von Technologiebereichen zu fördern. Die jährlichen Forschungsmittel übersteigen 338 Mio. NT\$. Es wurden über 157 US-Patente angemeldet.
 - c. SDG 9 – Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung und Innovationsförderung. C ist das erste Unternehmen, das automatisierte Fertigung umsetzt. Das Unternehmen wendet KI auf die Plattform für Big Data und maschinelles Lernen für die Wafer-Herstellung an, um ein intelligentes Produktionsumfeld zu schaffen, das über Selbstdiagnose- und Selbst-Feedback-Kapazitäten verfügt. Als Reaktion auf den immer diversifizierteren und wachsenden Bedarf an hochwertigen Chips in initiierte TSMC eine umfassende digitale Transformation. Digitalisierte Fertigungsstätten werden in Betrieb genommen, um den Fertigungsprozess zu transformieren. Mit automatisierter Datenerfassung, Systemassistentz und KI-Beurteilung hat sich die Prozesseffizienz pro Charge um 30 bis 40 % gesteigert. Um die intelligente Fertigung zu beschleunigen, hat TSMC auch ein KI-System zur Qualitätskontrolle für Wafer-Fertigungsstätten aufgebaut, um die Produktionsqualität zu sichern, Benchmarking zwischen verschiedenen Fertigungsstätten zu ermöglichen und die Technologietransferkapazität zu steigern.
 - d. SDG 12 –Gewährleistung nachhaltiger Konsum- und Produktionsmuster. Eine zentrale Mission von TSMC ist es, Rohstoffe verantwortungsbewusst einzukaufen, indem Zulieferer zu Fortschritten in folgender Hinsicht angehalten werden: Technologie, Qualität, Lieferung, Umweltschutz, Menschenrechte, Sicherheit und Gesundheit. Alle Tier-1-Zulieferer haben den TSMC Supplier Code of Conduct unterzeichnet, und TSMC stellt sicher, dass insgesamt 145 lokale Rohstoffzulieferer Unterstützung zur Prozessoptimierung und Qualitätssteigerung erhalten. TSMC strebt außerdem eine Abfallverminderung unter lokalen Zulieferern um 35 % gegenüber dem Stand von 2014 an.

3. Bank Rakyat Indonesia, 4,35 % Gewichtung im Fonds. Ausgerichtet auf Ziel 8 der SDG – Förderung von dauerhaftem inklusivem und nachhaltigem Wirtschaftswachstum, produktiver Vollbeschäftigung und menschenwürdiger Arbeit für alle. Die BRI fördert weiterhin finanzielle Inklusion, die es Bürgern ermöglicht, über ihren BRILink Agent Zugang zu Bankdienstleistungen zu erhalten, mit insgesamt 504.233 Agents in über 54.000 Gemeinden beziehungsweise mehr als 70 % aller Gemeinden Indonesiens. Das Geschäftsvolumen von BRILink erreichte 2020 728 Millionen Transaktionen im Gesamtwert von 843 Bio. Rp. Im Jahr 2020 finanzierte BRI Mikrofinanzierungen für mehr als 7,5 Millionen Schuldner mit einem Gesamtvolumen von 351,1 Billionen Rp für das Mikrosegment. KUR Super Mikro – Sonderfinanzierungsfazilität für neue Kunden, die noch nie einen Kredit beantragt haben, und die sich an Arbeitnehmer richtet, die von der Beendigung ihres Arbeitsverhältnisses betroffen sind, oder für Hausfrauen, die ein produktives Unternehmen betreiben. Die maximale Kreditlaufzeit beläuft sich auf 3 Jahre. Um den Bedarf an Produkten und Bankdienstleistungen für Kleinunternehmen zu decken, unterhält BRI ein Netz von 7.385 Bankstellen (Stand: 2020) für die Kunden in diesem Mikrosegment.
4. WEG SA, Gewichtung von 3,50 % im Fonds. Ausgerichtet auf:
 - a. SDG 4 – Sicherstellung inklusiver und gleichberechtigter hochwertiger Ausbildung und Förderung von Chancen für lebenslanges Lernen für alle. Seit 2010 bietet WEG Beschäftigten in der Region Jaragua do Sul die Möglichkeit, sich im Rahmen des Youth-and-Adult-Programms (YAE) kostenlos weiterzubilden. Das Programm ist auf junge Menschen und Erwachsene abgestellt, die ihre schulische Ausbildung nicht beenden konnten. Das Programm wird in Partnerschaft mit dem SESI (Social Service for Industry) durchgeführt. 2020 hatten sich bereits 555 Beschäftigte über dieses Programm qualifiziert. WEG verfügt ferner über ein Ausbildungsprogramm, das 16- bis 18-Jährigen Zugang zu einem Spektrum von Kursen bietet wie Mechatronik, Elektronik und Chemie. Jährlich gehen daraus 150 Fachkräfte hervor. Seit seiner Auflegung haben über 4.000 junge Menschen Kurse belegt und 48 % dieser jungen Menschen sind bis heute bei dem Unternehmen beschäftigt.
 - b. SDG 9 – Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung und Innovationsförderung. Gemäß einem gemischten Innovationsmodell (offen und geschlossen) hat der Forschungs-, Entwicklungs- und Innovationsbereich von WEG (RD&I, Research, Development and Innovation) 2020 einen wesentlichen Beitrag zur Entwicklung neuer Technologien und deren Wachstum geleistet. Ihr WEG Innovation Index (Prozentsatz des Gesamtumsatzes mit Produkten, die in den letzten 5 Jahren auf den Markt gebracht wurden) liegt bei 50,7 %, und verfügt über 108 Forschungs-/Testlabors weltweit. Im Jahr 2020 entwickelte WEG eine Online-Registrierungsplattform in einem kontinuierlich arbeitenden Durchflusssystem für Start-ups, die sich für Problemlösungen im Zusammenhang mit ihren Bedürfnissen interessieren. Über 340 Start-ups meldeten sich für die Initiativen von WEG mit dem Ziel der offenen Innovation zu Themen wie Überwachung, KI, Digitalisierung und technische Werkstoffe an.
 - c. SDG 7 – Sicherstellung von Zugang zu bezahlbarer, zuverlässiger, nachhaltiger und moderner Energie für alle. WEG strebt fortlaufend die Entwicklung seiner Linie von Elektromotoren und Frequenzumrichtern für Elektroantriebe an. Die Lösungen von WEG für elektrisches Fahren tragen zu leichteren, effizienteren Fahrzeugen bei und kombinieren Effizienz und Qualität für verschiedene Anwendungen. Da es sich bei WEG um einen der größten Hersteller von elektrischen Maschinen und Automationstechnologie für Industrie- und Energieanlagen handelt, ist das Unternehmen mit der Einführung seiner Ladestationen für Elektrofahrzeuge bereit für den Markt für Elektromobilität. Für WEG ist technische Innovation vor allem die Entwicklung neuer Technologien, Produkte und Werkstoffe mit dem Ziel, Kosten zu verringern, die Effizienz zu steigern, die Qualität zu verbessern und den Rohstoffeinsatz in Produkten zu senken. 2020 lieferte WEG 10 WEMOB-Ladestationen aus, die eine Kapazität von bis zu 22kW bereitstellten. WEG gehört ferner zu den Hauptzulieferern von Produkten und Lösungen für Solarkraftwerke im Land. WEG lieferte komplette schlüsselfertige konventionelle Umspannwerke für ein Solarkraftwerk in Mexiko und trug zum Export von 100MW Energie bei, indem es ein Umspannwerk mit einer Leistung von 34,5kV bis 230kV und eine 230-kV-Leitung lieferte. WEG stellt ferner seit 2013 Windturbinen her. Windturbinen mit einer Kapazität von rund 650 MW sind mittlerweile installiert und das Unternehmen plant die Expansion auf internationale Märkte wie Indien. WEG hat Turbinen, Generatoren, Schaltanlagen und Transformatoren für mittelgroße und kleine Kraftwerke im Angebot.
5. AIA Group Ltd, 3,42 % Gewichtung im Fonds. Ausgerichtet auf Ziel 3 der SDG – Sicherstellung einer gesunden Lebensweise und Förderung des Wohlergehens aller Altersgruppen. AIA setzt ihren Mitgliedern Anreize, um sie zu einer Verbesserung ihrer Gesundheit anzuregen und zu belohnen, und konzentriert sich dabei auf Vorsorgeuntersuchungen und Präventivmaßnahmen sowie auf kontinuierliche Innovationen, mit denen gesundheitliche Herausforderungen bewältigt werden und um sicherzustellen, dass die Kunden die richtige Versorgung zur richtigen Zeit erhalten. AIA Vitality ist ein wissenschaftsgestütztes Wellness-Programm, das auf Teilnehmer einwirkt, damit diese ihre Gesundheit messbar verbessern. 24 % der Mitglieder, die mit einem ungesunden Body-Mass-Index („BMI“) begonnen hatten, haben sich in einen gesunden Bereich bewegt. 73 % der Mitglieder, die mit einem ungesunden Blutzuckerbereich begonnen hatten, haben sich in einen gesunden Bereich bewegt.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-in-dikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 31. Dezember 2023	0 %	0 %	Mittel	100 % der Unternehmen waren auf eines oder mehrere der UN SDGs ausgerichtet, wie durch eine Stichprobe qualitativer Fallstudien für die fünf Top-Positionen am Ende des Bezugs-zeitraums belegt, die diesem Dokument beigelegt ist.
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0 %	Mittel	100 % der Unternehmen waren auf eines oder mehrere der UN SDGs ausgerichtet, wie durch eine Stichprobe qualitativer Fallstudien für die fünf Top-Positionen am Ende des Bezugs-zeitraums belegt, die diesem Dokument beigelegt ist.

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Die Datenverfügbarkeit und -abdeckung für den Teilfonds war angesichts seines Schwerpunkts auf Schwellenländern vielfach begrenzt: Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
- 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
- 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
- 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen

Bei den wichtigsten nach-teiligen Aus-wirkungen han-delt es sich um die bedeu-tendsten nach-teiligen Aus-wirkungen von Investitions-entscheidun-gen auf Nach-haltig-keits-faktoren in den Be-reich-en Um-welt, Sozia-les und Be-schäf-tigung, Achtung der Mensch-enrechte und Be-kämp-fung von Kor-rup-tion und Bestechung.

6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
 - Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen in Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAIs berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCT TWD 10	HALBLEITER	5,61 %	TAI
HDFC BANK LIMITED INR 1	BANKEN	4,57 %	IND
AIA GROUP LTD HKD NPV	VERSICHERUNGEN	3,76 %	HKG
BLACKROCK INST US DOL HRT	AKTIEN	3,74 %	USA
BANK RAKYAT INDONE IDR 50	BANKEN	3,66 %	INO
TATA CONSULTANCY SV INR 1	COMPUTER	3,11 %	IND
WEG SA BRL NPV	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	3,08 %	BRA
SHENZHEN INOVANCE T CNY 1	ELEKTRONIK	3,02 %	CHN
MARICO LTD INR 1	GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	2,99 %	IND
ASML HOLDING NV EUR 0.09	HALBLEITER	2,81 %	NET
HINDUSTAN UNILEVER INR 1	HAUSHALTSPRODUKTE/GEBRAUCHSKERAMIK	2,8 %	IND
INFINEON TECHNOLO EUR NPV	HALBLEITER	2,74 %	GER
RAIA DROGASIL SA BRL NPV	PRIVATKUNDEN	2,61 %	BRA
NARI TECHNOLOGY CO CNY 1	MASCHINENBAU – DIVERSIFIZIERT	2,51 %	CHN
L'OREAL EUR 0.2	KOSMETIK/KÖRPERPFLEGE	2,48 %	FRC



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

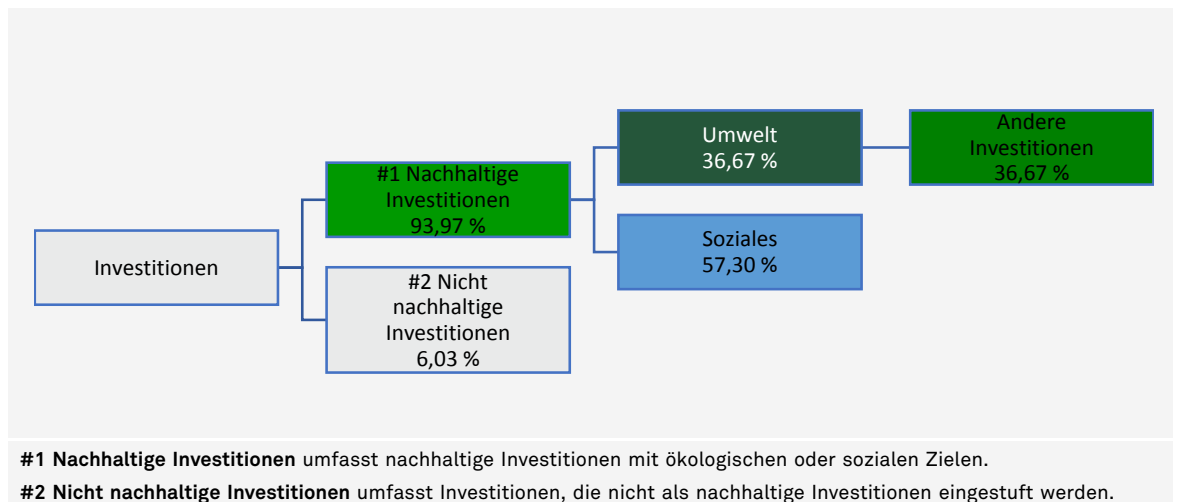
Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 93,97 % des Nettoinventarwerts waren in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR investiert. Die Vermögensallokation auf Umweltziele und soziale Ziele ist zwar nicht festgeschrieben, und daher ist der Teilfonds nicht verpflichtet, einen Mindestprozentsatz des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR zu investieren, die ausdrücklich ein Umweltziel oder ausdrücklich ein soziales Ziel haben. Dennoch waren 36,67 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert und 57,30 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel. 0 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel investiert.

