



Geprüfter Jahresbericht und -abschluss

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022



HINWEIS: Bitte beachten Sie, dass für die weiteren Teilfonds BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund, BNY Mellon Dynamic Total Return Fund, BNY Mellon Efficient Euro High Yield Beta Fund, BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund, BNY Mellon S&P 500® Index Tracker, 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 Floating Rate Credit Fund und BNY Mellon Asia Rising Stars 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	47
GESAMTERGEBNISRECHNUNG	306
BILANZ	326
VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS, DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN, PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST	344
ERLÄUTERUNGEN ZUM JAHRESABSCHLUSS	354
BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (UNGEPRÜFT)	622
ANHANG 1: OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (UNGEPRÜFT)	673
ANHANG 2: ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (UNGEPRÜFT)	675
ANHANG 3: VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE- VERORDNUNG (UNGEPRÜFT)	697
VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN	868
WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)	870

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 2022 51 aktive Fonds (31. Dezember 2021: 49).

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

Fund	Anlageverwalter	Auflegungsdatum
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	9. März 2012
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Januar 2011
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Mai 2019
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund ⁽¹⁾	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	10. Januar 2017
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 LLC*	19. Februar 2019
BNY Mellon Brazil Equity Fund	ARX Investimentos Ltd	31. August 2007
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	Newton Investment Management North America LLC*	18. November 2021
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund ⁽²⁾	Mellon Investments Corporation	15. Mai 2015
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Newton Investment Management North America LLC*	3. November 2017
BNY Mellon Efficient Euro High Yield Beta Fund^	Insight North America LLC	–
BNY Mellon Efficient EM Debt 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 Rate Fund^	Alcentra Limited	–
BNY Mellon Future Earth Fund	Newton Investment Management Limited*	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Food Fund**	Newton Investment Management Limited*	12. Januar 2021
BNY Mellon Future Life Fund	Newton Investment Management Limited*	12. Januar 2021
BNY Mellon Global Bond Fund	Newton Investment Management Limited**	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Credit Fund	Insight Investment Management (Global) Limited*	29. Februar 2016
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Newton Investment Management Limited*	5. August 2010
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	Newton Investment Management Limited**	13. November 2012
BNY Mellon Global Equity Fund**	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Equity Income Fund	Newton Investment Management Limited**	29. Juli 2010
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Alcentra NY, LLC	11. Februar 2004
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	Newton Investment Management North America LLC**	13. August 2018

Fund	Anlageverwalter	Auflegungsdatum
BNY Mellon Global Leaders Fund	Walter Scott & Partners Limited	7. Dezember 2016
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund ⁽³⁾	Newton Investment Management Limited	10. Juli 2018
BNY Mellon Global Opportunities Fund	Newton Investment Management Limited**	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Newton Investment Management Limited*	8. März 2010
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Newton Investment Management Limited*	14. Juni 2012
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Newton Investment Management Limited*	30. Juni 2009
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	30. November 2016
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	Newton Investment Management Limited*	6. Dezember 2017
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Asset Management Japan Limited**	12. Dezember 2013
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	Walter Scott & Partners Limited	4. April 2008
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	Newton Investment Management North America LLC**	1. August 2018
BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund ⁽⁴⁾	Mellon Investments Corporation	10. Januar 2018
BNY Mellon Pan European Equity Fund ⁽⁵⁾	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker ⁽⁶⁾	Mellon Investments Corporation	23. März 2001
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	Newton Investment Management North America LLC**	28. April 2003
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	Newton Investment Management North America LLC*	14. Dezember 2020
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Newton Investment Management Limited*	25. Februar 2019
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	Newton Investment Management Limited	23. September 2022
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 ⁽⁷⁾	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 2. September 2020 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 26. Februar 2021 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 18. März 2021 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 28. August 2018 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 9. März 2017 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 15. Januar 2021 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 5. März 2021 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Prospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

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

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

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

ANLAGEZIEL

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

SONSTIGE WICHTIGE ANGABEN

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

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 31. Dezember 2022 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, D01E4XO, Irland aufbewahrt. Der Verwaltungsrat ist ferner dafür verantwortlich, die Vermögenswerte der Gesellschaft zu schützen und insofern angemessene Maßnahmen zur Verhinderung und Aufdeckung von Betrug und anderen Unregelmäßigkeiten zu ergreifen. Gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank ist der

Verwaltungsrat verpflichtet, die Verwahrstelle mit der sicheren Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft zu betrauen. In Ausübung dieser Pflicht hat die Gesellschaft The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin bestellt, damit diese ihr Treuhand-, Verwahr- und Depotdienstleistungen erbringt.

Der 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.

Die Auswirkungen des russischen Einmarschs in die Ukraine im Februar 2022 waren wichtige Schwerpunktbereiche für die Verwaltungsgesellschaft und die Anlageverwalter im Geschäftsjahr und werden dies auch weiterhin sein. Engagements in Russland und in der Ukraine sowie Liquiditäts- und bewertungsbezogene Probleme für alle diesbezüglichen Bestände wurden genau beobachtet und alle geltenden Sanktionen wurden befolgt. Weitere Informationen über die Auswirkungen auf die Teilfonds finden Sie in den Berichten der Anlageverwalter auf den Seiten 11 bis 45 des Berichts und Abschlusses.

ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

Durch ihre Anlagetätigkeit ist die Gesellschaft verschiedenen Arten von Risiken ausgesetzt, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten verbunden sind, in 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 2022 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 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 Anteilinhaber 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.

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

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

Tagen an die Anteilhaber erfolgen.

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

Die Anteilhaber können beschließen, einen ordentlichen Beschluss oder einen Sonderbeschluss auf einer Anteilhaberversammlung zu genehmigen. Ein ordentlicher Beschluss der Gesellschaft oder der Anteilhaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten Klasse erfordert die absolute Mehrheit der abgegebenen Stimmen der Anteilhaber, die bei der Versammlung, im Rahmen derer der Beschluss vorgeschlagen wird, persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter ihre Stimme abgeben. Für einen Sonderbeschluss der Gesellschaft oder der Anteilhaber eines bestimmten Fonds oder einer bestimmten 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 Anteilhaber erforderlich.

ZUSAMMENSETZUNG UND ARBEIT DES VERWALTUNGSRATS UND DER AUSSCHÜSSE

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

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

werden in Übereinstimmung mit ihrem Businessplan an die designierten Verwaltungsratsmitglieder delegiert.

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.

DIVERSITÄTSEKTLÄRUNG

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 vier 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 2022 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) (bestellt am 8. Juni 2022)
Mark Flaherty (Ire) (bestellt am 22. Juli 2022)
Sarah Cox (Britin) (bestellt am 9. Februar 2023)

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

† Vorsitzender des Verwaltungsrats.

† Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES GESELLSCHAFTSSEKRETÄRS

Die Verwaltungsratsmitglieder (einschließlich ihrer Angehörigen) und der Gesellschaftssekretär Tudor Trust Limited hielten während des Geschäftsjahres zum

31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 keine Beteiligungen an der Gesellschaft.

Greg Brisk und Gerald Rehn** sind Vollzeitführungskräfte der BNY Mellon Group. Greg Brisk, Gerald Rehn** und Mark Flaherty* sind außerdem als Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft tätig. Greg Brisk und Gerald Rehn** sind ferner Verwaltungsratsmitglieder der globalen Unter-Vertriebsgesellschaft, BNY Mellon Investment Management EMEA Limited, und Caylie Stallard* ist bei dieser Gesellschaft angestellt. Greg Brisk, Gerald Rehn**, Mark Flaherty* und Caylie Stallard* haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Im Laufe des Geschäftsjahres sind Managementgebühren in Höhe von 94.932.927 USD (31. Dezember 2021: 112.390.536 USD) entstanden.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

POLITISCHE SPENDEN

In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 wurden von der Gesellschaft keine politischen Spenden gemacht.