#1 Nachhaltige Investitionen: 93,97 % des Nettoinventarwerts

– Sonstige Umweltziele: 36,67 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 57,30 % des Nettoinventarwerts

#2 Nicht nachhaltige Investitionen: 6,03 % des Nettoinventarwerts



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der

Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomeikonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

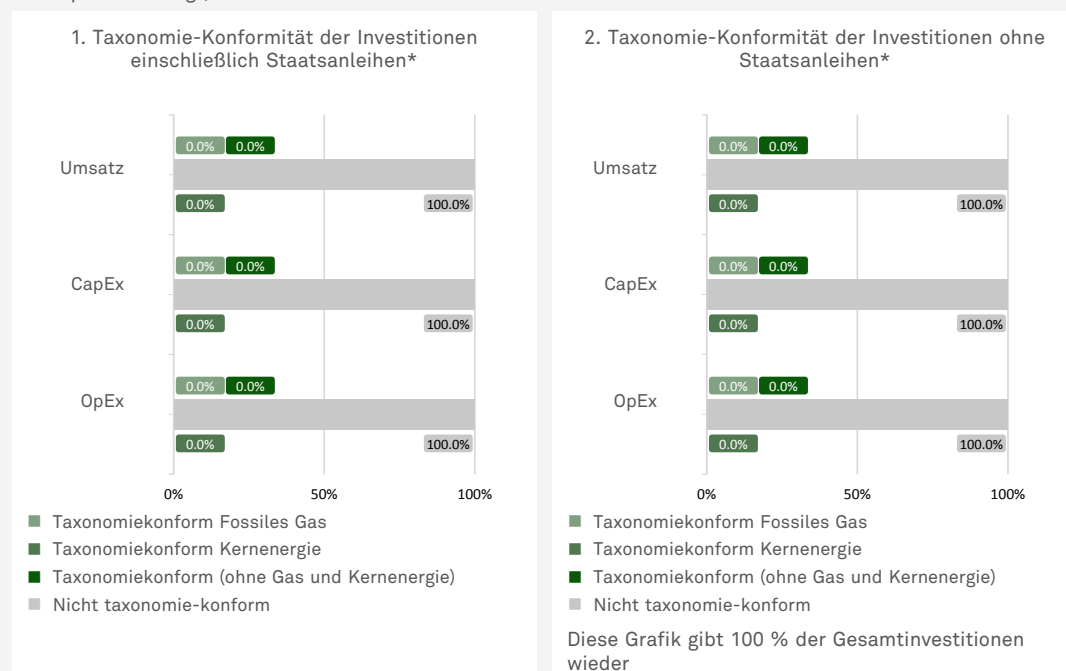
- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomeikon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglicht darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, blieb mit 0 % im Vergleich zu dem vorherigen Bezugszeitraum unverändert.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 36,67 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxoniekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht** berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 57,3 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 6,03 % des Nettoinventarwerts in die Kategorie #2 („Nicht nachhaltige Investitionen“), die nur aus FDI-, Liquiditäts- und Absicherungsinstrumenten besteht. Dazu gehören Barmittel, Barmitteln gleichgestellte Mittel und Währungspositionen. Diese Instrumente wurden entweder gehalten, um (a) sicherzustellen, dass der Teilfonds über ausreichende Liquidität verfügt, und/oder (b) zur Absicherung gegen potenzielle Wechselkursbewegungen. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Um das nachhaltige Investitionsziel zu erreichen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
 - Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
 - Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
 - Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
 - Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
 - Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.
 - Er investierte mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen aus Schwellenländern, die zu sozialen Zielen oder Umweltzielen beitragen, indem sie durch einen Beitrag zu einem oder mehreren Zielen der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (die „SDGs“) eine nachhaltige Entwicklung fördern. Zu den Beispielen für die SDGs zählen Klimaschutzmaßnahmen, bezahlbare und saubere Energie, nachhaltige Städte und Gemeinden, Gesundheit und Wohlergehen, hochwertige Bildung und kein Hunger.
- Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds bestimmt.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Sustainable Global Equity Fund

Unternehmenskennung: 213800YDXSXADAYMRQ85

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 93,64 % an nachhaltigen Investitionen. ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 23. Februar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

- Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.
- Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.
- Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

0,56 % der diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu dem in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziel des Klimaschutzes bei.



Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Kreislaufwirtschaft und Recycling
- Reduzierung der Nutzung natürlicher Ressourcen
- Elektrifizierung

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Zugang zu Finanzprodukten und -dienstleistungen
- Gesundheit und Wohlergehen
- Medikamentenentwicklung
- Infrastruktur
- Beitrag zu sozialen Zielen aufgrund der internen Geschäftspraktiken der Unternehmen, in die investiert wird, und dem erfolgreichen Umgang mit konkurrierenden Interessen wichtiger Stakeholder-Gruppen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1 - Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2 - 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Ohne zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltene Instrumente stellte sich die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren folgendermaßen dar:

Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 - 98,46 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - 99 % des Teilfonds.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele der teilweise von dem Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sind vorstehend angegeben.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen folgendermaßen zu den vorstehenden sozialen Zielen bei:

- Entwicklung von Gentherapien zur Verbesserung der Lebensqualität, der Langlebigkeit und der Produktivität von Patienten bei gleichzeitiger Verringerung der physischen und wirtschaftlichen Verschwendung, die mit chronischen Behandlungen assoziiert ist

– Angebot von Finanzprodukten und -dienstleistungen für einen breit gefächerten Kundenstamm, einschließlich für Personen, die über keine Bankverbindung verfügen

– Ermöglichung einer sicheren und wirksamen Medikamentenentwicklung und -innovation

0,56 % der diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu dem in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziel des Klimaschutzes bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Elektrifizierung
- Kreislaufwirtschaft und Recycling

– Reduzierung der Nutzung natürlicher Ressourcen

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu Umweltzielen bei, die auf folgende Weise nicht mit der EU-Taxonomie konform sind:

– Leistung eines Beitrags zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt durch die Entwicklung von erneuerbaren Energien, Effizienz und grüner Technologie

– Verbesserung der Effizienz in den Wertschöpfungsketten und Einführung eines effizienten Abfallmanagements

– Minimierung von Strom- und Wärmeverlusten und Erzielung eines besseren Wirkungsgrads bei der Energieumwandlung, was den Endnutzern hilft, ihre eigenen betrieblichen Emissionen und ihren CO₂-Fußabdruck zu verringern.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

– Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:

1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8. Emissionen in Wasser
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des/-derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des

Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbare erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbaren erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



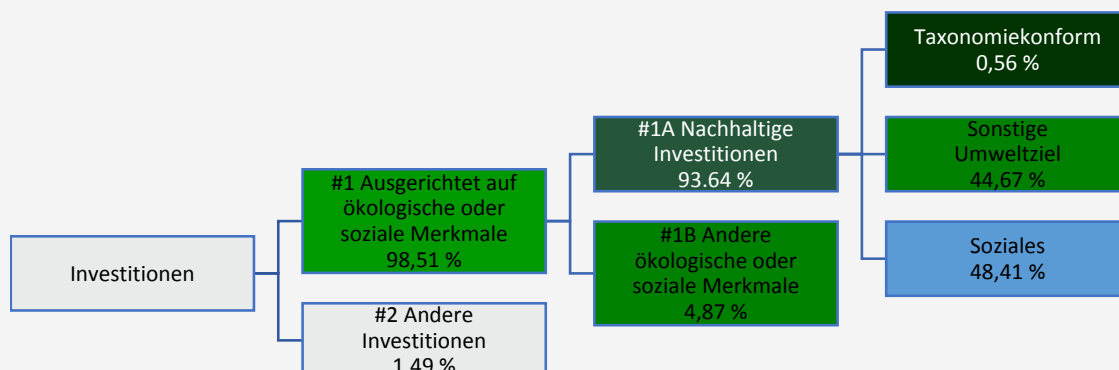
Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 98,51 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 93,64 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR. Davon hatten 44,67 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 48,41 % ein soziales Ziel. 0,56 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
– Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,56 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die **Kriterien für Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

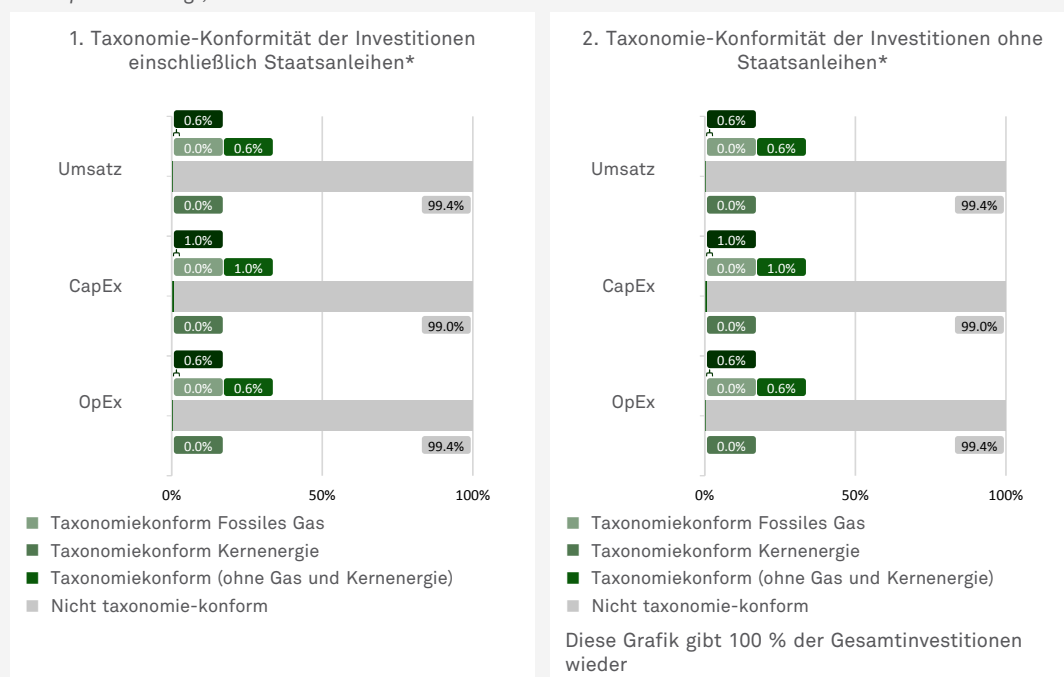
¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 44,67 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 48,41 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 1,49 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

1,49 % in Barmitteln und Vehikeln für das Liquiditätsmanagement, die ausschließlich zu diesem Zweck gehalten wird. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte mindestens 50 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund

Unternehmenskennung: 213800MU54AM2UKX6758

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● ☐ Ja	●○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 54,09 % an nachhaltigen Investitionen. ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

Die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren:

- Anlagen in Unternehmen, die mit der roten Linie des Anlageverwalters in Bezug auf Kohlenstoff übereinstimmen.
- Vermeidung von Investitionen in Unternehmen, die wesentliche unlösbare Probleme in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruption haben.
- Anlagen in Unternehmen, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.
- Anlagen in staatliche Emittenten, die sich proaktiv um ein gutes Management sozialer und ökologischer Faktoren bemühen.

Alle der vorstehenden Merkmale wurden von dem Teilfonds im Bezugszeitraum erfüllt.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.



Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden, nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Kreislaufwirtschaft und Recycling
- Elektrifizierung

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- Zugang zu Finanzprodukten und -dienstleistungen
- Gesundheit und Wohlergehen
- Medikamentenentwicklung
- Infrastruktur
- Zugang zu digitaler Infrastruktur
- Schutz der Gesellschaft
- Zugang zu Wohnraum
- Aus- und Weiterbildung

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es werden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden:

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1 - Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, die:

- in Sektoren mit hohen Emissionen gemäß der Definition der Internationalen Energieagentur (IEA) tätig sind; und
- eine Geschäftstätigkeit ausüben, die mit einem Szenario unvereinbar ist, bei dem die globalen Temperaturen um mehr als 2 Grad über das vorindustrielle Niveau ansteigen und die
- keine angemessene Strategie zur Bekämpfung von Emissionen/des Klimawandels oder einen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Stehen keine Daten Dritter für die Bewertung dieser Kriterien zur Verfügung oder es gibt Hinweise, dass bestimmte Unternehmen diese Kriterien erfüllen, so liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit diesem Nachhaltigkeitsindikator ausschließlich auf der Grundlage seines qualitativen Überprüfungsverfahrens zu bestimmen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2 - 0 % des Nettoinventarwerts in Unternehmen, in die investiert wird, die in Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze verwickelt waren.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - Ein gewichtetes durchschnittliches ESG-Risiko-Rating von „mittel“ oder besser auf Portfolioebene. Dieses Rating wird anhand der Daten von Dritten ermittelt.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 - Alle Anlagen in staatlichen Emittenten müssen entweder eine starke aktuelle Positionierung aufweisen und/oder Fortschritte im Hinblick auf das Management von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren nachweisen, wie im Rahmen des vom Anlageverwalter entwickelten Nachhaltigkeitsrahmens für staatliche Emittenten ermittelt.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 96,75 % der Investitionen des Teilfonds in Unternehmensanleihen (ausgenommen FDI, Barmittel und Barmitteln gleichgestellte Mittel).

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 3 lag bei 50 % der Investitionen des Teilfonds (ausgenommen FDI, Barmittel und Barmitteln gleichgestellte Mittel).

Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 100 % der von dem Teilfonds gehaltenen staatlichen Emittenten.

Es wurden keine FDI eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermaßen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %

Mit Nachhaltigkeits-indikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Schwach – auf einer gewichteten Durchschnittsbasis wurde der Teilfonds von einem Drittanbieter von Daten als mit einem geringen Maß an nicht gemanagten ESG-Risiken behaftet eingestuft.
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	100 % der Emittenten von Staatsanleihen

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezugs-zeitraum	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4
31. Dezember 2022 bis 31. Dezember 2023	0 %	0 %	Schwach	100 % der Emittenten von Staatsanleihen
31. Dezember 2021 bis 31. Dezember 2022	0 %	0 %	Mittel	100 % der Emittenten von Staatsanleihen

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die sozialen Ziele der teilweise von dem Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR sind vorstehend angeben.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen folgendermaßen zu den vorstehenden sozialen Zielen bei:

- Ermöglichung des Zugangs und Vermittlung von Kenntnissen über Finanzprodukte und -dienstleistungen für den nicht mit Bankdienstleistungen versorgten Markt in einem Entwicklungsland
- Bereitstellung sozialer Infrastruktur zur Unterstützung gesellschaftlicher Bedürfnisse wie Gesundheitsversorgung, Bildung und bezahlbaren Wohnraum.
- Bereitstellung digitaler Infrastruktur
- Finanzierung der Erforschung, Entwicklung und/oder Vermarktung zukunftsweisender Medikamente
- Bereitstellung von Gesundheitsprodukten und -dienstleistungen
- Bereitstellung von Zugang zu bezahlbarem Wohnraum

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen zu den folgenden nicht mit Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung konformen Umweltzielen bei:

- Beitrag zum Übergang zu einer klimaneutralen Welt
- Kreislaufwirtschaft und Recycling
- Elektrifizierung

Die nachhaltigen Investitionen trugen folgendermaßen zu diesen Umweltzielen bei:

- Bereitstellung wesentlicher Teile für die Erzeugung erneuerbarer Energie
- Bereitstellung von Automatisierungslösungen für Netze, von Zugang und Konnektivität mit kontinuierlicher Stromversorgung und Betriebseffizienz durch die Entwicklung von Anlagen, die effiziente Stromverteilung und effizienten Zugang bieten und solchen, die den Übergang zu CO₂-armen Lösungen ermöglichen
- Angebot von erneuerbaren Lösungen und Kreislaufwirtschaftslösungen in Form von Biokraftstoffen
- Produktion von Batterien für Elektrofahrzeuge, Energiespeicheranlagen und sonstigen Produkten, die den Übergang zu einer CO₂-ärmeren Wirtschaft ermöglichen
- Entwicklung und Herstellung von Maschinen, die eingesetzt werden, um Getränkebehälter zu recyceln sowie die Unterstützung von Ressourceneffizienz und -produktivität durch Recycling-, Lebensmittelsortier- und Abfallentsorgungsdienste

- Herstellung und Vertrieb von unterbrechungsfreier Stromversorgung, Photovoltaikprodukten und Elektronikmaterialien, die zur Marktdurchdringung von sauberer Energie beitragen und Verbrauchern Energieeinsparungen und CO₂-Verringerung ermöglichen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds Umweltziele oder soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten, indem er das Engagement der einzelnen nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR in Bereichen bewertete, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich gelten. Emittenten, die in Tätigkeiten involviert waren, die aus ökologischer oder sozialer Sicht als schädlich angesehen werden, wurden von Investitionen ausgeschlossen. Die Beteiligung an solchen Tätigkeiten wurde laufend überwacht.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter prüfte die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für sämtliche nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, für die Daten verfügbar waren. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).
- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission: 9. Fehlende Menschenrechtspolitik. 17. Anzahl der Verurteilungen und Höhe der Geldstrafen für Verstöße gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften. 19. Score für Meinungsfreiheit 23. Score für politische Stabilität 24. Score für Rechtsstaatlichkeit

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein sehr breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das von Arbeitnehmerrechten über den Verbraucherschutz bis hin zur Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten reicht.

Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da jedes der Unternehmen, in die investiert wurde, von Dritten bereitgestellte Screenings bestand, die entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdecken oder als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen werden. Jedes Unternehmen, in das investiert wurde, durchlief außerdem erfolgreich den qualitativen Prüfprozess des Anlageverwalters, der die Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken berücksichtigt. Wenn die Unternehmen, in die investiert wird, den relevanten, von Dritten bereitgestellten Filtern nicht entsprechen, liegt es im Ermessen des Anlageverwalters, die Übereinstimmung mit den verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken ausschließlich auf der Grundlage seiner eigenen qualitativen Prüfung festzustellen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter prüfte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf der Produktebene im Bezugszeitraum häufig, ungeachtet bestimmter Probleme mit der Datenabdeckung und Datenqualität, wie nachstehend ausführlicher beschrieben. Der Anlageverwalter prüfte die PAIs für Emittenten, in die investiert wird, anhand von Daten von einem bestimmten Drittdatenanbieter. Fielen eine oder mehrere beliebige PAIs für einen Emittenten oder ein Produkt scheinbar höher aus als aufgrund der von dem bestimmten externen Datenanbieter bezogenen Daten zu erwarten, wurde eine weitere qualitative Überprüfung des-/derjenigen Emittenten und Produkt(e) vorgenommen, um zu bestimmen, ob solche Daten auf Belege für erhebliche Beeinträchtigung hindeuteten. In Fällen, in denen nach Auffassung des Anlageverwalters im Anschluss an weitere qualitative Prüfungen unlösbar erhebliche Beeinträchtigungen ermittelt wurden, wurden weitere Maßnahmen ergriffen – bis hin zu und einschließlich einer Veräußerung. Im Verlauf des Bezugszeitraums wurden für die Investitionen im Teilfonds keine unlösbar erheblichen Beeinträchtigungen festgestellt. Waren die Daten lückenhaft, und die PAI wurde als für den Sektor eines Unternehmens wesentlich erachtet, wurde die interne qualitative Bewertung des Anlageverwalters herangezogen, um die PAIs zu bewerten.

Die PAIs wurden anhand ihrer Merkmale (einschließlich ihrer Wesentlichkeit und der Fähigkeit des Anlageverwalters, sie einzuschätzen) eingestuft, und die Einstufungen wurden herangezogen, um die Maßnahmen und Ergebnisse bei der Bewertung der PAIs zu bestimmen.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAIs berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Weitere wichtige Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
FRANCE 0% 11/29/23	STAATSANLEIHEN	6,12 %	FRC
FRANCE 0% 09/20/23	STAATSANLEIHEN	5,81 %	FRC
FRANCE 0% 02/07/24	STAATSANLEIHEN	5,58 %	FRC
US TS 1.25% 04/15/28 IFL	STAATSANLEIHEN	4,0 %	USA
ITALY 0% 01/31/24	STAATSANLEIHEN	3,88 %	ITL
ITALY 0.3% 08/15/23	STAATSANLEIHEN	2,97 %	ITL
BARCLAYS BAN WTS 17/01/25	PNOTE/WRNT	2,89 %	USA
BARCLAYS BAN WTS 21/01/25	PNOTE/WRNT	2,89 %	USA
BRAZIL 0% 07/01/27	STAATSANLEIHEN	2,88 %	BRA
BARCLAYS BAN WTS 11/13/22	PNOTE/WRNT	2,81 %	UKK
BR ICS-EURO LIQ-G ACC T0	AKTIEN	2,71 %	IRE
MEXICO 8% 11/07/47	STAATSANLEIHEN	2,61 %	MEX
BARCLAYS BAN WTS 11/10/22	PNOTE/WRNT	2,53 %	UKK
ITALY 0% 01/12/24	STAATSANLEIHEN	2,49 %	ITL
BRAZIL 0% 01/01/26	STAATSANLEIHEN	2,3 %	BRA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Grafik zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 88,19 % des Nettoinventarwerts wurden verwendet, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale in Übereinstimmung mit den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie zu erfüllen. Der Teilfonds investierte 54,09 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR.

Davon hatten 30,76 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 22,86 % ein soziales Ziel. 0,47 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale: 88,19 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 54,09 % des Nettoinventarwerts

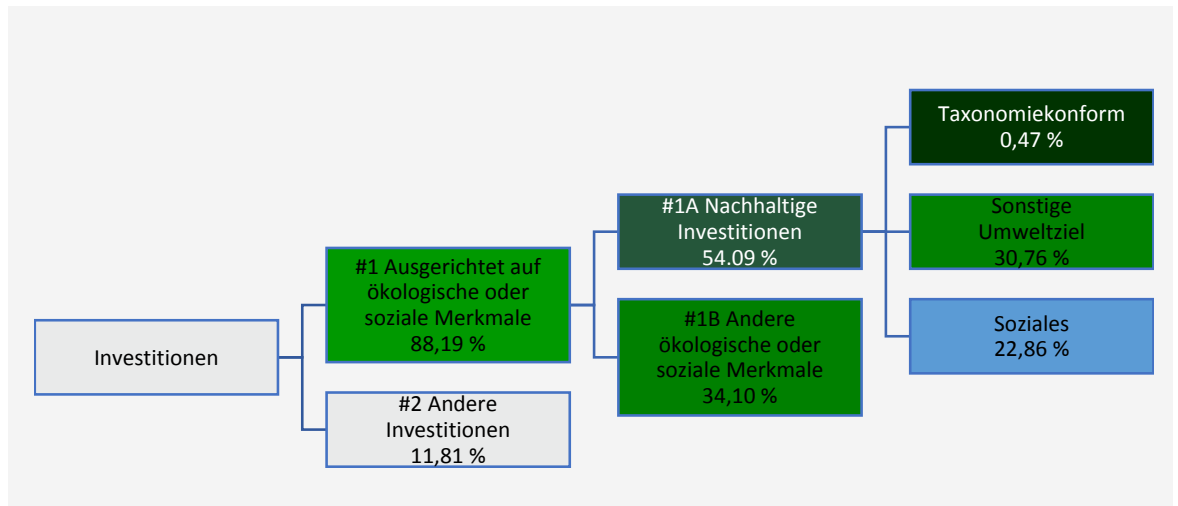
– Taxonomiekonform: 0,47 % des Nettoinventarwerts

– Umwelt: 30,76 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 22,86 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 34,10 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 11,81 % des Nettoinventarwerts



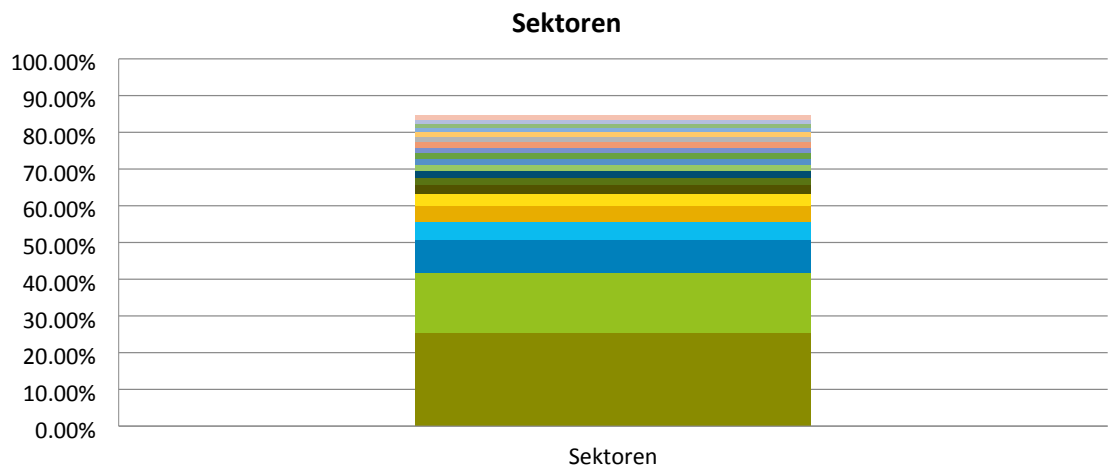
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



STAATSANLEIHEN	AKTIEN	PNOTE/WRNT
BANKEN	PHARMAUNTERNEHMEN	HALBLEITER
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	REITS	VERSICHERUNGEN
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN	GESUNDHEIT – PRODUKTE	SOFTWARE
CHEMIKALIEN	ELEKTRONIK	ELEKTRIK
INTERNET	KOSMETIK/KÖRPERPFLEGE	ENERGIE – ALTERNATIVE QUELLEN
MEDIEN	HAUSHALTSPRODUKTE/GEBRAUCHSKERAMIK	

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

0,47 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit Umweltzielen investiert.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Die Bewertung, ob diese Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten entsprachen, war nicht Gegenstand eines von einem oder mehreren Prüfern erteilten Urteils mit Prüfungssicherheit oder einer Überprüfung durch einen oder mehrere Dritte.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

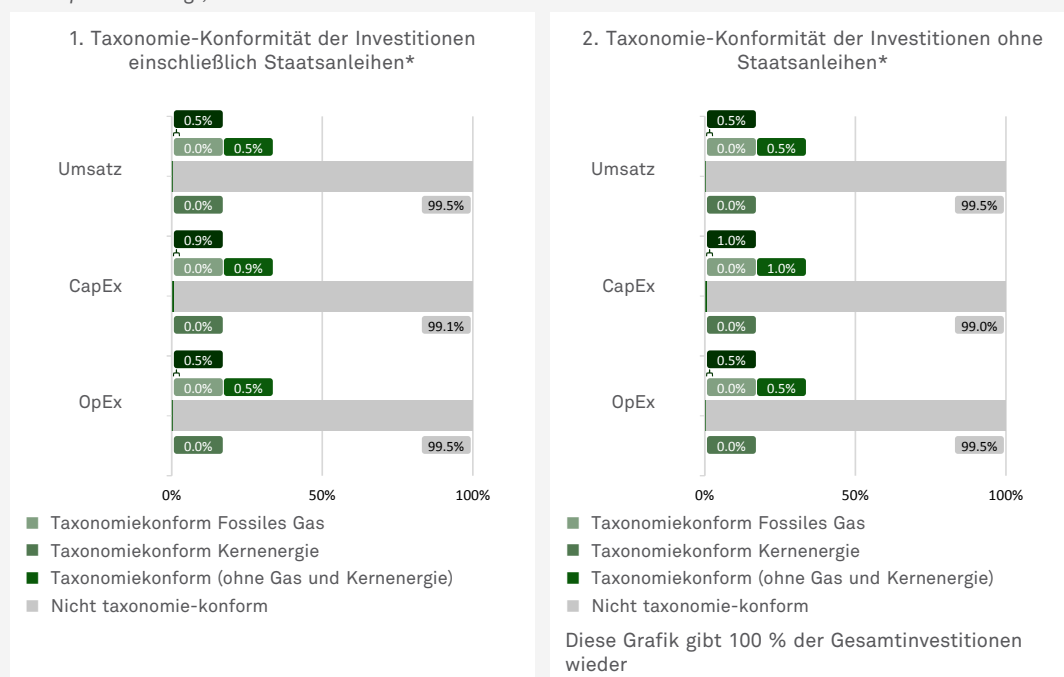
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
0 %
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, stieg im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen geringfügig an. Dies war auf die bessere Verfügbarkeit von Daten zurückzuführen, die von den Unternehmen gemeldet wurden, im Gegensatz zu der Verwendung geschätzter Daten externer Datenanbieter.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Teilfonds investierte 30,76 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 22,86 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 11,81 % des Nettoinventarwerts in die Kategorie #2 („Andere Investitionen“), die nur aus FDI-, Liquiditäts- und Absicherungsinstrumenten besteht. Dazu gehören Barmittel, Barmitteln gleichgestellte Mittel, Währungspositionen, währungsbezogene FDI und der Absicherung dienende FDI. Diese Instrumente wurden entweder gehalten, um (a) sicherzustellen, dass der Teilfonds über ausreichende Liquidität verfügt, und/oder (b) zur Absicherung gegen potenzielle Wechselkursbewegungen. Diese Instrumente unterlagen keinen ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen, da der Anlageverwalter ökologische oder soziale Erwägungen bei diesen Instrumenten nicht als relevant erachtet.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Um die ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen, ergriff der Anlageverwalter die folgenden Maßnahmen:

- Er investierte 20 % in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR
- Er schloss Emittenten aus, die Tabakprodukte herstellen
- Er schloss Emittenten aus, die mehr als 10 % ihrer Umsatzerlöse mit dem Verkauf von Tabak erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die Einkünfte aus der Produktion umstrittener Waffen erzielen
- Er schloss Emittenten aus, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen verstoßen (der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält)
- Er investierte mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nach Abzug des Engagements des Teilfonds in Barmittelbeständen und liquiden barmittelähnlichen Anlagen, Geldmarktfonds, währungsbezogenen FDI sowie FDI für Absicherungszwecke (die „Nicht-ESG-Vermögenswerte“), die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters entsprechen.

Das Engagement ist kein Teil der ökologischen oder sozialen Anlagestrategie des Teilfonds. Sie ist jedoch ein integraler Bestandteil des Anlageansatzes des Anlageverwalters, da er der Meinung ist, dass ein konstruktiver Dialog mit den Managementteams nicht nur einen echten Einblick in die Arbeitsweise eines Unternehmens bietet, sondern auch eine Möglichkeit darstellt, sich für positive Veränderungen einzusetzen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: BNY Mellon US Municipal Infrastructure Debt Fund

Unternehmenskennung: 213800RGF16LW6526386

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
● ● ☐ Ja	● ○ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____% ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind ☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 24. November 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt.

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete. Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Wie in der vorvertraglichen Offenlegung erwähnt sind zum Beispiel Unternehmensemittenten, die einen bestimmten Prozentsatz des Umsatzes gemäß Ermittlung durch den Anlageverwalter aus der Tabakherstellung, aus der Herstellung umstrittener Waffen und aus dem Abbau und/oder der Verstromung von Kraftwerkskohle erzielten, ausgeschlossen. Emittenten werden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.

Der Teilfonds investierte nicht in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurde der folgende Nachhaltigkeitsindikator eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

Ein ökologischer und/oder sozialer Mindeststandard, der Praktiken abschwächt oder vermeidet, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtet.

Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurde ein Ausschlusskriterium verwendet. Zum Beispiel sind Emittenten, die einen bestimmten Prozentsatz des Umsatzes gemäß Ermittlung durch den Anlageverwalter aus der Tabakproduktion, aus der Herstellung umstrittener Waffen und aus dem Abbau und/oder der Verstromung von Kraftwerkskohle erzielt haben, ausgeschlossen. Emittenten wurden ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.

Positive ökologische und/oder soziale Investitionen, die darauf abzielen:

höhere Engagements in Anleihen, bei denen die Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten mit positiven ökologischen („grünen“) und/oder sozialen Auswirkungen verwendet wurden, die jedoch nach Einschätzung des Anlageverwalters nicht der Definition von nachhaltigen Investitionen gemäß der SFDR entsprachen (nachstehend „Use of Proceeds Bonds“); im Vergleich zum gemischten Referenzwert; und

Das Ziel ist eine Kohlenstoffintensität, die unter dem Niveau des gemischten Referenzwerts liegt.

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Ausschlusspolitik: Eine Bewertung, ob der Teilfonds erfolgreich und beständig seine Ausschlusspolitik ausführte, die darin bestand, nicht in Wertpapiere zu investieren, die von Unternehmen ausgegeben wurden, auf die einer der folgenden Punkte zutraf:

- mehr als 5 % ihres Umsatzes stammen aus der Produktion von Tabak
- mehr als 5 % ihrer Einkünfte stammen aus der unkonventionellen Öl- und Gasförderung, es sei denn:
 - das Engagement wird über Use of Proceeds Bonds erreicht; und/oder
 - der Anlageverwalter ist der Ansicht, dass der Emittent einen soliden, klar definierten langfristigen Plan zur Bewältigung seiner Umweltauswirkungen hat;
- an der Produktion von kontroversen Waffen beteiligt sind;
- mehr als 5 % ihrer Einkünfte werden aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und/oder mehr als 10 % der Einkünfte (oder gleichwertigen Einkünfte) aus der Verstromung von Kraftwerkskohle generiert, es sei denn:
 - das Engagement wurde über Use of Proceeds Bonds erreicht; und/oder
 - der Emittent verfügte über einen klar definierten Plan zum Ausstieg aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und/oder der Kohleverstromung vor (i) 2030 im Falle von Emittenten mit Sitz in einem entwickelten Markt oder (ii) 2040 im Falle von Emittenten mit Sitz in einem aufstrebenden Markt
- mehr als 5 % ihrer Einkünfte werden aus Glücksspielen erzielt
- wurden als in schwerwiegende Kontroversen im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung verwickelt erachtet (einschließlich erheblicher Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze)

Der Nachhaltigkeitsindikator hat folgendermaßen abgeschnitten:

Es erfolgten keine Investitionen in Wertpapiere, die:

- mehr als 5 % ihres Umsatzes stammen aus der Produktion von Tabak
- mehr als 5 % ihrer Einkünfte stammen aus der unkonventionellen Öl- und Gasförderung, es sei denn:
 - das Engagement wird über Use of Proceeds Bonds erreicht; und/oder
 - der Anlageverwalter ist der Ansicht, dass der Emittent einen soliden, klar definierten langfristigen Plan zur Bewältigung seiner Umweltauswirkungen hat;
- an der Produktion von kontroversen Waffen beteiligt sind;

– mehr als 5 % ihrer Einkünfte werden aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und/oder mehr als 10 % der Einkünfte (oder gleichwertigen Einkünfte) aus der Verstromung von Kraftwerkskohle generiert, es sei denn:

- das Engagement wurde über Use of Proceeds Bonds erreicht; und/oder
 - der Emittent verfügte über einen klar definierten Plan zum Ausstieg aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und/oder der Kohleverstromung vor (i) 2030 im Falle von Emittenten mit Sitz in einem entwickelten Markt oder (ii) 2040 im Falle von Emittenten mit Sitz in einem aufstrebenden Markt
- mehr als 5 % ihrer Einkünfte werden aus Glücksspielen erzielt
- wurden als in schwerwiegende Kontroversen im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung verwickelt erachtet (einschließlich erheblicher Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze)

Zum 31. Dezember waren die Investitionen des Teilfonds zu 99,5 %* auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet. Das verbleibende 0,5 % wurde in Barmitteln und Derivaten zu Absicherungszwecken gehalten und war daher nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Kriterien ausgerichtet.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend. In Übereinstimmung mit den vorvertraglichen Informationen gemäß SFDR tätigte der Teilfonds im Bezugszeitraum keine Investitionen, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR einzustufen waren.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

Nicht zutreffend.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Bezugszeitraum nicht.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 24. November 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Metropoli 5.175% 11/15/49	KOMMUNALANLEIHEN	1,89 %	USA
Commonwea 3.68% 07/15/26	KOMMUNALANLEIHEN	1,5 %	USA
Californi 5.183% 11/01/53	KOMMUNALANLEIHEN	1,48 %	USA
Detroit C 6.645% 05/01/29	KOMMUNALANLEIHEN	1,41 %	USA
New York 4% 03/15/44	KOMMUNALANLEIHEN	1,25 %	USA
New York 6.971% 06/30/51	KOMMUNALANLEIHEN	1,25 %	USA
Public Fi 6.145% 08/01/28	KOMMUNALANLEIHEN	1,2 %	USA
Massachus 2.436% 10/15/27	KOMMUNALANLEIHEN	1,16 %	USA
Californi 7.14% 08/15/47	KOMMUNALANLEIHEN	1,15 %	USA
Battery P 4.8% 11/01/28	KOMMUNALANLEIHEN	1,08 %	USA
State Pub 5.426% 09/15/26	KOMMUNALANLEIHEN	1,08 %	USA
Universit 1.997% 05/15/31	KOMMUNALANLEIHEN	1,05 %	USA
ILLINOIS 4% 04/01/50	KOMMUNALANLEIHEN	1,02 %	USA
Franklin 3.382% 11/01/50	KOMMUNALANLEIHEN	0,97 %	USA
Chicago P 2.925% 01/01/38	KOMMUNALANLEIHEN	0,92 %	USA



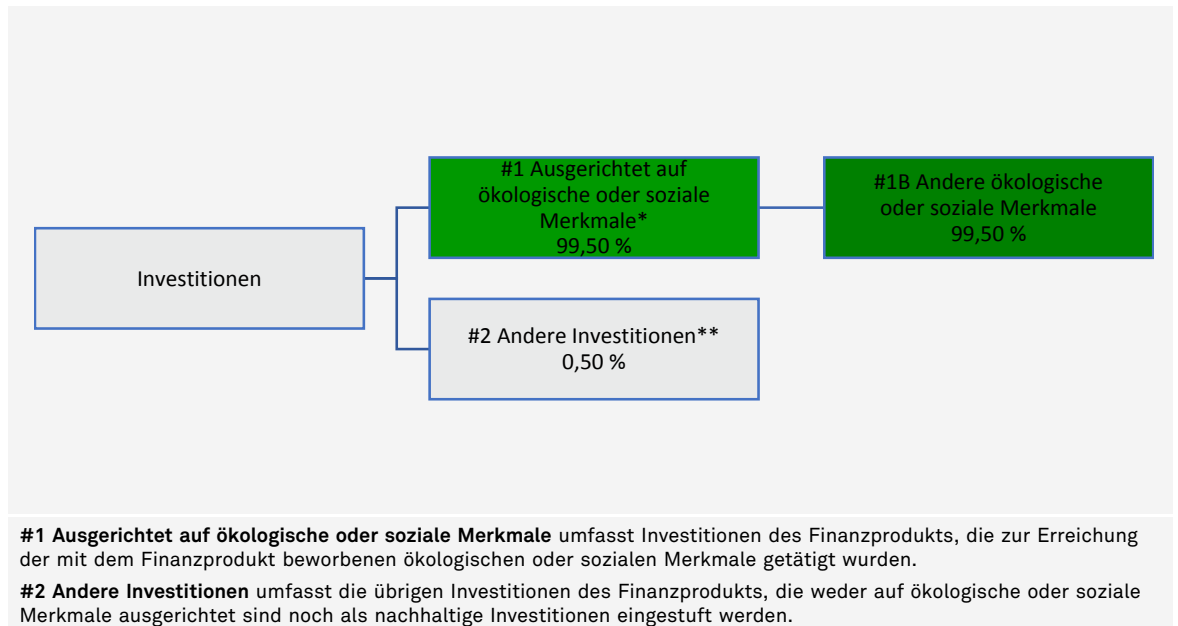
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale, indem er einen ausschließenden Ansatz verfolgte. Der nachstehende Zahlenwert unter #1 stellt den Portfolioanteil dar, der bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Die Prozentangaben in diesem Abschnitt, wie in der nachstehenden Grafik angegeben, entsprechen dem Stand vom 31. Dezember 2023 und daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

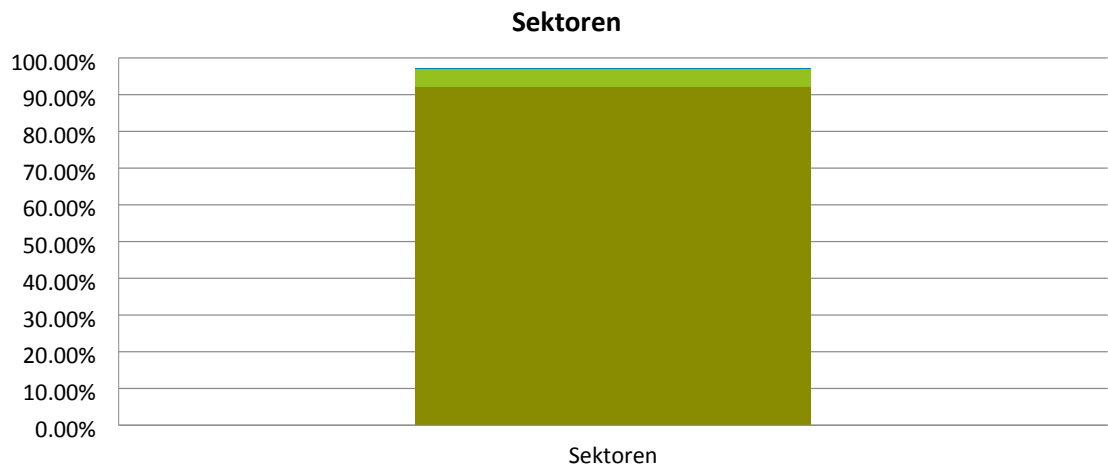


* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel und Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds, wie unten dargestellt, hauptsächlich in den Bereichen Kommunalanleihen und Gesundheitswesen engagiert.



■ KOMMUNALANLEIHEN ■ GESUND – DIENSTLEISTUNGEN ■ GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN ■ UNDEFINIERT

Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

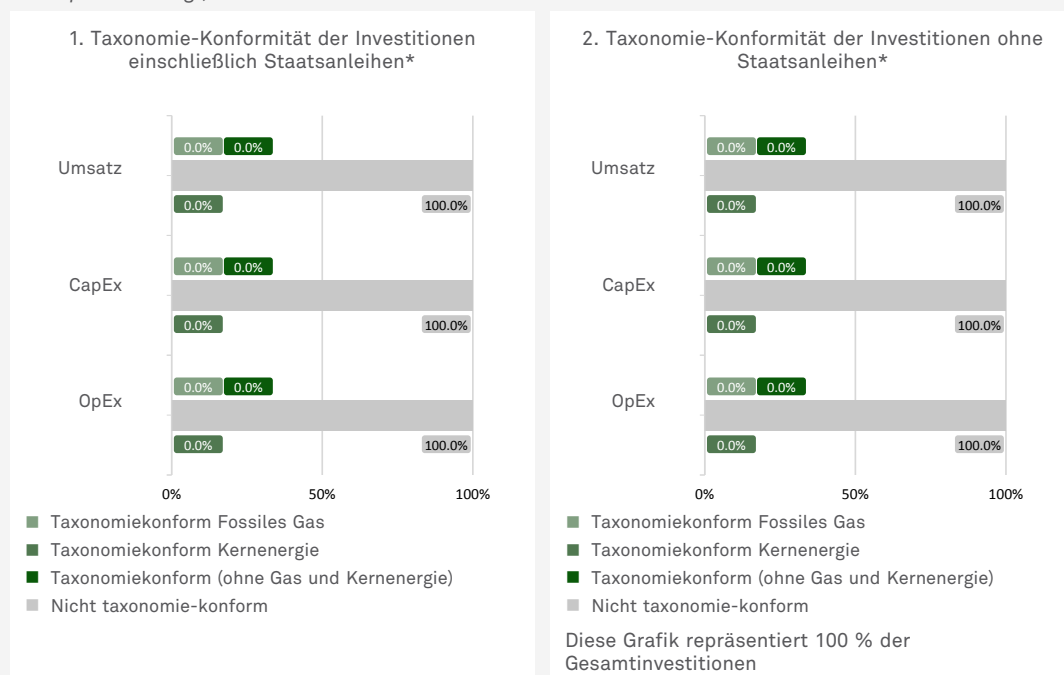
Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

- Der Anlageverwalter verwendete Ausschlusskriterien wie im Nachtrag für den Teilfonds angegeben.
- Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Ausschlusskriterien durch Ausschluss bestimmter Emittenten wie im Nachtrag (und vorstehend) angegeben erfüllt wurden. Dies wurde überwacht, indem die verbindlichen Elemente (Ausschlüsse) in die Handelssysteme einprogrammiert wurden.
- Der Anlageverwalter verwendete außerdem die folgenden internen Kontrollmechanismen, um zu überwachen, ob der Teilfonds die einprogrammierten verbindlichen Elemente im Bezugszeitraum beachtete:
 1. Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.
 2. Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

3. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen wurden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Elemente sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: Responsible Horizons EM Debt Impact Fund

Unternehmenskennung: 213800RV5KK3ZK331996

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweise einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☒ Ja	●○ ☐ Nein
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 74,00 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 18,00 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt
	☐ mit einem sozialen Ziel



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel dieses Teilfonds besteht darin, positive ökologische und/oder soziale Auswirkungen zu erreichen und dabei eine Gesamtrendite bestehend aus Erträgen und Kapitalwachstum zu generieren, indem der Teilfonds in Schudttitel und schudttitelbezogene Wertpapiere aus Schwellenländern sowie in darauf bezogene FDI investiert.