OFFENLEGUNG VON INFORMATIONEN AN DIE ABSCHLUSSPRÜFER

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

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

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

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

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied – David Dillon

Verwaltungsratsmitglied – Claire Cawley

Datum: 13. April 2023

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE

für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“)

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

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

AUFGABEN DER VERWAHRSTELLE

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

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

GRUNDLAGE FÜR DEN PRÜFVERMERK 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.

PRÜFVERMERK

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: 13. April 2023

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

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

PRÜFVERMERK

Wir haben den Jahresabschluss der BNY Mellon Global Funds, plc („die Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum Samstag, 31. Dezember 2022 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 2022 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 PRÜFVERMERK

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 Prüfvermerks.

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 Prüfvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Angaben, und sofern dies nicht ausdrücklich in unserem Bericht erwähnt wird, geben wir kein Urteil mit Prüfungssicherheit dazu ab.

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

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

VOM COMPANIES ACT 2014 VORGESCHRIEBENE STELLUNGNAHMEN ZU SONSTIGEN SACHVERHALTEN

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

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

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

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

SACHVERHALTE, ÜBER DIE WIR IN AUSNAHMEFÄLLEN BERICHTEN MÜSSEN

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

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

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

JEWELIGE AUFGABEN

Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Abschluss

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

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

Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

Unser Ziel besteht darin, uns angemessene Sicherheit darüber zu verschaffen, dass der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen Fehldarstellungen aufgrund von Betrug oder Fehlern ist, und einen Bericht des Abschlussprüfers zu erstellen, der unseren Prüfvermerk 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 Prüfvermerke 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: 18. April 2023

BERICHTE DER ANLAGEVERWALTER

KONJUNKTUR- & MARKTÜBERBLICK

Einleitung

Sowohl Aktien als auch Anleihen verbuchten in den zwölf Monaten bis Dezember 2022 negative Renditen. Das Anlageumfeld stellte beide Anlageklassen angesichts sprunghaft ansteigender Inflationsraten, rapider Zinserhöhungen und des unfreundlicheren globalen Wirtschaftsausblicks vor große Herausforderungen. Zudem wirkten sich der Einmarsch Russlands in der Ukraine zu Beginn des Jahres 2022 und der anschließend im gesamten Jahresverlauf fortdauernde Konflikt äußerst negativ aus. Russlands Angriff schickte die Märkte Ende Februar auf Talfahrt. Sie blieben während des Berichtszeitraums zumeist auf der Verliererseite und erholten sich erst im Schlussquartal, als Hoffnung aufkam, das Tempo der geldpolitischen Straffung könnte nachlassen. Viele Marktindizes, darunter auch der Leitindex S&P 500, gerieten Anfang des Jahres bald in Bärenmarkt-Territorium (ein Rückgang von mehr als 20 % gegenüber dem Höchststand). In der Tat hatte der S&P 500 Index sein schlechtestes erstes Halbjahr seit rund 50 Jahren zu verzeichnen.

Auf den Aktienmärkten kam es zu einer Umschichtung von Growth in Value. Der Technologiesektor, der die Märkte seit geraumer Zeit – insbesondere während der Pandemie – angeführt hatte, rutschte 2022 stark ab. Energie- und Rohstoffaktien erholten sich zunächst, insbesondere Öaktien, da der Ölpreis nach dem Einmarsch der russischen Streitkräfte in der Ukraine sprunghaft anstieg. Die Preise für Öl und Gas schossen in die Höhe, da mehrere Länder, unter anderem die USA und das Vereinigte Königreich, gegen russische Öl- und Gasexporte für ihre Länder ein Embargo verhängten. Finanzwerte entwickelten sich ebenfalls stark – vor allem Banken, die von höheren Zinssätzen profitierten.

Weltweit schlugen die Zentralbanken im Berichtszeitraum deutlich zinsbullischere Töne an, denn die Inflation war keineswegs ein befristetes Problem. Vielmehr fasste sie in der Weltwirtschaft immer fester Fuß. Im Vereinigten Königreich und in den USA stieg die Inflation im April auf ein 40-Jahreshoch. Auch in der Eurozone kletterte sie auf einen Rekordstand. Während die Teuerungsrate in den USA im Juni ihren Höhepunkt zu erreichen schien, stieg sie im Vereinigten Königreich und in der Eurozone weiter an und erklimmte neue Höchststände. Die Bank of England (BoE) hatte im Dezember 2021 mit Zinserhöhungen begonnen, gefolgt von der US-Notenbank (Fed), die erstmals im März 2022 an der Zinsschraube drehte. Die Europäische Zentralbank (EZB) hob erst im Juli den Leitzins an, und blieb in ihrem Straffungszyklus hinter den beiden anderen Notenbanken zurück.

Unterdessen verschlechterten sich die Aussichten für die Weltwirtschaft im Laufe des Jahres deutlich, und vielen Volkswirtschaften der Welt droht eine Rezession. Die USA rutschten in der ersten Jahreshälfte in eine technische Rezession ab, erholten sich aber im dritten Quartal. In den meisten großen Volkswirtschaften, darunter China, Japan, die Eurozone und das Vereinigte Königreich, blieben die Wachstumsraten bescheiden. Das Bruttoinlandsprodukt (BIP) des Vereinigten Königreichs sank im dritten Quartal und dürfte gemäß Institutionen wie der BoE im vierten Quartal und während des Jahres 2023 weiter zurückgehen.

Nordamerika

Der Markt in den USA gab im Berichtszeitraum nach, da die Inflation stark anstieg, die US-Notenbank Fed die Zinsen an hob und geopolitische Bedenken im Vordergrund standen – allen voran Russlands Einmarsch in der Ukraine, aber auch die gestörten bilateralen Beziehungen zu China.

Der S&P 500, der Dow Jones Industrial Average und der Nasdaq-Index büßten erheblich an Wert ein und erreichten im Frühjahr Bärenmarkt-Territorium (ein Rückgang von über 20 % gegenüber dem Höchststand), während im S&P 500 das schwächste erste Halbjahr seit rund 50 Jahren zu verbuchen war. Besonders heftig traf es Technologiewerte, denn der Markt schwenkte von Growth (als Faktor) auf Value um. Aktien aus dem Energie- und Rohstoffsektor entwickelten sich hingegen sehr positiv, da die Rohstoffpreise, insbesondere für Öl und Gas, in der ersten Jahreshälfte stark anzogen, wobei die gegen Russland verhängten Sanktionen für Ölausfuhren nach der Invasion in der Ukraine für eine kräftige Aufwärtsdynamik sorgten. Der Markt blieb während des Berichtszeitraums zumeist volatil und verharrte über weite Strecken in einem ausgeprägten Abwärtstrend. Allerdings konnte er sich im Schlussquartal des Jahres in US-Dollar gerechnet erholen, da Hoffnung auf eine Verlangsamung der geldpolitischen Straffung aufkam.

Die Inflation, die Mitte des Jahres 2021 erstmals angezogen hatte, kletterte auf neue Höchststände, wie sie diese Generation noch nie erlebt hatte. Die jährliche Verbraucherpreis-inflation erreichte im Juni mit 9,1 % ein neues 41-Jahres-Hoch, bevor sie in den folgenden fünf Monaten zurückging und im Dezember das Jahr bei einem Stand von 6,5 % beschloss. Die Fed wurde im Laufe des Jahres zunehmend restriktiver. Sie erkannte, dass sich das Risiko einer höheren Inflation verfestigte. Sie reduzierte ihr Anleihen-Kaufprogramm und beendete es schließlich im März. Im selben Monat nahmen die US-Währungshüter die erste Zinserhöhung vor, an die sich im Laufe des Jahres weitere Zinsschritte anschlossen, mit denen der Leitzins von 0,25 % auf 4,5 % (Obergrenze der Zielspanne) angehoben wurde, darunter viermal hintereinander um jeweils 75 Basispunkte (Bp.). Die letzte Erhöhung um 50 Bp. im Dezember ermutigte die Anleger zu der Annahme, dass das Tempo der geldpolitischen Straffung nachlassen könnte.

Der Ausblick für das Wirtschaftswachstum verschlechterte sich im Laufe des Jahres trotz einer Erholung des BIP im dritten Quartal und der nach wie vor angespannten Lage am Arbeitsmarkt. Das BIP sank im ersten Quartal 2022 annualisiert um 1,6 %, gefolgt von einem Rückgang um 0,6 % im zweiten Quartal, wodurch sich die Rezession bestätigte. Allerdings erholte sich das BIP im dritten Quartal um 3,2 %. Aufgrund der unvermindert hohen Zahl an neu geschaffenen Stellen und eines Rückgangs bei den Anträgen auf Arbeitslosenunterstützung auf ein Mehrjahrestief im Frühjahr blieb die Beschäftigungslage im Allgemeinen über weite Strecken des Jahres robust. Gegen Ende des Berichtszeitraums gab es jedoch Anzeichen für Schwäche am Arbeitsmarkt. Sorgen um die steigenden Lebenshaltungskosten und die Auswirkungen des russischen Krieges gegen die Ukraine auf Grundnahrungsmittel und Energieträger belasteten das Klima.

Europa

Die europäischen Märkte fielen im Berichtszeitraum, entwickelten sich aber insgesamt besser als der globale Marktindex. Auch hier verunsicherten ein rasanter Anstieg der Inflation, die straffere Geldpolitik, die Eintrübung der Wirtschaftsaussichten und der Krieg in der Ukraine die Anleger. Zunächst erholte sich Europa nur langsam von der Covid-19-Pandemie. Die strengen Lockdown-Beschränkungen, die manche Länder den Winter über eingeführt hatten, wirkten 2022 in den ersten Monaten noch nach, als die Omikron-Variante von Covid wütete. Ende Februar schickte Russlands Einmarsch in der Ukraine die Märkte Europas auf Talfahrt. Trotz gelegentlicher Phasen mit Kursgewinnen erholten sie sich bis zum Schlussquartal des Jahres nicht vollständig. Noch weiter in den Keller ging die Stimmung, als höhere Verbraucherpreise, verschärft durch die gegen Russland verhängten Sanktionen, allmählich auf den privaten Konsum durchschlugen. In den letzten Monaten des Jahres legten die Märkte in Europa jedoch wieder zu, da Hoffnungen auf eine Verlangsamung der Zinserhöhungen und ein wärmeres Winterwetter bestanden, wodurch die Erdgaspreise sanken.

Innerhalb Europas war der britische Markt der stärkste unter den maßgeblichen Handelsplätzen, und nur ganz wenige Märkte der Industrieländer vermochten 2022 positive Renditen zu erzielen. All dies ereignete sich vor dem Hintergrund politischer Turbulenzen, einer höheren Inflation und einer restriktiveren Geldpolitik. Verantwortlich für die überdurchschnittlichen Renditen war die Zusammensetzung des britischen Index, in dem Öl- und andere Rohstoffwerte stark vertreten sind. Norwegen entwickelte sich ebenfalls robust. Auch hier profitierte man stark von einer auf Öl und Gas ausgerichteten Volkswirtschaft. Zu den schwächsten Märkten gehörten die Niederlande, Irland und Deutschland. Deutschland litt aufgrund seiner historischen Abhängigkeit von Russland unter Bedenken um seine Gasversorgung.

Sowohl im Vereinigten Königreich als auch in der Eurozone kam es im Berichtszeitraum zu einem stetigen Inflationsanstieg. Im Vereinigten Königreich erreichte die Inflation im Oktober 11,1 % und somit den höchsten Stand seit 1981, während in der Eurozone (ebenfalls im Oktober) ein Allzeithoch von 10,6 % markiert wurde. Die BoE nahm im Jahresverlauf auf jeder Sitzung ihres geldpolitischen Ausschusses eine Zinserhöhung vor. Dadurch stieg der Leitzins von 0,25 % auf 3,5 %. Die EZB war mit ihrer ersten Zinserhöhung auf ihrer Julisitzung spät dran. Danach nahm sie drei weitere Zinserhöhungen vor, wodurch der Leitzins von 0 % auf 2,5 % anstieg. Im Vorfeld hatte die EZB im März 2022 ihr während der Pandemie aufgelegtes Programm für Notkäufe von Wertpapieren (PEPP) beendet.

Das Wirtschaftswachstum fiel in ganz Europa eher dürrig aus. Das BIP in der Eurozone blieb positiv und stieg im Vergleich zum Vorquartal im ersten Quartal um 0,6 %, im zweiten Quartal um 0,9 % und im dritten Quartal um lediglich 0,3 %. Im Vereinigten Königreich verlangsamte sich das BIP-Wachstum im gesamten Berichtszeitraum: Im ersten Quartal stieg es um 0,6 % gegenüber dem Vorquartal, im zweiten Quartal nur noch um 0,1 % und im dritten Quartal ging es um 0,3 % zurück. Trotz des schwächeren Wirtschaftswachstums blieb die Arbeitsmarktlage recht angespannt. Die Arbeitslosigkeit war während des Jahres zumeist rückläufig – sowohl in der Eurozone als auch im Vereinigten Königreich. In den Schlussmonaten des Jahres nahm sie dann im Vereinigten Königreich leicht zu – auf einen Stand von 3,7 %. In der Eurozone sank sie hingegen auf ein neues Tief von 6,5 %.

Asien

Die asiatischen Märkte tendierten im Berichtszeitraum insgesamt schwächer und blieben hinter den globalen Aktien zurück. Belastet wurden die Märkte von Bedenken um die Inflation, der Verschärfung der Geldpolitik, der Stärke des US-Dollars, den noch anhaltenden und in manchen Ländern hohen Covid-19-Inzidenzen (insbesondere in China, Japan und Südkorea) und dem Krieg in der Ukraine (von dem Asien allerdings unmittelbar weniger beeinträchtigt wurde). China behielt fast das ganze Jahr über strenge Covid-Beschränkungen bei, bis landesweite Demonstrationen Ende November die Regierung offenbar dazu zwangen, ihre „Null-Covid“-Politik zur Bekämpfung der Pandemie zu ändern. Bis zum Jahresende waren dann fast alle Auflagen gelockert worden. Auch Japan behielt in der ersten Jahreshälfte relativ strenge Beschränkungen bei, lockerte diese aber in der zweiten Jahreshälfte.

Der chinesische Markt verlor an Wert und entwickelte sich insgesamt schlechter als die anderen asiatischen Märkte. Taiwan und Südkorea waren besonders schwach und wurden durch pandemiebedingte Probleme und den rückläufigen Welthandel beeinträchtigt. Indonesien war einer der stärksten Märkte und profitierte von dem kräftigen Rohstoffzyklus.

In Sachen Geldpolitik erhöhten fast alle asiatischen Länder im Laufe des Jahres die Zinssätze, mit Ausnahme von China und Japan. In den meisten Ländern kam es zu höheren Inflationsraten. Die Lieferketten, die vor allem durch Covid unterbrochen worden waren, blieben angespannt. Zudem führte ein Wertanstieg im US-Dollar zu einer deutlich höheren importierten Inflation, insbesondere in den Ländern, die von Rohstoffimporten abhängig sind. Die Teuerungsraten blieben jedoch im Allgemeinen unter den im Westen verzeichneten Niveaus. In Japan hielt sich die Inflation zu Beginn des Jahres auf relativ niedrigem Stand. Allerdings zog sie im weiteren Jahresverlauf an und erreichte im Dezember einen Stand von 4,0 % – der höchste Satz seit mehr als 40 Jahren. Dies gab Spekulationen Nahrung, die Bank of Japan (BoJ) könnte Zinserhöhungen in Erwägung ziehen. Letztere beließ allerdings ihren Leitzinssatz bei -0,1 %. In China blieb die Inflation recht verhalten. Die People's Bank of China (PBOC) senkte im Verlauf des Jahres die Darlehenszinsen über verschiedene Laufzeiten, um dem Wirtschaftswachstum Impulse zu verleihen.