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 24. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang durch Investitionen in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuer erreicht, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind:

– Im Falle eines jeden solchen Use of Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investiert war, sollten die Erlöse ausschließlich zur gänzlichen oder teilweisen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen verwendet werden, die durch Beiträge unterschiedlichen Umfangs eindeutig auf die folgenden Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals, „UN SDGs“) ausgerichtet sind (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden

- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land
- Partnerschaften zur Erreichung des Ziels

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
 - Kein Hunger
 - Gute Gesundheit und Wohlergehen
 - Hochwertige Bildung
 - Geschlechtergleichheit
 - Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
 - Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
 - Weniger Ungleichheiten
 - Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen
- Ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investiert war, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme mit positiven ökologischen und/oder sozialen Tätigkeiten in Verbindung standen, die zu den folgenden UN SDGs beitrugen (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Industrie, Innovation und Infrastruktur

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Gute Gesundheit und Wohlergehen

Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum nicht in Improving Issuers (wie in Anhang III zur SFDR beschrieben). Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass der Teilfonds ein nachhaltiges Anlageziel verfolgt. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds erreicht wurde:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 92 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des in Anhang III der SFDR festgelegten Mindestanteils).

- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:
- (a) Ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen; oder dass mindestens 50 % seiner wirtschaftlichen Aktivitäten mit der EU-Taxonomie-Verordnung in Einklang gestanden haben.
- (b) Im Falle eines solchen Use of Proceeds Impact Bond, in die der Teilfonds investiert, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen beigetragen haben und/oder als „ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten“ im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung definiert wurden.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds zu erreichen.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, die ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzten.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für vom Teilfonds gehaltene Instrumente festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.
- Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI-Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt eine oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte PAIs im Rahmen seiner Analyse zur Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen über nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wie in der Antwort auf die vorstehende Frage „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“ beschrieben.

Der Teilfonds berücksichtigte ferner die folgenden PAIs:

- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 16. Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Es wurden keine der vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 24. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MEXICO 2.25% 08/12/36	STAATSANLEIHEN	2,91 %	MEX
African D 0.25% 11/21/24	MULTINATIONAL	2,44 %	CIT
CK Hutchi 1% 11/02/33	PRIVATKUNDEN	2,32 %	UKK
QNB Finan 1.625% 09/22/25	BANKEN	2,24 %	QAT
America M 3.625% 04/22/29	TELEKOMMUNIKATION	2,15 %	MEX
China Con 1.25% 08/04/25	BANKEN	2,06 %	CHN
Industria 0.125% 10/28/24	BANKEN	2,01 %	CHN
Bank Leum VAR 07/18/33	BANKEN	1,98 %	ISR
Sociedad 4% 01/27/32	ELEKTRIK	1,89 %	CHI
NE Proper 2% 01/20/30	IMMOBILIEN	1,88 %	ROM
BANCO BIL 0.75% 06/04/25	BANKEN	1,84 %	SPA
PHILIP 4.2% 03/29/47	STAATSANLEIHEN	1,83 %	PHI
POLAND 1% 03/07/29	STAATSANLEIHEN	1,78 %	POL
HUNGAR 1.75% 06/05/35	STAATSANLEIHEN	1,77 %	HUN
CHILE 1.25% 01/22/51	STAATSANLEIHEN	1,77 %	CHI



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

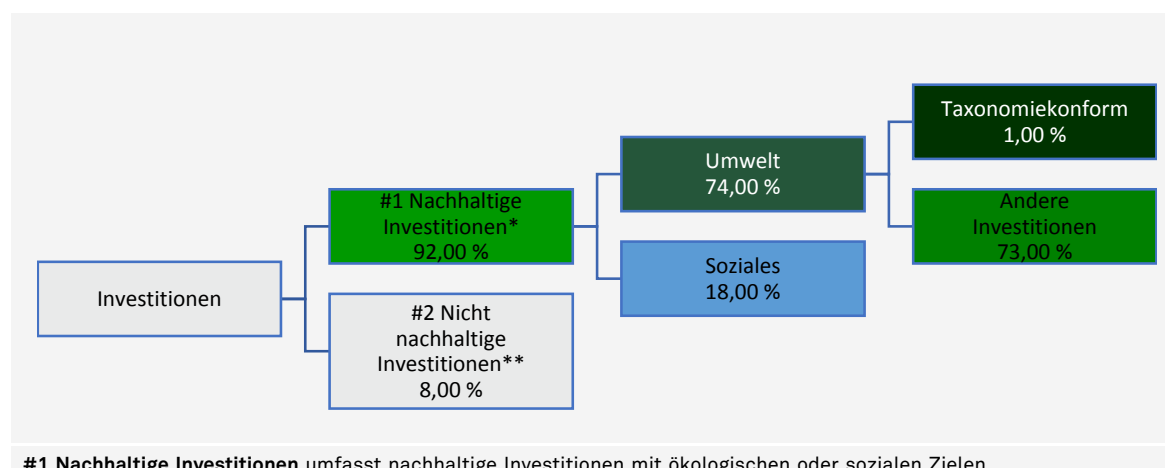
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mit dem Teilfonds wurden nachhaltige Investitionen angestrebt und er war verpflichtet, mindestens 80 % seines gesamten Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel und/oder sozialen Ziel zu investieren.

Zum 31. Dezember 2023 waren beispielsweise insgesamt 92 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel und/oder sozialen Ziel investiert, sodass der im Nachtrag für den Teilfonds angegebene Mindestanteil überschritten wurde. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1 angegeben.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie im nachstehenden Diagramm angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



#1 Nachhaltige Investitionen umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

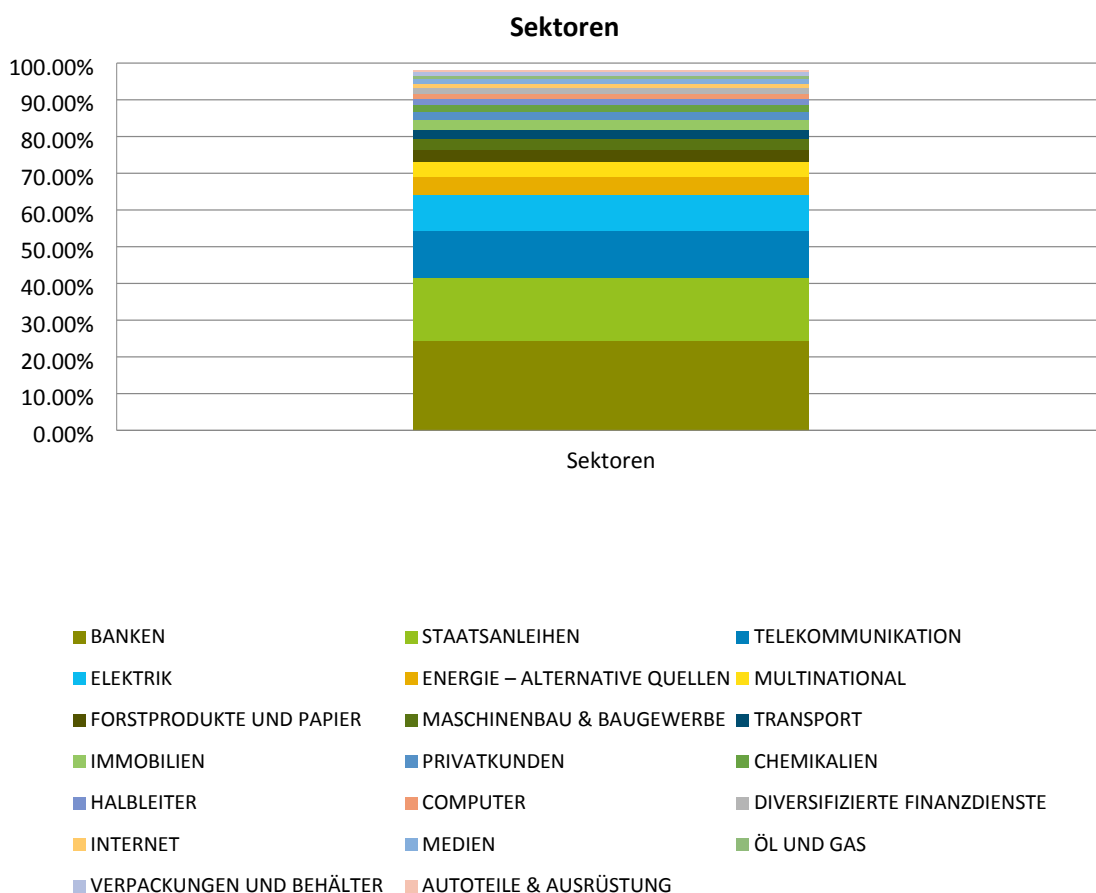
#2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

* Zum 31. Dezember 2023 trugen 40 % der vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei. Nach Auffassung des Anlageverwalters schreibt die SFDR jedoch für jede nachhaltige Investition gemäß SFDR die Berücksichtigung eines einzelnen Umweltziels oder sozialen Ziels vor. Trug daher eine von dem Teilfonds gehaltene nachhaltige Investition gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei, wurde eine solche nachhaltige Investition gemäß SFDR im vorstehenden Diagramm unter „ökologisch“ aufgeführt.

** #2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Banken und Staatsanleihen sowie in den Sektoren Telekommunikation und Elektrizität engagiert, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Aus der Allokation des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR sind jedoch 1 % der nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR mit einem ökologischen Ziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen trugen zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der

Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

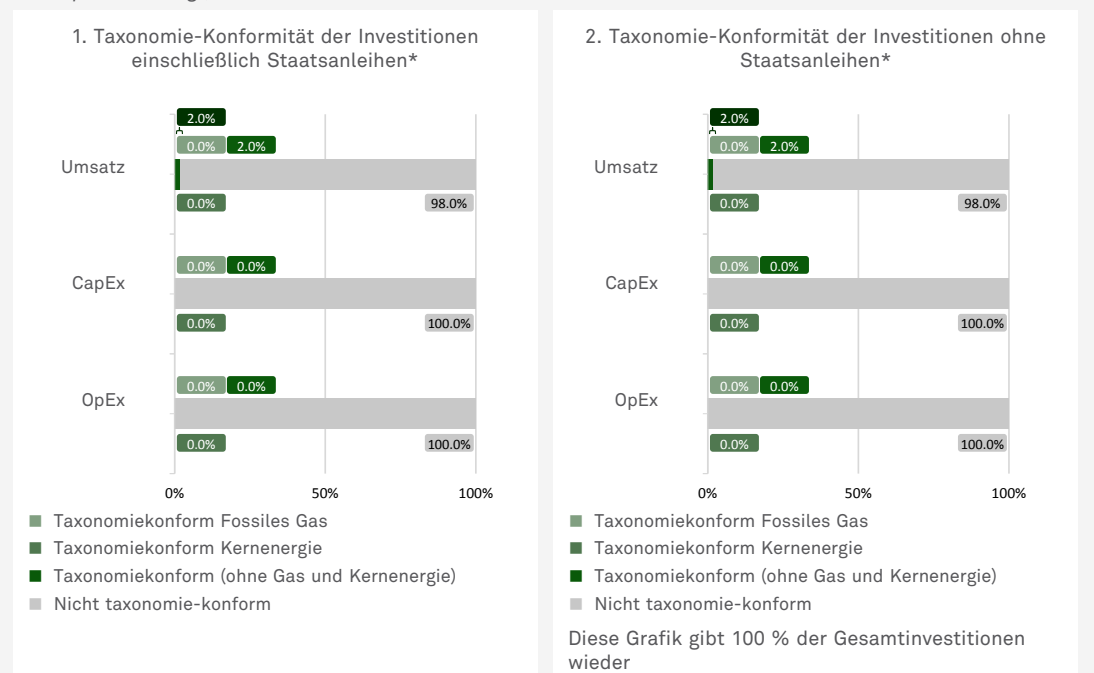
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossilem Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

FD_ Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglicht darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

99 % der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht** berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2023 18 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich gehaltener Barmittelbestände für ergänzende Liquiditätszwecke.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden.
- Derivate (FDI), die zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden folgende Maßnahmen ergriffen, um das nachhaltige Investitionsziel zu erreichen:

Um positive ökologische und/oder soziale Auswirkungen zu erreichen und dabei eine Gesamtrendite bestehend aus Erträgen und Kapitalwachstum zu erzielen durch die Investition in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldittelbezogenen Wertpapieren sowie damit verbundenen FDI, investierte der Teilfonds in Impact Issuers und Use of Proceeds Impact Bonds, für die Folgendes galt:

- (a) im Falle eines jeden solchen Use of Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, wurden die erzielten Erlöse zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen;
- (b) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beizutragen.

Jedes in Frage kommende Wertpapier wurde gemäß dem Bewertungsrahmen des Anlageverwalters bewertet, der darauf abzielt, den Grad des Beitrags zu den UN SDGs zu ermitteln. Für diese Bewertung wurden zwei Rahmenwerke eingesetzt:

- (a) Use of Proceeds Impact Bonds: Der Anlageverwalter verwendete einen Bewertungsrahmen, der im Allgemeinen die folgenden drei Komponenten berücksichtigte: Emittentenprofil, Rahmenwerk für die Anleihenemission sowie Berichterstattung und Transparenz.
- (b) Impact Issuers: Der Anlageverwalter bewertete die Emittenten anhand externer und/oder interner Daten, um festzustellen, inwieweit die Umsätze der Produkte und Dienstleistungen des Emittenten mit den UN SDGs übereinstimmen. Standen keine externen Daten zur Verfügung, wurde eine Bewertung von den ESG-Analysten des Anlageverwalters durchgeführt. Die Bewertungen wurden vom „Impact Committee“ des Anlageverwalters genehmigt.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR im Teilfonds wurden vom Anlageverwalter im Bezugszeitraum durch Einprogrammierung verbindlicher Elemente in die Handelssysteme überwacht.

Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

- Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.
- Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.
- Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds verwendet wurden, erfolgte durch die Responsible Investment Group („RIG“). Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

Unternehmenskennung: 2138009IC4PGITKRBI83

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●●	☐ Ja	●○	☒ Nein
☐	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☒	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von 37,00 % an nachhaltigen Investitionen.
	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
			☒ mit einem sozialen Ziel
☐	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang erfüllt:

- Der Teilfonds bewarb einen ökologischen und/oder sozialen Mindeststandard, der auf die Begrenzung oder Vermeidung von Verfahren abzielte, die der Anlageverwalter als ökologisch und/oder sozial nachteilig erachtete. Um diesen Mindeststandard zu erreichen, wurden Ausschlusskriterien verwendet – wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Teilfonds angegeben. Beispielsweise wurden, wie in den vorvertraglichen Informationen angegeben, Emittenten ausgeschlossen, die einen bestimmten (vom Anlageverwalter festgelegten) Prozentsatz ihres Umsatzes aus den Bereichen Tabak, Rüstung, Glücksspiel, Kohleförderung und der Herstellung umstrittener Waffen bezogen. Emittenten wurden ebenfalls ausgeschlossen, wenn sie nach Ansicht des Anlageverwalters gegen die Mindeststandards für Geschäftspraktiken verstoßen hatten, die in weithin anerkannten globalen Übereinkommen festgelegt sind.
- Der Teilfonds fokussierte sich auf Emittenten mit höheren Werten in Bezug auf ihr ESG-Profil, indem er nicht in Wertpapiere investierte, die nach Maßgabe des Anlageverwalters das niedrigste ESG-Rating (einen Wert von 5) aufwiesen. So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 58 % des Nettoinventarwerts des Portfolios in Emittenten mit einem Rating von 1 und 2 investiert. Der verbleibende Teil war in Emittenten mit einem ESG-Rating von 3 oder 4 oder in Anlagen ohne ESG-Rating investiert (bei denen es sich um liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen einschließlich Barmittel sowie um Derivate (FDI) handelte, die eigens zu

Absicherungszwecken verwendet wurden). Angaben zum vermögensgewichteten Gesamt-ESG-Rating gegenüber dem Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index sind der nächsten Frage zu entnehmen; und

CO₂-Verringerung: Der Fokus des Teilfonds war wie folgt:

- Ein Minimum von 75 % seiner Allokation in Emittenten von Unternehmensanleihen zu investieren, die sich nach Ansicht des Anlageverwalters mindestens dazu verpflichtet haben, das Klimaneutralitätsziel zu erreichen;
- Jährliche Erhöhung der Allokation. Bis Ende 2030 ist der Teilfonds bestrebt, mindestens 85 % seiner Allokation zu Emittenten von Unternehmensanleihen zu investieren, die sich mindestens dazu verpflichtet haben, das Klimaneutralitätsziel zu erreichen. Die Allokation des Teilfonds in Emittenten von Unternehmensanleihen kann zwar im Zeitverlauf variieren, doch konzentrierte sich der Teilfonds darauf, mindestens 51 % seines Nettoinventarwerts in fest- oder variabel verzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating zu investieren;
- Erreichung einer Kohlenstoffintensität auf einem Niveau, das – vom Anlageverwalter definiert und berechnet – mindestens 30 % unter dem Niveau des Referenzwerts von Ende 2020 liegt (der „Kohlenstoffintensität im Ausgangsjahr“);
- Der Anlageverwalter zielt darauf ab, die Kohlenstoffintensität des Teilfonds jedes Jahr zu verringern – und zwar auf ein Niveau, das 40 % unter der Kohlenstoffintensität im Ausgangsjahr liegt, bis spätestens Ende 2030.

Außerdem investierte der Teilfonds in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR (wie vom Anlageverwalter festgelegt) („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind und die nach Auffassung des Anlageverwalters positiv zum Erreichen der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beitragen. Der Teilfonds hatte zum 31. Dezember 2023 37 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft werden.

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie,
- Industrie, Innovation und Infrastruktur,
- Nachhaltige Städte und Gemeinden,
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion,
- Klimaschutzmaßnahmen,
- Leben unter Wasser,
- Leben an Land,
- Partnerschaften zur Erreichung des Ziels.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass dieser Teilfonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewirbt und nachhaltige Investition nicht zu seinen Anlagezielen gehören. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

Nach Ansicht des Anlageverwalters trugen diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen

- Hochwertige Bildung
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 37 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des Mindestanteils).
- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:

(a) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 20 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen;

(b) im Falle eines jeden solchen Use-of-Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen.

– ESG-Rating: Das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Teilfonds, wie vom Anlageverwalter bestimmt, war zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter als das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index (der „Referenzwert“). So lag das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Teilfonds zum vorstehend angegebenen Geschäftsjahresende des Teilfonds beispielsweise bei 2,2 gegenüber einem Wert des Referenzwerts von 2,3 (wobei 1 = am besten, 5 = am schlechtesten ist).

– CO2-Verringerung: Der Teilfonds hat erfolgreich:

– Ein Minimum von 75 % seiner Allokation zu Emittenten von Unternehmensanleihen investiert, die sich nach Ansicht des Anlageverwalters mindestens dazu verpflichtet haben, das Klimaneutralitätsziel zu erreichen;

– Die Allokation wurde jedes Jahr erhöht. Bis Ende 2030 ist der Teilfonds bestrebt, mindestens 85 % seiner Allokation zu Emittenten von Unternehmensanleihen zu investieren, die sich mindestens dazu verpflichtet haben, das Klimaneutralitätsziel zu erreichen. Die Allokation des Teilfonds zu Emittenten von Unternehmensanleihen kann zwar im Zeitverlauf variieren, doch hat der Teilfonds mindestens 51 % seines Nettoinventarwerts in fest- oder variabel verzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating investiert;

– Eine Kohlenstoffintensität auf einem Niveau erreicht, das – vom Anlageverwalter definiert und berechnet – mindestens 30 % unter dem Niveau des Referenzwerts von Ende 2020 liegt (der „Kohlenstoffintensität im Ausgangsjahr“);

Der Anlageverwalter wird es anstreben, die Kohlenstoffintensität des Teilfonds jedes Jahr zu verringern – und zwar auf ein Niveau, das 40 % unter der Kohlenstoffintensität im Ausgangsjahr liegt, bis spätestens Ende 2030.

– Ausschlusspolitik: Der Teilfonds hat seine Ausschlusspolitik wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds zu erfüllen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

– Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (UN SDGs)

1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022:

Der Fonds hat erfolgreich und kontinuierlich mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen investiert. Dabei waren zum Jahresende des Fonds am 31. Dezember 2022 31 % des Nettoinventarwerts in nachhaltigen Investitionen investiert.

1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023:

Der Fonds hat erfolgreich und kontinuierlich mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen investiert. Dabei waren zum Jahresende des Fonds am 31. Dezember 2023 37 % des Nettoinventarwerts in nachhaltigen Investitionen investiert.

– ESG-Rating

1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022:

Das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Fonds war zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter als das vermögensgewichtete Gesamtrating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index.

Das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Fonds lag bei 1,8 gegenüber dem Wert des Referenzwerts von 1,9.

1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023:

Das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Fonds war zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter als das vermögensgewichtete Gesamtrating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index.

Das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Fonds lag bei 2,2 gegenüber dem Wert des Referenzwerts von 2,3.

– Kohlenstoffintensität

1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022:

Die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Fonds war erfolgreich und beständig um mindestens 25 % niedriger als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index.

1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023:

Die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Fonds war erfolgreich und beständig um mindestens 25 % niedriger als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index.

– Ausschlusspolitik

1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022:

Der Fonds hat seine Ausschlusspolitik wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Fonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023:

Der Fonds hat seine Ausschlusspolitik wie im jeweils geltenden Nachtrag für den Fonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angegeben erfolgreich und beständig eingehalten.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, die der Teilfonds teilweise tätigte, bestand in positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR des Teilfonds trugen zu Umweltzielen oder sozialen Zielen bei durch Investitionen in:

Use-of-Proceeds Impact Bonds: Die Erlöse wurden verwendet, um Projekte mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen zu finanzieren oder zu refinanzieren, wobei die UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele herangezogen wurden. Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

– Bezahlbare und saubere Energie

- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land
- Partnerschaften zur Erreichung des Ziels

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Kein Hunger
- Gesundheit und Wohlergehen
- Hochwertige Bildung
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten

Von Impact Issuers emittierte Schuldtitel: Mindestens 20 % der Umsatzströme dieser Investitionen standen anhand der UN SDGs als Richtschnur für Umweltziele in Zusammenhang mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen. Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
- Gesundheit und Wohlergehen
- Geschlechtergleichheit
- Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Weniger Ungleichheiten
- Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investitionen nicht ausdrücklich berücksichtigt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAIs aus:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat
 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen und ausschließlich im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das vom Teilfonds gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.
- Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI-Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die vorstehend angegebenen PAIs, soweit praktisch durchführbar, wie in der Antwort auf die vorstehende Frage „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“ beschrieben. Plus der folgenden zusätzlichen PAIs:

- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 16. Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung.

Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für das gehaltene Instrument festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden.

Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an diesen Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Anlage und fortlaufend während des oben genannten Zeitraums anhand von Daten festzustellen, die von bestimmten externen Datenanbietern des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen

Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Ford Moto 4.867% 08/03/27	AUTOHERSTELLER	0,83 %	USA
Unicaja B VAR 11/15/27	BANKEN	0,81 %	SPA
BPCE SA 0.375% 02/02/26	BANKEN	0,7 %	FRC
Comcast C 4.65% 02/15/33	MEDIEN	0,68 %	USA
Enel Fina 0.25% 11/17/25	ELEKTRIK	0,66 %	ITL
RCI Banqu 4.875% 10/02/29	AUTOHERSTELLER	0,66 %	FRC
UBS GROUP 1.5% 11/30/24	BANKEN	0,65 %	SWI
BNP Parib VAR 09/26/32	BANKEN	0,65 %	FRC
Deutsche 3.875% 09/28/33	DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTE	0,64 %	GER
Banque Fe VAR 06/16/32	BANKEN	0,63 %	FRC
Eurogrid 3.279% 09/05/31	ELEKTRIK	0,63 %	GER
UBS Group VAR 04/02/26	BANKEN	0,63 %	SWI
Morgan St VAR 01/25/34	BANKEN	0,61 %	USA
Stellanti 4.375% 03/14/30	AUTOHERSTELLER	0,6 %	USA
Raiffeise 4.125% 09/08/25	BANKEN	0,59 %	AUS



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

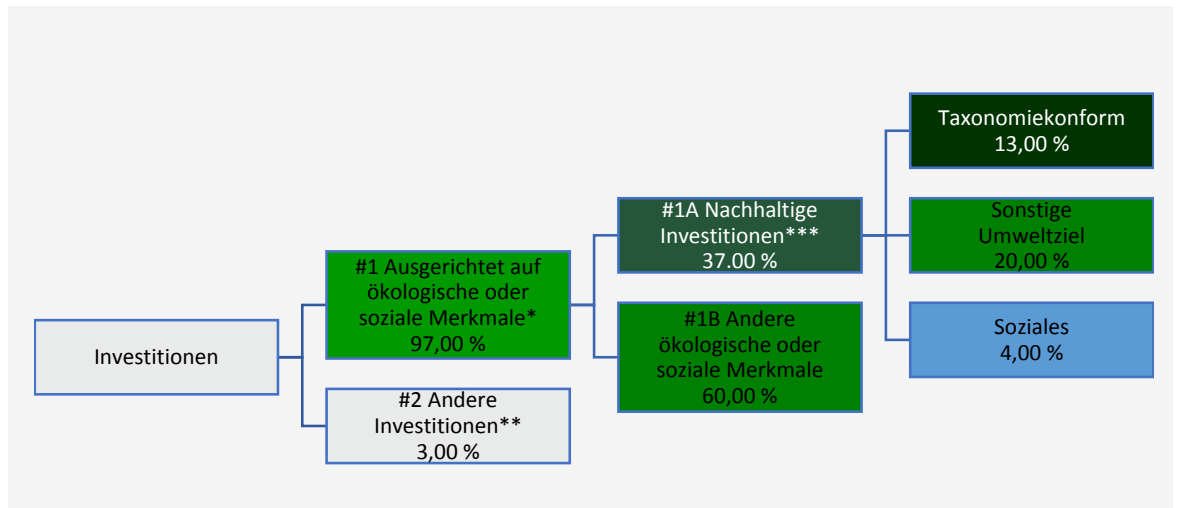
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Teilfonds bewarb im Bezugszeitraum ökologische oder soziale Merkmale durch einen ausschließenden Ansatz und Allokationen in bestimmten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR, Emittenten mit besseren Werten und Emittenten mit geringerer Kohlenstoffintensität.

Die Angaben in #1 stellen eine Kombination aus beiden Ansätzen dar. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1A angegeben. Der nachstehende Zahlenwert unter #1B stellt den Portfolioanteil dar, den der Anlageverwalter nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet, jedoch bestimmte Arten von Investitionen ausgeschlossen hat, wie in den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie im Nachtrag angegeben. Daher war dieser Anteil des Portfolios, weil er keine solchen Investitionen enthielt, auf die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie in der nachstehenden Grafik angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

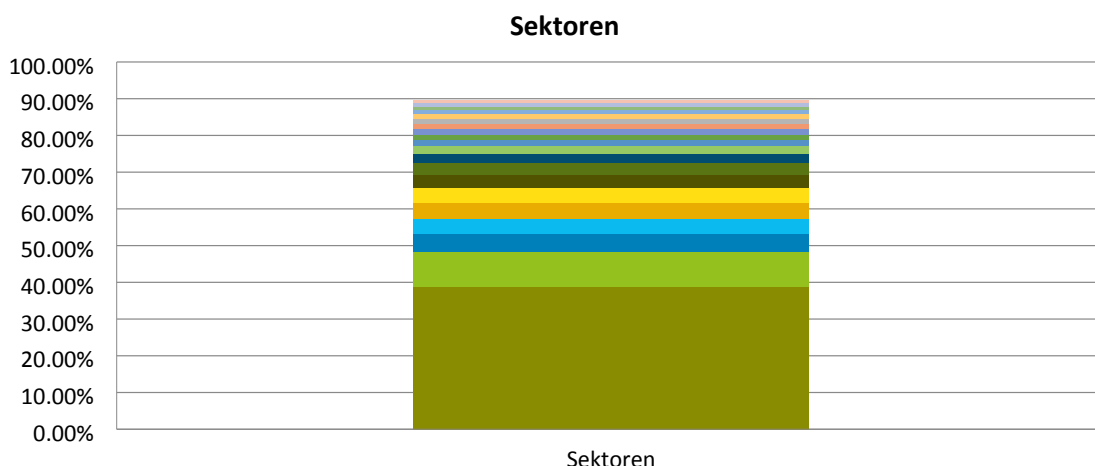
* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Investitionen zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass zu diesen Investitionen nur begrenzte Daten vorlagen. Daher war die Datenabdeckung für manche Investitionen des Teilfonds (etwa zum CO₂-Fußabdruck) sehr gering und in Ermangelung relevanter Daten ging der Anlageverwalter davon aus, dass solche Investitionen auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

** #2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht auf die mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

*** Zum 31. Dezember 2023 trugen 23 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei. Nach Auffassung des Anlageverwalters schreibt die SFDR jedoch für jede nachhaltige Investition gemäß SFDR die Berücksichtigung eines einzelnen Umweltziels oder sozialen Ziels vor. Trug daher eine von dem Teilfonds gehaltene nachhaltige Investition gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei, wurde eine solche nachhaltige Investition gemäß SFDR in der vorstehenden Grafik unter „ökologisch“ aufgeführt.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Banken und Elektrik sowie im Sektor gewerbliche Dienstleistungen engagiert, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Aus den Allokationen des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR waren jedoch 35 % der nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die taxonomiekonformen Investitionen trugen zu mindestens einem oder beiden der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Die Verfügbarkeit, Genauigkeit und Qualität der Daten hatten Auswirkungen darauf, inwieweit eine solche Anpassung in Betracht gezogen werden konnte. Insbesondere die unzureichende Berichterstattung von Informationen, auch in Bezug auf einige Unternehmen, in die der Teilfonds investiert hatte, bedeutete, dass nur begrenzte Daten zum Nachweis der Konformität mit der EU-Taxonomie oder keine ausreichenden Daten zum Ausfüllen bestimmter Abschnitte dieses Anhangs vorhanden waren. Die Analyse der Konformität mit der EU-Taxonomie durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der Konformität durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umwelt-freund-lichen Tätigkeiten der Unter-nehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitions-ausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