Der Ausblick für die asiatischen Volkswirtschaften trübte sich während des Jahres allgemein ein, da sich sowohl weltweit als auch in der Region das Konjunkturmilieu abschwächte. In China wuchs das BIP in den ersten drei Quartalen des Jahres jeweils um weniger als 5 % gegenüber dem Vorjahr. Die strengen coronabedingten Einschränkungen, die sich stark auf heimische und globale Lieferketten auswirkten, die schärfere Regulierung überwiegend dienstleistungsbezogener Branchen wie Online-Shopping und Gaming sowie Probleme im Immobiliensektor des Landes bremsten allesamt das Wachstum. In Indien war das BIP-Wachstum mit +13,5 % im zweiten Quartal robust, nachdem die Beschränkungen im Zusammenhang mit der Pandemie gelockert worden waren. Im dritten Quartal ging es dann wieder auf 6,3 % zurück.

Auch Japan wurde zu Beginn des Jahres noch von Covid-19 beeinträchtigt und verzeichnete allgemein ein schwaches Wachstum der Binnenwirtschaft und des Exportsektors. Das BIP des Landes schwankte im Berichtsjahr von Quartal zu Quartal zwischen negativem und positivem Wachstum.

Festverzinsliche Wertpapiere

Für die Anleihemärkte war der Berichtszeitraum angesichts erheblicher Kursverluste schwierig – sogar so schlecht wie seit Jahrzehnten nicht. Dies war vor allem auf die weltweit stark ansteigende Inflation zurückzuführen, die die meisten Zentralbanken dazu veranlasste, von ihrem bisherigen geldpolitischen Kurs abzugehen und aggressive Straffungen vorzunehmen. Die Renditen auf Staatsanleihen kletterten mit den Inflationsraten in die Höhe, da sich die langfristigen Inflationserwartungen am Markt nach oben anpassten. Unternehmensanleihen, allen voran Hochzinstitel und Schwellenländeranleihen, gaben ebenfalls nach, da die Anleger risikoscheuer agierten.

Die Inflation erreichte in vielen Ländern Höchststände, wie sie diese Generation noch nie erlebt hat: Die jährliche Verbraucherpreis-inflation erreichte im Juni in den USA mit 9,1 % und im Oktober im Vereinigten Königreich mit 11,1 % die höchsten Werte seit 40 Jahren. Währenddessen erklomm sie in der Eurozone mit +10,6 % im Oktober ein Allzeithoch. Der Krieg in der Ukraine heizte die Inflation weiter an, denn die Preise für Rohstoffe, insbesondere für Erdöl und Erdgas, zogen sprunghaft an, als der Westen Sanktionen gegen Russland verhängte und die USA und das Vereinigte Königreich den Import von russischem Öl untersagten. Anschließend gingen in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums die Öl- und Gaspreise zurück, die Lebenshaltungskosten blieben aber unvermindert hoch.

Die Fed begann im März mit der Anhebung der Zinssätze und setzte diese Politik im weiteren Jahresverlauf fort, wobei sie die Sätze von anfangs 0,25 % auf 4,5 % anhob, unter anderem mit vier aufeinanderfolgenden Zinsschritten von jeweils 75 Basispunkten (Bp.). Die letzte Erhöhung um 50 Bp. ermutigte die Anleger zu der Annahme, dass das Tempo der geldpolitischen Straffung nachlassen könnte, was am Markt zu einer kurzzeitigen Erholung führte. Die Fed kündigte ferner das Auslaufen ihres Anleihekaufprogramms bis März 2022 an. Die BoE nahm im Jahresverlauf auf jeder Sitzung ihres geldpolitischen Ausschusses eine Zinserhöhung vor. Dadurch stieg der Leitzins von 0,25 % auf 3,5 %. Die EZB war mit ihrer ersten Zinserhöhung auf ihrer Julisitzung spät dran. Danach nahm sie drei weitere Zinserhöhungen vor, wodurch der Leitzins von 0 % auf 2,5 % anstieg.

Die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen war gegen Ende des Berichtszeitraums auf ein 15-Jahres-Hoch von über 4 % geklettert, womit sich die Rendite von 1,5 % Anfang Januar mehr als verdoppelt hatte. Die Zinsen auf kurzlaufende Anleihen stiegen sogar noch stärker an: 2-jährige Staatsanleihen markierten Anfang November ein Renditeniveau von 4,7 %. Die Renditespanne zwischen 2-jährigen und 10-jährigen US-Schatzanleihen invertierte im Juli, woran sich auch den Rest des Jahres nichts änderte. Dieses Phänomen wird häufig als Anzeichen für eine bevorstehende Rezession gewertet. Im Vereinigten Königreich erhöhte sich die Rendite 10-jähriger Gilts im Berichtszeitraum von rund 1,0 % zu Beginn auf beinahe 4,5 % im Herbst – der höchste Stand seit 14 Jahren. In Deutschland drehte die Rendite der 10-jährigen Bundesanleihe Ende Januar erstmals seit mehreren Jahren ins Plus und beendete das Jahr mit etwas über 2,5 % – das höchste Niveau seit mehr als zehn Jahren.

Währungen und Rohstoffe

Die Währungsmärkte zeichneten sich 2022 vor allem durch einen hartnäckig hohen US-Dollar aus. Letzterer erklomm im Herbst gegenüber einem Korb anderer Währung 20-Jahreshochs. Seinem Höhenflug lagen die straffere Geldpolitik der Fed und eine relativ robuste Konjunktur zugrunde. Ende September markierte der Greenback schließlich einen Höchststand, um in den kommenden Monaten wieder leicht zurückzufallen. Das Pfund Sterling, das sich in den letzten Monaten 2021 vergleichsweise stark zeigte, gab 2022 nach, als die Inflation in die Höhe schoss und sich die Krise durch die Lebenshaltungskosten verstärkte. Das Pfund Sterling litt unter schwachen Prognosen für das Wirtschaftswachstum – nicht nur seitens Institutionen wie Weltbank und OECD, sondern auch der BoE selbst, die für 2023 eine Rezession kommen sah. Ende September erreichte das Pfund Sterling nach dem „Mini-Haushalt“ von Liz Truss dann ein Allzeittief von knapp über Parität, erholte sich aber danach.

Der Euro, der zu Anfang des Berichtszeitraums geschwächt hatte, ging dagegen auf Erholungskurs. Gegenüber dem US-Dollar verlor er zwar und fiel bisweilen unter Parität, doch gegenüber dem britischen Pfund erstarkte die Einheitswährung. Dem Euro hatten zunächst das vergleichsweise schwache Wachstum in der Eurozone, die relativ lockere Geldpolitik der EZB sowie die Covid-Probleme zugesetzt. Als sich die EZB zunehmend zinsbullisch zeigte, erholte sich der Euro wieder. Der Yen wertete gegenüber dem US-Dollar drastisch ab und sackte im Oktober auf den tiefsten Stand seit mehreren Jahrzehnten von über 150 JPY/USD ab, da die Geldpolitik von BoJ und Fed massiv divergierte. In den letzten beiden Monaten des Jahres erholte sich der Yen, als die BoJ intervenierte und die Spekulationen zunahmen, dass die Zentralbank aufgrund der steigenden Inflation gezwungen sein könnte, ihren geldpolitischen Kurs zu ändern.

Rohstoffe tendierten insgesamt aufwärts. In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums legten sie deutlich zu. Im Juni erreichten sie schließlich Höchststände, und danach verloren sie wieder an Boden. Zu Beginn des Jahres wurden sie von höheren Inflationsniveaus und Störungen der Lieferketten gestützt, erhielten aber durch den Einmarsch Russlands in der Ukraine noch einen kräftigen zusätzlichen Schub. Die westlichen Sanktionen gegen Russland, allen voran das Importverbot der USA und des Vereinigten Königreichs für russisches Öl, ließen die Rohstoffpreise in die Höhe schießen. Bei Rohöl kletterte die Sorte West Texas Intermediate im März auf ein 14-Jahreshoch und Brent Crude verzeichnete ein 11-Jahreshoch – in beiden Fällen bei über 120 USD pro Barrel. Auch die Erdgaspreise erhöhten sich im Berichtszeitraum drastisch, zumal Russland ein wichtiger Gasproduzent war, der einen immensen Teil des europäischen Gasbedarfs deckte. Gegen Ende des Berichtszeitraums tendierten die Öl- und Gaspreise aus Sorge vor einer weltweiten Rezession allerdings wieder schwächer. Öl beschloss das Jahr nahe seinen Jahrestiefs.

Andere wichtige Industriemetalle, beispielsweise Kupfer, legten in der ersten Jahreshälfte kräftig zu (im März erreichte das Metall ein Allzeithoch), bevor es in der zweiten Jahreshälfte aufgrund von Sorgen um die Weltwirtschaft, insbesondere um die Nachfrage aus China, zu Preisrückgängen kam. Andere wichtige Industriemetalle wie Zink und Aluminium gaben im Verlauf des Jahres ebenfalls nach.

Der Goldpreis war auf Jahressicht indes leicht gestiegen. Zunächst war das Edelmetall im März sprunghaft gestiegen und hatte beinahe ein Allzeithoch erreicht (zuletzt markiert im August 2020): Es profitierte von seinem Status als „sicherer Hafen“. Allerdings geriet es im Zuge steigender Zinssätze und eines robusten US-Dollars danach unter Druck.

Alle Daten zur Wertentwicklung beziehen sich, soweit nicht anders angegeben, auf die Gesamtergebnisse in Landeswährungen vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022. Quelle: Lipper Hindsight und Bloomberg.

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 0,84 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des 3-Monats-EURIBOR bei 0,34 % (jeweils in Euro).

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert.

Die Marktstimmung wurde im Berichtsjahr von den tendenziell höheren Zinssätzen infolge der zunehmenden Inflation beherrscht. Belastend für das Anlegervertrauen war die erhöhte Marktvolatilität.

Die erste Hälfte des Berichtszeitraums war von steigenden Anleiherenditen geprägt, wobei sowohl Staats- als auch Unternehmensanleihen unter Druck gerieten. Die Märkte für Hochzinsanleihen waren besonders schwach, da das Interesse der Anleger an verhältnismäßig risikoreichen Anlagen nachließ. Auch in der zweiten Jahreshälfte zeigten sich die Märkte volatil, wobei die straffere Geldpolitik eine weitere Schwäche der Kreditmärkte nach sich zog. Die Monate Oktober und November boten eine gewisse Verschnaufpause, weil sowohl Staats- als auch Unternehmensanleihen nach oben tendierten. Anschließend beendeten sie jedoch das Jahr mit erneuter Schwäche, da die Renditen von Staatsanleihen wieder anstiegen.

Während des gesamten Jahres wirkte sich das Zinsengagement des Fonds positiv auf die Performance aus. In den ersten sechs Monaten war die Duration am vorteilhaftesten, denn die Short-Positionen des Fonds in US-Staatsanleihen und britischen Gilts erwiesen sich als gewinnbringend. Die Zinssätze blieben auch in der zweiten Jahreshälfte sehr volatil, was im dritten Quartal eine positive Performance der Short-Positionen des Fonds in deutschen, amerikanischen und britischen Staatsanleihen nach sich zog. Die Durationspositionierung leistete im Schlussquartal des Jahres nach wie vor einen Positivbeitrag, da die Renditen im Dezember stark anstiegen.

Dagegen beeinträchtigten die Bestände in den Schwellenländern die Performance in der ersten Jahreshälfte. Dies war auf die Long-Positionen des Fonds in Hartwährungsanleihen staatlicher Emittenten zurückzuführen, die im zweiten Quartal schwach tendierten. Im dritten Quartal war die Inflationspositionierung des Fonds abträglich, was sich allerdings gegen Jahresende umkehrte.

Die Positionierung des Portfolios wurde während des Berichtszeitraums über seine verschiedenen Strategien hinweg angepasst. In der ersten Jahreshälfte nahm der Fondsmanager Anpassungen an der Duration, dem Länderengagement und der Renditekurvenpositionierung des Fonds vor. Außerdem wurde eine geringfügige Long-Position im Kreditbereich eröffnet, mit Präferenz für Investment-Grade-Anleihen gegenüber Hochzinsanleihen. In der zweiten Jahreshälfte bevorzugte der Fonds weiterhin eine mäßige Long-Position in Nicht-Staatsanleihen, wobei Europa gegenüber den USA der Vorzug galt. In der Erwartung, dass die Zentralbanken die Zinsen stärker anheben als von den Märkten eingepreist,

ging der Fonds ferner zu einer Position mit kurzer Duration über.

Der Fondsmanager geht für 2023 von einem nachlassenden globalen Wachstum aus. Die Gesamtinflation könnte weiter zurückgehen, da sich die Lieferketten stabilisieren und die Energiepreise sinken. Der Fonds ist darauf ausgerichtet, dass die Zinssätze 2023 ihren Höchststand erreichen werden. Allerdings geht der Fondsmanager davon aus, dass die nachfolgenden Zinssenkungen nicht so schnell voranstehen werden, wie die Marktteilnehmer dies offenbar einpreisen. Nach einem volatilen Jahr 2022 bleibt er vorsichtig, um sich gegen unerwartete Ereignisse zu wappnen, die zu Wirtschafts- und Marktturbulenzen führen könnten.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Die Anteilsklasse Sterling R (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 1,76 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der SONIA (30 Tage aufgezinst) insgesamt 1,35 %. Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert.

Für Anleger bot der zwölfmonatige Berichtszeitraum ein schwieriges Umfeld. Der Krieg in der Ukraine, eine unerwartet hohe Inflation, Rezessionsängste und gestiegene Zinsen führten zu einer erhöhten Volatilität und schwachen Renditeentwicklung bei herkömmlichen Aktien und Anleihen.

In einem Zeitraum mit hohen Energiepreisen waren die Long-Positionen des Fonds in großen Ölkonzernen für die Wertentwicklung am zuträglichsten. Royal Dutch Shell und BP profitierten auf dem Markt davon, dass sie sich verstärkt auf die Aktionärsrenditen konzentrieren, nicht auf weitere Investitionsausgaben. Das norwegische Energieunternehmen Equinor war starker Nutznießer der höheren europäischen Erdgaspreise infolge des Krieges in der Ukraine.

Abgesehen von den Energietiteln leistete auch EssilorLuxxotica, ein Gigant im Bereich Brillen- und Sehhilfen, einen wichtigen positiven Beitrag zur Performance. Die Aktien des Unternehmens standen bei den Anlegern nach soliden Umsatzmeldungen hoch in der Gunst: Die Zahlen lagen etwas über den Erwartungen, und das Management bekräftigte alle mittelfristigen Ziele.

Dagegen beeinträchtigten die Long-Positionen des Fonds in der Gastgewerbebranche Hostmore und dem Online-Händler Unbound die Wertentwicklung am meisten, weil das Verbrauchervertrauen aufgrund der Lebenshaltungskostenkrise zurückging. Diese Bestände wurden durch Anlagen in spezifischen Körben anderer britischer Konsumgüterunternehmen abgesichert, was half, die negativen Auswirkungen auf die Performance abzufedern. Die Long-Position des Fonds in Segro, abgesichert gegen den Einzelhandelssektor und einen maßgeschneiderten Korb, der empfindlich auf die Kurse von Anleihen reagiert, schadete der Wertentwicklung ebenfalls. Amazons beschlossene Abkehr vom Aufbau physischer Kapazität sorgte für Schwäche im Logistiksegment des Immobiliensektors.