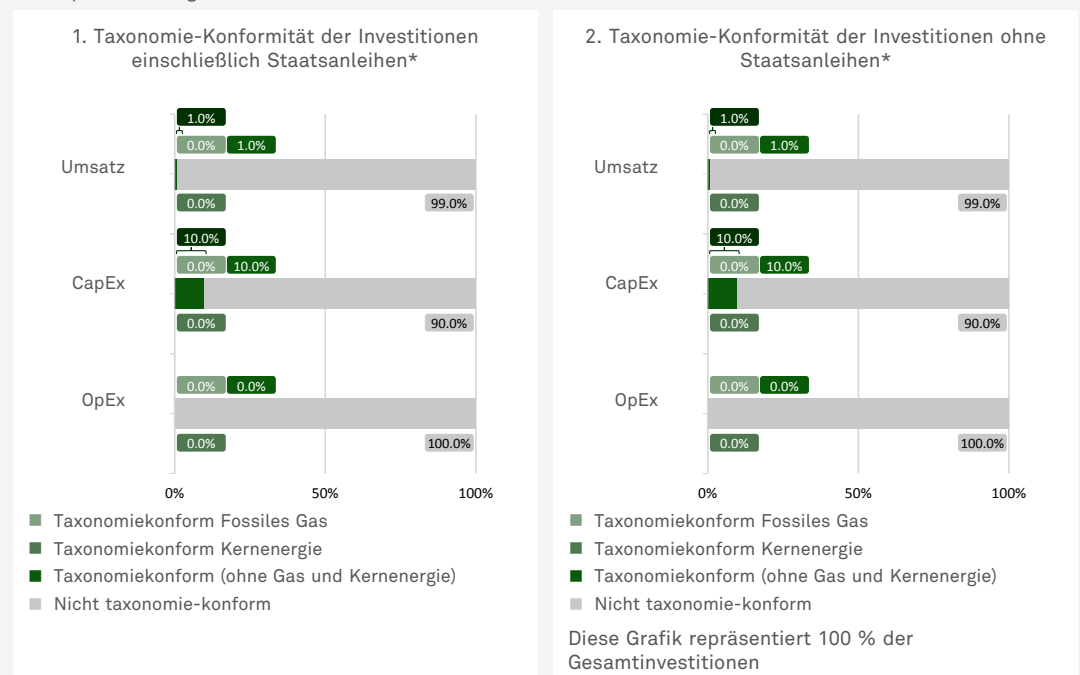
– **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten
sind Tätigkeiten, für
die es noch keine
CO₂-armen
Alternativen gibt und
die unter anderem
Treibhausgasemissi-
onswerte aufweisen,
die den besten
Leistungen
entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

65 % der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Die Verfügbarkeit, Genauigkeit und Qualität der Daten hatten Auswirkungen darauf, inwieweit eine solche Anpassung in Betracht gezogen werden konnte. Insbesondere die unzureichende Berichterstattung von Informationen, auch in Bezug auf einige Unternehmen, in die der Teilfonds investiert hatte, bedeutete, dass nur begrenzte Daten zum Nachweis der Konformität mit der EU-Taxonomie oder keine ausreichenden Daten zum Ausfüllen bestimmter Abschnitte dieses Anhangs vorhanden waren. Die Analyse der Konformität mit der EU-Taxonomie durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der Konformität durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2023 4 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Andere Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich Barmittel, die gehalten oder für ergänzende Liquiditätszwecke eingesetzt wurden.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die spezifisch zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden
- Derivate (FDI), die spezifisch zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale folgende Maßnahmen ergriffen:

– Der Anlageverwalter:

(a) Investierte in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „Nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ (wie vom Anlageverwalter festgelegt) erachtet wurden.

(b) Stellte sicher, dass das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Teilfonds, wie vom Anlageverwalter bestimmt, zu keinem Zeitpunkt im Bezugszeitraum schlechter war als das vermögensgewichtete Gesamt-ESG-Rating des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index (der „Referenzwert“).

(c) Stellte sicher, dass die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Teilfonds um mindestens 25 % niedriger war als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Referenzwerts im Bezugszeitraum.

(d) Setzte eine Ausschlusspolitik ein wie im Nachtrag für den Teilfonds und im Anhang zum Nachtrag für den Teilfonds angeben.

Diese verbindlichen Elemente des Teilfonds wurden in die Handelssysteme einprogrammiert und herangezogen, um die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale im Bezugszeitraum zu überwachen.

– Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.

Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung der beworbenen Merkmale verwendet werden, erfolgte durch die Responsible Investment Group. Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen. Die Überwachung interner Ausschlusslisten, die herangezogen werden, um die Erfüllung bestimmter verbindlicher Kriterien sicherzustellen, wurden von der Ratings and Exclusions Group („REG“) bereitgestellt, einer internen Gruppe des Anlageverwalters, die für Unternehmensführung zuständig ist.

– Im Bezugszeitraum war eine Mitwirkung bei den Emittenten, in die der Teilfonds investiert, weder erforderlich, noch wurde sie unternommen, weil es nicht zu Verstößen gegen verbindliche Elemente gekommen war, die im Nachtrag für den Teilfonds aufgeführt sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte

Name des Produkts: Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

Unternehmenskennung: 2138006IFGV5VYOFVZ45

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswegen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☒ Ja	●○ ☐ Nein
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 91,00 %	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Mindestanteil von ____% an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☒ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 8,00 %	☐ mit einem sozialen Ziel
	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel dieses Teilfonds besteht darin, positive ökologische und/oder soziale Auswirkungen zu erreichen und dabei eine Gesamtrendite bestehend aus Erträgen und Kapitalwachstum zu generieren, indem er in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldtitelbezogenen Wertpapieren sowie in darauf bezogene FDI investiert.

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Bezugszeitraum“) in folgendem Umfang durch Investitionen in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuer erreicht, die nach Ansicht des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR („nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“) einzustufen sind:

– Im Falle eines jeden solchen Use of Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investiert war, sollten die Erlöse ausschließlich zur gänzlichen oder teilweisen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen verwendet werden, die durch Beiträge unterschiedlichen Umfangs eindeutig auf die folgenden Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals, „UN SDGs“) ausgerichtet sind (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Industrie, Innovation und Infrastruktur
- Nachhaltige Städte und Gemeinden

- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
- Klimaschutzmaßnahmen
- Leben unter Wasser
- Leben an Land
- Partnerschaften zur Erreichung des Ziels

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Keine Armut
 - Kein Hunger
 - Gute Gesundheit und Wohlergehen
 - Hochwertige Bildung
 - Geschlechtergleichheit
 - Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
 - Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
 - Weniger Ungleichheiten
 - Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen
- Ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investiert war, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme mit positiven ökologischen und/oder sozialen Tätigkeiten in Verbindung standen, die zu den folgenden UN SDGs beitrugen (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit Umweltzielen erachtet werden):
- Verantwortungsbewusste(r) Konsum und Produktion
 - Nachhaltige Städte und Gemeinden
 - Industrie, Innovation und Infrastruktur

Diese nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR trugen auch in unterschiedlichem Umfang zu einem oder mehreren der folgenden UN SDGs bei (die für die Zwecke dieses Abschnitts vom Anlageverwalter auch als gleichbedeutend mit sozialen Zielen erachtet werden):

- Bezahlbare und saubere Energie
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Gute Gesundheit und Wohlergehen

Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum nicht in Improving Issuers (wie in Anhang III zur SFDR beschrieben).

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR können in einigen Fällen zu einigen der in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung genannten Umweltziele beigetragen haben. Dies wurde jedoch vom Anlageverwalter bei seiner Bewertung der Investition nicht ausdrücklich berücksichtigt.

Bitte beachten Sie, dass der Teilfonds ein nachhaltiges Anlageziel verfolgt. Es besteht keine Verpflichtung oder Mindestallokation zu nachhaltigen Investitionen mit ökologischen Zielen, die mit der EU-Taxonomie-Verordnung übereinstimmen. Allerdings enthält dieser Anhang bestimmte Informationen in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie von relevanten nachhaltigen Anlagen mit ökologischen Zielen, die der Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehalten hat.

Insofern beziehen sich die Angaben zur Anpassung an die EU-Taxonomie auf das oben genannte Datum und spiegeln nicht die Situation zu anderen Zeitpunkten während des Bezugszeitraums wider (sie können sich wesentlich unterscheiden).

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Es wurden die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren eingesetzt, um zu messen, inwieweit das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds erreicht wurde:

- 1) Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 99 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des in Anhang III der SFDR festgelegten Mindestanteils).

- 2) Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten:

(a) solche Impact Issuers haben nachgewiesen, dass mindestens 50 % ihrer Einnahmen auf die Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ausgerichtet waren oder mindestens 50 % ihrer Wirtschaftstätigkeiten mit der EU-Taxonomie-Verordnung in Einklang standen.

(b) im Falle von Use of Proceeds Impact Bonds sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen beigetragen haben und/oder als „ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten“ im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung definiert sind.

Im Bezugszeitraum wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds zu erreichen.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Berichtszeitraum	Nachhaltige Investitionen	Impact Issuers/Bonds
10. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022	Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 insgesamt 93 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2022. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des in Anhang III der SFDR festgelegten Mindestanteils).	Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten: (a) Ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung („UN SDGs“) beizutragen; (b) im Falle eines jeden solchen Use of Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, sollten die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen.

Berichtszeitraum	Nachhaltige Investitionen	Impact Issuers/Bonds
1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023	Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum erfolgreich und beständig mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in Use of Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers, die jeweils als „nachhaltige Investitionen gemäß SFDR“ erachtet wurden (wie vom Anlageverwalter bestimmt). So waren beispielsweise am Geschäftsjahresende des Teilfonds zum 31. Dezember 2023 insgesamt 99 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in solche Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert. Diese Prozentangabe erfolgt nur zum 31. Dezember 2023. Der auf diese Weise investierte Prozentsatz schwankte im Verlauf des Bezugszeitraums (blieb während des Bezugszeitraums aber jederzeit oberhalb des in Anhang III der SFDR festgelegten Mindestanteils.	Die Impact Issuers und Use-of-Proceeds Impact Bonds, in die der Teilfonds erfolgreich und beständig investierte, entsprachen nach Bewertung des Anlageverwalters den folgenden Schwellenwerten: (a) Solche Impact Issuers haben nachgewiesen, dass mindestens 50 % ihrer Einnahmen auf die Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ausgerichtet war oder mindestens 50 % ihrer Wirtschaftstätigkeiten mit der EU-Taxonomie-Verordnung in Einklang gestanden haben. (b) Im Falle von Use of Proceeds Impact Bonds sollen die erzielten Erlöse ausschließlich zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet werden, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen beitragen und/oder als „ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten“ im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung definiert sind.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Während des Bezugszeitraums beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Maßgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäß SFDR handelte, die ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzen.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Während des Bezugszeitraums wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang im Hinblick auf die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds gemäß SFDR wie folgt berücksichtigt:

- Tabelle 1 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
 1. THG-Emissionen: Scope 1, 2 und 3
 2. CO₂-Fußabdruck: Scope 1, 2 und 3
 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird: Scope 1, 2 und 3
 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren: NACE A, B, C, D, E, F, G, H und L
 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
 8. Emissionen in Wasser
 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.
 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
 13. Geschlechtervielfalt im Verwaltungsrat

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen).

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs folgendermaßen im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR:

- Vom Anlageverwalter wurden auf Emittenten- und/oder Teilfondsebene gegebenenfalls PAI-Schwellenwerte für vom Teilfonds gehaltene Instrumente festgelegt. Die PAI-Schwellenwerte wurden nur auf die Positionen des Teilfonds in Unternehmens- und Staatsanleihen angewandt.
- Der Anlageverwalter hat die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, an den PAI-Schwellenwerten gemessen, was dann gegebenenfalls eine zusätzliche qualitative Überprüfung ausgelöst hat, um die Überschreitung der PAI-Schwellenwerte zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend festzustellen, und zwar anhand von Daten, die vom angegebenen Drittdatenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigen zu können. Die Verfügbarkeit und die Qualität dieser Daten hatte Auswirkungen auf das Ausmaß, in dem jede dieser PAI berücksichtigt werden konnte. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Emittenten zu Kennzahlen hatte zur Folge, dass nur begrenzte Daten zu einigen negativen Indikatoren vorlagen. Für einige der obligatorischen PAIs war die Datenabdeckung daher gering. Die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter stützte sich auf diese Informationen und Daten Dritter. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der negativen Indikatoren durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt. Da sich die Datenverfügbarkeit im Laufe der Zeit verbessert, wird davon ausgegangen, dass die PAIs auf einen größeren Teil des Anlageuniversums des Anlageverwalters angewendet werden können. Dies ermöglicht einen besseren Einblick in die von den Emittenten verursachten nachteiligen Auswirkungen.

● *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?*

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, einschließlich der Grundprinzipien und Rechte aus den acht Kernübereinkommen, die in der Erklärung der Internationalen Arbeitsorganisation über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit festgelegt sind (die „verantwortungsbewussten Geschäftspraktiken“), decken zusammengefasst ein breites Spektrum von Bereichen der verantwortungsvollen Unternehmensführung ab, das Arbeitnehmerrechte, Verbraucherschutz und die Unterstützung der international anerkannten Menschenrechte im Einflussbereich eines Unternehmens oder Emittenten einschließt.

Die Investitionen des Teilfonds, die nach Maßgabe des Anlageverwalters nachhaltige Investitionen gemäß SFDR darstellen, wurden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da alle Emittenten ein von einer dritten Partei bereitgestelltes umfassendes Kontroversen-Screening bestanden, das entweder direkt eine oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken abdeckte oder vom Anlageverwalter als angemessener Ersatz für einen oder mehrere der Grundsätze verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken angesehen wurde. Für die Durchführung des umfassenden Kontroversen-Screenings war der Anlageverwalter auf die einem solchen Dritten verfügbaren Informationen und Daten angewiesen. Zu beachten ist dabei, dass sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten auf den Screening-Prozess ausgewirkt haben kann.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte PAIs im Rahmen seiner Analyse zur Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen über nachhaltige Investitionen gemäß SFDR wie in der Antwort auf die vorstehende Frage „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“ beschrieben.