Das Bruttoengagement in Aktien schwankte im Berichtsjahr, worin sich die veränderten Marktbedingungen niederschlugen. Als die Marktvolatilität aufgrund von Russlands Invasion in der Ukraine zunahm, wurde das Risiko verringert. Im weiteren Jahresverlauf wurde das Bruttoengagement wieder aufgestockt, da

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND Forts.

sich aus den Marktverzerrungen interessante taktische Gelegenheiten ergaben, etwa im Zuge des Ausverkaufs britischer Aktien aufgrund des „Mini-Haushalts“ der britischen Regierung im September. Zu den Aktivitäten auf Portfolioebene zählten neue Long-Positionen im Sporteinzelhändler JD Sports und in der britischen Bankengruppe NatWest. Bei beiden stand die negative Anlegerstimmung im Widerspruch zu den eigentlich robusten Fundamentaldaten.

Vorausblickend bleiben die makroökonomischen Aussichten nuanciert, und die Märkte dürften weiterhin Volatilität an den Tag legen. Es gibt Anzeichen für eine Abschwächung der Konjunktur, doch die Wiederöffnung der chinesischen Wirtschaft könnte in einer höheren Nachfrage münden, wovon die Unternehmensgewinne profitieren sollten. Zugleich ist der Fondsmanager der Meinung, dass die Aktienbewertungen derzeit nicht so überzogen sind wie in den Vorjahren und somit gute Möglichkeiten für Anlagen zu attraktiven Preisen bieten.

In einem Marktumfeld mit höheren Zinssätzen und einer erhöhten Volatilität eignet sich die marktneutrale Aktienstrategie des Fonds nach Ansicht des Fondsmanagers gut, um als Teil eines diversifizierten Portfolios positive Erträge mit schwacher Korrelation zu erzielen.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Die Anteilsklasse Euro U (Acc) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -4,40 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR eine Rendite von 0,09 %, jeweils in Euro. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Für risikoreiche Anlagen war das Jahr 2022 eine Herausforderung. Die Marktteilnehmer sorgten sich über steigende Zinssätze, eine anziehende Inflation, die Aussicht auf einen wirtschaftlichen Abschwung und weitere geopolitische Unruhen aufgrund des Kriegs zwischen Russland und der Ukraine. Dies führte zu einem umfassenden Ausverkauf an den Aktienmärkten und einer Weitung der Kreditspreads. Besonders betroffen war das weltweite Emissionsgeschehen bei Wandelanleihen.

Die Performance wurde vor allem durch zyklische Konsumgüterwerte wie Ford, Mercedes und Jet2 (britische Billigfluglinie) beeinträchtigt. Liquide Titel wie Ford und Mercedes litten darunter, dass die Marktteilnehmer Kapital brauchten. Jet2 wurde durch einen Mangel an Flughafenbetreibern in Europa beeinträchtigt. Im letzten Quartal des Jahres belasteten das weltweit führende Pharmaunternehmen Sanofi, die führenden Cybersicherheitsunternehmen Palo Alto und Cyberark, das Halbleiterunternehmen Silicon Laboratories sowie die Aktienabsicherungen des Fonds die Wertentwicklung.

Dagegen profitierte der Fonds im Laufe des Jahres von Positionen in hochwertigen Titeln. Positive Renditebeiträge leisteten unter anderem Sika, der Schweizer Produzent von Chemieprodukten für das Bauwesen, der einen Rekordumsatz verzeichnete, das Internet-Reiseunternehmen Booking Holidays und Southwest Airlines, eine Billigfluggesellschaft aus den USA. Der Fondsmanager bevorzugt diese Positionen, da ihre robusten Bonitätsprofile in Zeiten von hohem Marktstress attraktiv erscheinen.

Aufgrund der erhöhten Volatilität in der ersten Jahreshälfte konzentrierte sich der Fondsmanager auf den Kapitalerhalt, indem er die Anzahl der Bestände deutlich reduzierte und insbesondere das Engagement im Technologiesektor stutzte. Auch das Brutto-Leverage und die Duration wurden zurückgefahren. Das Netto-Aktienengagement fiel auf das Niveau vom März 2020 zurück. Die Positionen in einzelnen Aktien blieben klein.

Angesichts des etwas besseren Marktumfelds im dritten Quartal stockte der Fondsmanager das Portfoliorisiko wieder leicht auf. Nach den aggressiv restriktiven Verlautbarungen des Vorsitzenden der US-Fed Jerome Powell beim Zentralbanksymposium in Jackson Hole ging der Fondsmanager jedoch davon aus, dass die Abwärtsrisiken zugenommen hatten. Folglich kehrte sie zu einem Portfolio mit weniger Strategien, geringerer Hebelwirkung, niedrigerem Aktienengagement, kürzerer Duration und robusteren Portfolioabsicherungen zurück, um potenzielle Marktrisiken zu minimieren.

Insgesamt waren die Fondsbestände im vierten Quartal relativ stabil, wengleich einzelne Strategien, Positionierungen und Absicherungen angesichts der sich ständig ändernden Marktbedingungen eines aktiven Managements bedurften.

Mit Blick auf die Zukunft geht der Fondsmanager davon aus, dass das Jahr 2023 so beginnt, wie das Jahr 2022 endete: unruhig und volatil. Dennoch ist sie der Meinung, dass die Zentralbanken die Inflation letztlich in den Griff bekommen werden und Risikoanlagen zu einer Erholung ansetzen werden. Außerdem rechnet der Fondsmanager mit einem besser bestückten Neuemissionskalender im Jahr 2023, der mehr neue Anlagemöglichkeiten bieten sollte. Der Fonds weist mit seiner Positionierung ein robustes Bonitätsprofil, eine kürzere Duration und eine dynamische Mischung von Portfoliostrategien auf, die sich nach Einschätzung des Fondsmanagers zur weiteren Entwicklung an den Aktienmärkten im ersten Quartal des Jahres positiv auswirken werden.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -5,68 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von 1,50 % für den FTSE 3 Month Treasury Bill TR Index. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die Finanzmärkte wurden durch den unerwarteten Einmarsch Russlands in der Ukraine und die anhaltenden Komplikationen in den Lieferketten sowie durch eine globale Wachstumsschwäche, die steigende Inflation und die restriktive Geldpolitik der Zentralbanken in den Industrieländern belastet. Der Inflationsschock nach der Pandemie führte zu einer Abkehr vom jahrzehntelangen Muster niedriger Zinssätze und expansiver Geldpolitik,

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND Forts.

die geholfen hatten, die Renditen von riskanteren Anlagen zu steigern. Die US-Notenbank (Fed) hat zur Eindämmung der Inflation auf sieben Sitzungen die Zinssätze kontinuierlich angehoben. Die von der Fed angepeilte Zinsspanne von 4,25 % bis 4,50 %, die auf ihrer Dezembersitzung erreicht wurde, war das höchste Zinsziel seit 2007.

Für den Fonds war das ein schwieriges Umfeld. Bei den Aktien schnitten Value-Titel gut ab, da sie von höheren Zinssätzen profitierten. Allerdings sorgten die Rückgänge an den meisten Aktienmärkten für geringere Renditen. Ansonsten tendierten die Faktoren Qualität und Momentum neutral oder abwärts. Nach einer Verkaufswelle zu Beginn des Jahres zogen sie zum Ende hin an, als die Einschätzungen zur Wirtschaft und zu den Märkten einen Wechsel bei den favorisierten Aktien bedingten. Die Positionierung in festverzinslichen Wertpapieren sorgte ebenfalls für Mehrwert, während sich Momentum-Positionen unterdurchschnittlich entwickelten. Engagements in bestimmten festverzinslichen Wertpapieren wirkten renditeschmälernd.

Der Fonds ist so positioniert, dass er auf Renditen abzielt, die eine transparente, liquide und kostengünstige Diversifizierung bieten. Mit seiner Positionierung ist er darauf ausgerichtet, über den gesamten Konjunkturzyklus Renditen zu erzielen und traditionelle Engagements zu diversifizieren. Er strebt an, ein breites Spektrum an Hedgefonds-Faktoren durch direkte Anlagen in globalen Märkten und über sämtliche Anlageklassen hinweg abzudecken.

Newton Investment Management North America LLC Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -11,61 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a. eine Rendite von 4,08 %, jeweils in Euro. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die größten Abzüge von der Wertentwicklung des Fonds waren dem renditeorientierten Kern zuzuschreiben, allen voran globalen Aktien. Auf Aktienebene leisteten Positionen in Microsoft und ASML einen schwachen Renditebeitrag. Beide Unternehmen litten unter der Umschichtung der Anleger von Growth in Value. Die Aktien des E-Commerce-Giganten Alibaba wurden durch die weiterhin strenge Covid-19-Politik in China ausgebremst. Positiv entwickelten sich hingegen die Rohstofftitel im Fonds, darunter die Ölgesellschaften ConocoPhillips, Royal Dutch Shell und Marathon Petroleum. Der Aktienkurs von BAE Systems aus dem Rüstungssektor wurde von der Zusage von NATO-Mitgliedern beflügelt, ihre Verteidigungsausgaben zu erhöhen. AstraZeneca und Eli Lilly profitierten hingegen vom defensiven Charakter ihres Geschäfts sowie von den Gewinnzahlen. Innerhalb der renditestarken Kernanlagen verloren ansonsten Unternehmensanleihen an Wert. Alternative Anlagen leisteten dagegen

einen leichten Renditebeitrag, insbesondere die Fondsbestände in Rohstoffen und erneuerbaren Energien, die als stark diversifizierende Anlagen fungierten.

Das stabilisierende Segment erzielte ebenfalls negative Renditen, schnitt allerdings ungleich besser ab als das renditeorientierte Kernsegment. Das Engagement des Fonds in Gold durch börsengehandelte Anleihen auf Rohstoffbestände (Exchange-Traded Commodity, ETC) wirkte sich negativ aus, da der steigende US-Dollar und die höheren globalen Zinssätze den Goldpreis belasteten. Staatsanleihen wirkten angesichts steigender Zinssätze belastend. Die direkten Absicherungstransaktionen vermochten die Volatilität zu mindern, insbesondere im Verlauf des schwierigen zweiten Quartals. Unterdessen wies das aktive Long-Engagement im US-Dollar in manchen der schwierigsten Phasen des Jahres, vor allem im zweiten und dritten Quartal, ebenfalls eine starke negative Korrelation zu Risikoanlagen auf.

Die größte Portfolioveränderung im Berichtsjahr bestand in der Verringerung des Aktienengagements des Fonds. Dies erfolgte zunächst durch den Verkauf von Aktien, unter anderem Salesforce, Alphabet und Amazon.com. Im weiteren Jahresverlauf wurden auch Positionen in Chubb, Ecolab und Accenture veräußert. Das Aktiensegment wurde schrittweise in defensivere Werte umgeschichtet. So wurde die Position in dem auf Augenheilkunde und Fruchtbarkeitsbehandlung spezialisierten US-amerikanischen Unternehmen Cooper in der zweiten Jahreshälfte aufgestockt, da die Gewinne in den beiden Geschäftsbereichen ein rasches Wachstum zeigten. Auch bei Energieunternehmen, darunter Royal Dutch Shell und Anglo American, kam es zu Käufen. Das Engagement des Fonds in Unternehmensanleihen wurde durch eine Allokation in einem börsengehandelten Fonds (ETF) für Unternehmensanleihen mit kurzer Laufzeit erhöht, während das Engagement in britischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade ebenfalls aufgestockt wurde. Die Absicherung gegen den Aktienmarkt wurde verstärkt durch umfangreichere Short-Positionen in Futures auf die Indizes S&P 500 und Eurostoxx 50. Außerdem wurden Short-Positionen auf die Indizes Nasdaq 100 und DAX eingeführt.

Innerhalb des stabilisierenden Segments wurden Positionen in Staatsanleihen im ersten Quartal wieder in das Portfolio eingeführt, und zwar durch eine Mischung aus physischen Positionen und Futures auf US-amerikanische, australische und deutsche Titel. Auch Gold wurde in ähnlicher Weise durch eine ETC-Position aufgenommen, die aufgrund der gebotenen Absicherung gegen ein breites Spektrum von Ereignissen, einschließlich solcher, die mit Aktien- und Kreditrisiken verbunden sind, aber auch gegen die Entwertung von Fiatgeld, geopolitische Extremrisiken und ein hochinflationäres Regime, attraktiv erscheint.

Nach Meinung des Fondsmanagers ist es zum jetzigen Zeitpunkt sinnvoll, eine eher vorsichtige Haltung einzunehmen. Obschon die beträchtlichen Aktienkursrückgänge im Jahr 2022 die weiteren Renditeaussichten verbessert haben, bestehen eindeutige und beträchtliche Risiken. Der Schwerpunkt des Fonds liegt daher aktuell auf Kapitalerhalt.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Die Anteilsklasse Sterling C (Inc) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -8,04 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der SONIA (30 Tage aufgezinnt) +4 % ein Plus von 5,35 %, beide in Pfund Sterling. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP) Forts.

Die größten Abzüge von der Wertentwicklung des Fonds waren dem renditeorientierten Kern zuzuschreiben, allen voran globalen Aktien. Auf Aktienebene litten die Renditen der Bestände in Microsoft und ASML darunter, dass die Anleger von Growth in Value umschichteten. Die Aktien des E-Commerce-Giganten Alibaba wurden durch die weiterhin strenge Covid-19-Politik in China ausgebremst. Positiv entwickelten sich hingegen die Rohstofftitel im Fonds, darunter die Ölgesellschaften ConocoPhillips, Royal Dutch Shell und Marathon Petroleum. Der Aktienkurs von BAE Systems aus dem Rüstungssektor wurde von der Zusage von NATO-Mitgliedern beflügelt, ihre Verteidigungsausgaben zu erhöhen. AstraZeneca und Eli Lilly profitierten hingegen vom defensiven Charakter ihres Geschäfts sowie von den Gewinnzahlen. Innerhalb der renditestarken Kernanlagen verloren ansonsten Unternehmensanleihen an Wert. Alternative Anlagen leisteten dagegen einen leichten Positivbeitrag zur Rendite, insbesondere die Fondsbestände in Rohstoffen und erneuerbaren Energien, die als stark diversifizierende Anlagen fungierten.

Das stabilisierende Segment erzielte ebenfalls negative Renditen, allerdings schnitten diese Bestände ungleich besser ab als diejenigen im renditeorientierten Kernsegment. Das Engagement des Fonds in Gold durch börsengehandelte Anleihen auf Rohstoffbestände (Exchange-Traded Commodity, ETC) wirkte sich negativ aus, da der steigende US-Dollar und die höheren globalen Zinssätze den Goldpreis belasteten. Staatsanleihen wirkten angesichts steigender Zinssätze belastend. Die direkten Absicherungstransaktionen vermochten die Volatilität zu mindern, insbesondere im Verlauf des schwierigen zweiten Quartals. Unterdessen wies das aktive Long-Engagement im US-Dollar in manchen der schwierigsten Phasen des Jahres, vor allem im zweiten und dritten Quartal, ebenfalls eine starke negative Korrelation zu Risikoanlagen auf.