Der Teilfonds berücksichtigte ferner die folgenden PAIs:

- Tabelle 2 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen.
- Tabelle 3 in Anhang I der Delegierten Verordnung der Kommission:
- 16. Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Es wurden keine der vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BUNDES 0% 08/15/31	STAATSANLEIHEN	2,3 %	GER
BNP Parib VAR 01/13/29	BANKEN	2,24 %	FRC
Enel Fina 1.125% 09/16/26	ELEKTRIK	2,07 %	ITL
HSBC HOLD VAR 12/04/24	BANKEN	2,0 %	UKK
Engie SA VAR 11/30/72	ELEKTRIK	1,73 %	FRC
Credit Su 0.45% 05/19/25	BANKEN	1,62 %	SWI
Digital I 1.375% 07/18/32	REITS	1,55 %	USA
Danske Ba VAR 11/09/28	BANKEN	1,49 %	DEN
VESTEDA F 1.5% 05/24/27	IMMOBILIEN	1,4 %	NET
Bank of I VAR 05/10/27	BANKEN	1,4 %	IRE
ABN AMRO 0.5% 09/23/29	BANKEN	1,35 %	NET
E.ON Inte 1.25% 10/19/27	ELEKTRIK	1,34 %	GER
Vonovia S 0.625% 03/24/31	IMMOBILIEN	1,32 %	GER
Suez SACA 5% 11/03/32	WASSER	1,27 %	FRC
Banque Fe 4% 11/21/29	BANKEN	1,24 %	FRC



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

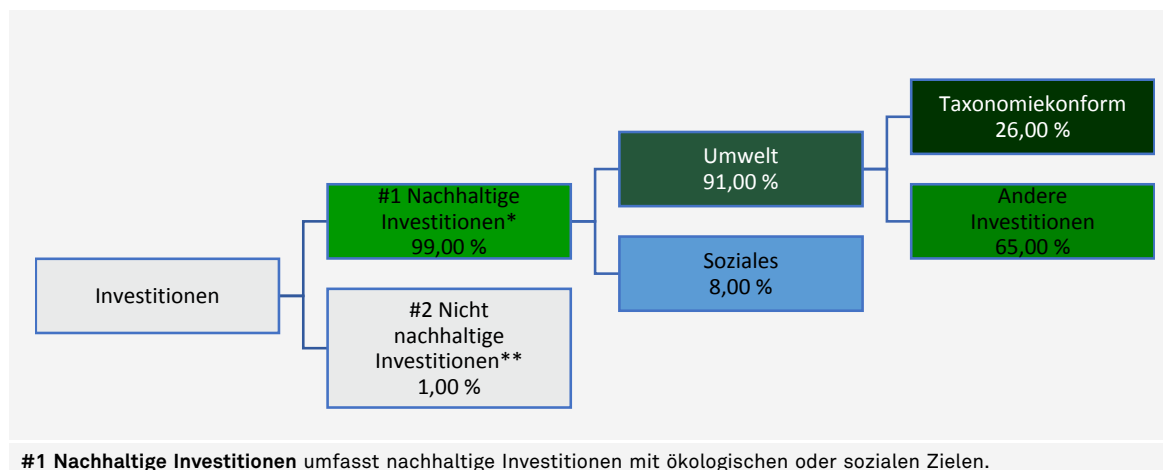
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mit dem Teilfonds wurden nachhaltige Investitionen angestrebt und er war verpflichtet, mindestens insgesamt 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel und/oder sozialen Ziel zu investieren.

Zum 31. Dezember 2023 waren beispielsweise insgesamt 99 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel und/oder sozialen Ziel investiert, sodass der im Nachtrag für den Teilfonds angegebene Mindestanteil überschritten wurde. Die Allokation in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR ist in #1 angegeben.

Zu beachten ist, dass die Prozentangaben in diesem Abschnitt wie in der nachstehenden Grafik angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2023 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).



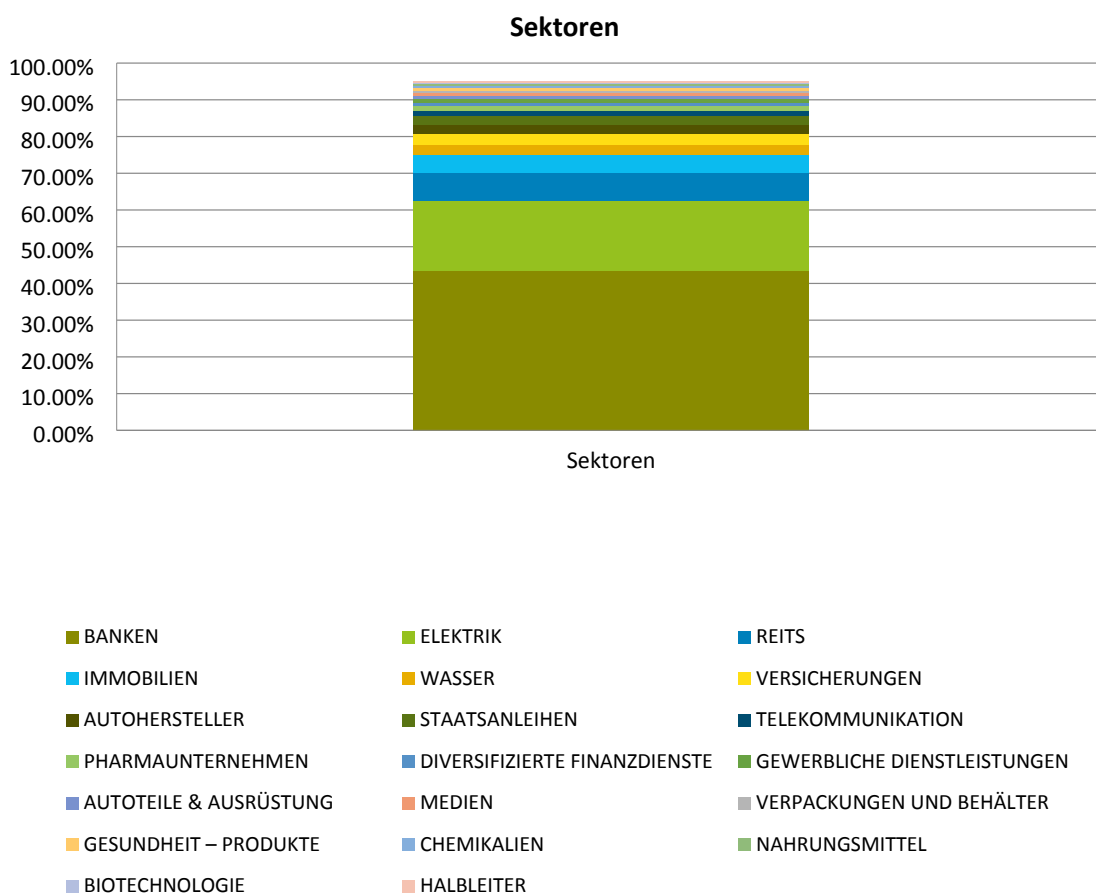
#2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

* Zum 31. Dezember 2023 trugen 59 % der vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei. Nach Auffassung des Anlageverwalters schreibt die SFDR jedoch für jede nachhaltige Investition gemäß SFDR die Berücksichtigung eines einzelnen Umweltziels oder sozialen Ziels vor. Trug daher eine von dem Teilfonds gehaltene nachhaltige Investition gemäß SFDR zu einem Umweltziel und sozialen Ziel bei, wurde eine solche nachhaltige Investition gemäß SFDR in der vorstehenden Grafik unter „ökologisch“ aufgeführt.

** #2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen gemäß SFDR eingestuft sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?“ zu entnehmen.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Zum 31. Dezember 2023 war der Teilfonds überwiegend im Bankensektor und im Sektor Elektrik sowie in REITs, Immobilien und dem Wassersektor engagiert, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, Investitionen zu tätigen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind. Aus den Allokation des Teilfonds zu nachhaltigen Anlagen gemäß der SFDR sind jedoch 29 % der nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel zum 31. Dezember 2023 auf die EU-Taxonomie ausgerichtet.

Die mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen trugen zu mindestens einem der in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 aufgeführten Umweltziele bei.

1. Klimaschutz.
2. Anpassung an den Klimawandel.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der

Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie ¹ investiert?**

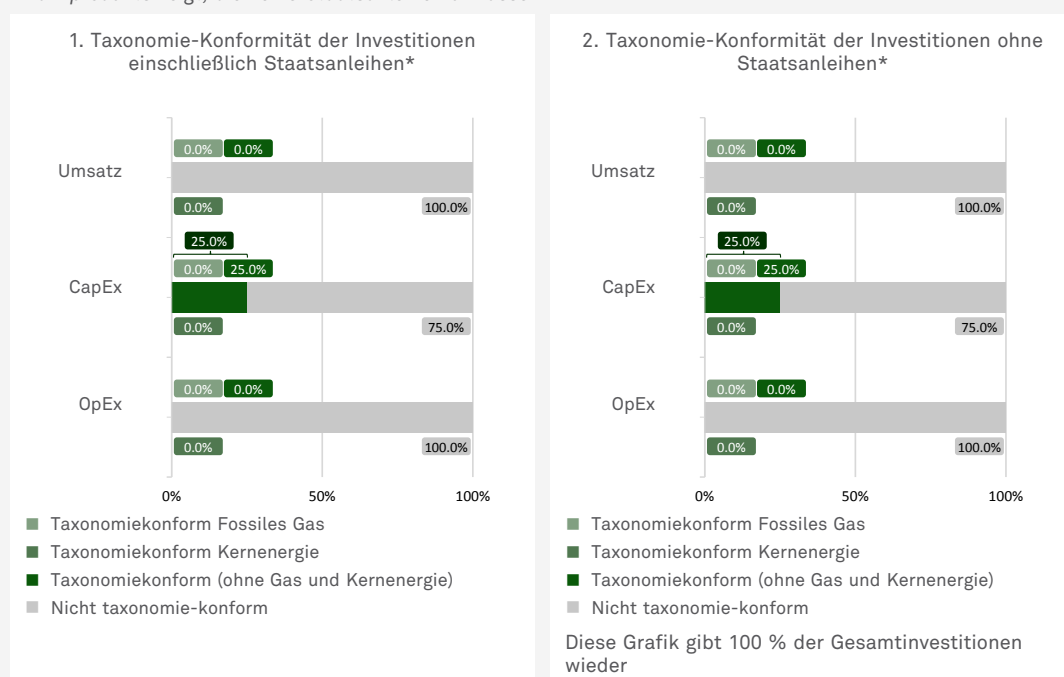
- ☐ Ja:
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
☒ Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomekon-forme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
– **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
– **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Beschränkung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – bitte beachten Sie die Erläuterungen am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundene Wirtschaftstätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmäßigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

71 % der nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2023 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von externen Datenanbietern angewiesen, um die Anpassung der relevanten Anlagen an die EU-Taxonomie beurteilen zu können. Obwohl die Quelle der angegebenen Informationen und Daten als zuverlässig angesehen wird, kann der Anlageverwalter nicht für die Vollständigkeit, Richtigkeit und Qualität dieser Informationen und Daten garantieren. Waren solche Informationen von externen Datenanbietern nicht verfügbar oder wurden sie als unvollständig angesehen war die Analyse der Anpassung der Anlagen durch den Anlageverwalter notwendigerweise eingeschränkt. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind zum jetzigen Zeitpunkt und für den Bezugszeitraum die verfügbaren Daten nach wie vor begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

Alle Zahlen und Angaben in Bezug auf die Konformität mit der EU-Taxonomie in diesem Anhang spiegeln die Positionen des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums wider. Es wurden dabei die neuesten Daten verwendet, die zum 29. Januar 2024 von relevanten externen Anbietern zur Verfügung standen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber zum 31. Dezember 2023 8 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäß SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschließlich dem Stand vom 31. Dezember 2023. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ aufgeführten Investitionen waren:

- Liquide und liquide barmittelähnliche Anlagen, einschließlich gehaltener Barmittelbestände für ergänzende Liquiditätszwecke.
- Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA), die zu Liquiditätszwecken eingesetzt wurden.
- Derivate (FDI), die zu Absicherungszwecken eingesetzt wurden.

Für diese Investitionen wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden folgende Maßnahmen ergriffen, um das nachhaltige Investitionsziel zu erreichen:

Um positive ökologische und/oder soziale Auswirkungen zu erreichen und dabei eine Gesamtrendite bestehend aus Erträgen und Kapitalwachstum zu erzielen durch die Investition in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldtitelbezogenen Wertpapieren sowie damit verbundenen FDI, investierte der Teilfonds in Impact Issuers und Use of Proceeds Impact Bonds, für die Folgendes galt:

(a) im Falle eines jeden solchen Use of Proceeds Impact Bond, in den der Teilfonds investierte, wurden die erzielten Erlöse zur teilweisen oder vollständigen Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten verwendet, die nachweislich zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beitrugen;

(b) ein jeder solcher Impact Issuer, in den der Teilfonds investierte, konnte nachweisen, dass mindestens 50 % seiner Umsatzströme darauf ausgerichtet waren, zur Verwirklichung eines oder mehrerer der 17 UN SDGs beizutragen.

Jedes in Frage kommende Wertpapier wurde gemäß dem Bewertungsrahmen des Anlageverwalters bewertet, der darauf abzielt, den Grad des Beitrags zu den UN SDGs zu ermitteln. Für diese Bewertung wurden zwei Rahmenwerke eingesetzt:

(a) Use of Proceeds Impact Bonds: Der Anlageverwalter verwendete einen Bewertungsrahmen, der im Allgemeinen die folgenden drei Komponenten berücksichtigte: Emittentenprofil, Rahmenwerk für die Anleihenemission sowie Berichterstattung und Transparenz.

(b) Impact Issuers: Der Anlageverwalter bewertete die Emittenten anhand externer und/oder interner Daten, um festzustellen, inwieweit die Umsätze der Produkte und Dienstleistungen des Emittenten mit den UN SDGs übereinstimmen. Standen keine externen Daten zur Verfügung, wurde eine Bewertung von den ESG-Analysten des Anlageverwalters durchgeführt. Die Bewertungen wurden vom „Impact Committee“ des Anlageverwalters genehmigt.

Die nachhaltigen Investitionen gemäß SFDR im Teilfonds wurden vom Anlageverwalter im Bezugszeitraum durch Einprogrammierung verbindlicher Elemente in die Handelssysteme überwacht.

Für diese Überwachung verwendete der Anlageverwalter im Bezugszeitraum die folgenden internen Kontrollmechanismen:

– Warnungen vor dem Handel erschienen im Handelssystem, um die Portfoliomanager über ein Verbot oder eine Beschränkung zu informieren.

– Warnungen im Anschluss an einen Handel wurden ebenfalls vom Monitoring Team überprüft und gegebenenfalls eskaliert.

– Die Überwachung der Relevanz der Kriterien, die zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds verwendet wurden, erfolgte durch die Responsible Investment Group („RIG“). Dabei handelt es sich um eine interne Governance-Gruppe des Anlageverwalters, die für die Gesamtaufsicht über die Sicherstellung der effektiven Umsetzung der ESG-Due-Diligence (Sorgfaltsprüfung) auf Ebene der Anlageklassen zuständig ist und die Kriterien festlegt, die von den „Responsible Horizons“-Strategien des Anlageverwalters eingehalten werden müssen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Referenzwert bestimmt, um die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

● Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