Die größte Portfolioveränderung im Berichtsjahr bestand in der Verringerung des Aktienengagements des Fonds. Dies erfolgte zunächst durch den Verkauf von Aktien, unter anderem Salesforce, Alphabet und Amazon.com. Im weiteren Jahresverlauf wurden auch Positionen in Chubb, Ecolab und Accenture veräußert. Das Aktiensegment wurde schrittweise in defensivere Werte umgeschichtet. So wurde die Position in dem auf Augenheilkunde und Fruchtbarkeitsbehandlung spezialisierten US-amerikanischen Unternehmen Cooper in der zweiten Jahreshälfte aufgestockt, da die Gewinne in den beiden Geschäftsbereichen ein rasches Wachstum verzeichneten. Bei den Energie- und Rohstoffunternehmen, beispielsweise Royal Dutch Shell und Anglo American kam es ferner zu Käufen. Das Engagement des Fonds in Unternehmensanleihen wurde durch eine Allokation in einem börsengehandelten Fonds (ETC) für Unternehmensanleihen mit kurzen Laufzeiten erhöht. Zugleich wurden neue Investitionen in Schwellenländeranleihen, d. h. in Lokalwährungstitel aus Brasilien und Mexiko, vorgenommen. Bei den alternativen Anlagen wurden Gewinne in dem Rohöl-ETC

mitgenommen, nachdem im ersten Halbjahr der Ölpreis stark angestiegen war. Die Absicherung gegen den Aktienmarkt wurde verstärkt durch umfangreichere Short-Positionen in Futures auf die Indizes S&P 500 und Eurostoxx 50. Außerdem wurden Short-Positionen auf die Indizes Nasdaq 100 und DAX eingeführt.

Innerhalb des stabilisierenden Segments wurden Positionen in Staatsanleihen im ersten Quartal wieder in das Portfolio eingeführt, und zwar durch eine Mischung aus physischen Positionen und Futures auf US-amerikanische, australische und deutsche Titel. Auch Gold wurde in ähnlicher Weise durch eine ETC-Position aufgenommen, die aufgrund der gebotenen Absicherung gegen ein breites Spektrum von Ereignissen, einschließlich solcher, die mit Aktien- und Kreditrisiken verbunden sind, aber auch gegen die Entwertung von Fiatgeld, geopolitische Extremrisiken und ein hochinflationäres Regime, attraktiv erscheint.

Nach Meinung des Fondsmanagers ist es zum jetzigen Zeitpunkt sinnvoll, eine eher vorsichtige Haltung einzunehmen. Obschon die beträchtlichen Aktienkursrückgänge im Jahr 2022 die weiteren Renditeaussichten verbessert haben, bestehen eindeutige und beträchtliche Risiken. Der Schwerpunkt des Fonds liegt daher aktuell auf Kapitalerhalt.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Die Anteilsklasse A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -9,25 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der SOFR (30 Tage aufgezinst) +4 % ein Plus von 5,48 % (jeweils in US-Dollar). Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die größten Abzüge von der Wertentwicklung des Fonds waren dem renditeorientierten Kern zuzuschreiben, allen voran globalen Aktien. Auf Aktienebene leisteten Positionen in Microsoft und ASML einen schwachen Renditebeitrag. Beide Unternehmen litten unter der Umschichtung der Anleger von Growth auf Value. Die Aktien des E-Commerce-Giganten Alibaba wurden durch die weiterhin strenge Covid-19-Politik in China ausgebremst. Positiv entwickelten sich hingegen die Rohstofftitel im Fonds, darunter die Ölgesellschaften ConocoPhillips, Royal Dutch Shell und Marathon Petroleum. Der Aktienkurs von BAE Systems aus dem Rüstungssektor wurde von der Zusage von NATO-Mitgliedern beflügelt, ihre Verteidigungsausgaben zu erhöhen. AstraZeneca und Eli Lilly profitierten hingegen vom defensiven Charakter ihres Geschäfts sowie von den Gewinnzahlen. Innerhalb der renditestarken Kernanlagen verloren ansonsten Unternehmensanleihen an Wert. Alternative Anlagen leisteten dagegen einen leichten Positivbeitrag zur Rendite, insbesondere die Fondsbestände in Rohstoffen und erneuerbaren Energien, die als stark diversifizierende Anlagen fungierten.

Das stabilisierende Segment erzielte ebenfalls negative Renditen, allerdings schnitten diese Bestände ungleich besser ab als diejenigen im renditeorientierten Kernsegment. Das Engagement des Fonds in Gold durch börsengehandelte Anleihen auf Rohstoffbestände (Exchange-Traded Commodity, ETC) wirkte sich negativ aus, da der steigende US-Dollar und die höheren globalen Zinssätze den Goldpreis belasteten. Staatsanleihen wirkten sich leicht negativ aus, da die Zinssätze stiegen. Die direkten Absicherungstransaktionen vermochten die Volatilität zu mindern, insbesondere im schwierigen zweiten Quartal.

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD) Forts.

Unterdessen wies das aktive Long-Engagement im US-Dollar in manchen der schwierigsten Phasen des Jahres, vor allem im zweiten und dritten Quartal, ebenfalls eine starke negative Korrelation zu Risikoanlagen auf. Die Währungsabsicherung gegen die Basiswährung des Fonds, den US-Dollar, der während des Berichtszeitraums zumeist stark tendierte, war von Vorteil.

Die größte Portfolioveränderung im Berichtsjahr bestand in der Verringerung des Aktienengagements des Fonds. Dies erfolgte zunächst durch den Verkauf von Aktien, unter anderem Salesforce, Alphabet und Amazon.com. Im weiteren Jahresverlauf wurden auch Positionen in Chubb, Ecolab und Accenture veräußert. Das Aktiensegment wurde schrittweise in defensivere Werte umgeschichtet. So wurde die Position in dem auf Augenheilkunde und Fruchtbarkeitsbehandlungen spezialisierten US-amerikanischen Unternehmen Cooper in der zweiten Jahreshälfte aufgestockt, da die Gewinne in den beiden Geschäftsbereichen ein rasches Wachstum verzeichneten. Auch bei Energieunternehmen, darunter Royal Dutch Shell und Anglo American, kam es zu Käufen. Das Engagement des Fonds in Unternehmensanleihen wurde durch eine Allokation in einem börsengehandelten Fonds (ETF) für Unternehmensanleihen mit kurzer Laufzeit erhöht, während das Engagement in britischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade ebenfalls aufgestockt wurde. Die Absicherung gegen den Aktienmarkt wurde verstärkt durch umfangreichere Short-Positionen in Futures auf die Indizes S&P 500 und Eurostoxx 50. Außerdem wurden Short-Positionen auf die Indizes Nasdaq 100 und DAX eingeführt.

Innerhalb des stabilisierenden Segments wurden Positionen in Staatsanleihen im ersten Quartal wieder in das Portfolio eingeführt, und zwar durch eine Mischung aus physischen Positionen und Futures auf US-amerikanische, australische und deutsche Titel. Auch Gold wurde in ähnlicher Weise durch eine ETC-Position aufgenommen, die aufgrund der gebotenen Absicherung gegen ein breites Spektrum von Ereignissen, einschließlich solcher, die mit Aktien- und Kreditrisiken verbunden sind, aber auch gegen die Entwertung von Fiatgeld, geopolitische Extremrisiken und ein hochinflationäres Regime, attraktiv erscheint.

Nach Meinung des Fondsmanagers ist es zum jetzigen Zeitpunkt sinnvoll, eine eher vorsichtige Haltung einzunehmen. Obschon die beträchtlichen Aktienkursrückgänge im Jahr 2022 die weiteren Renditeaussichten verbessert haben, bestehen eindeutige und beträchtliche Risiken. Der Schwerpunkt des Fonds liegt daher aktuell auf Kapitalerhalt.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -15,72 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -17,84 % für seinen Referenzwert, den MSCI AC World/JP Morgan GBI (60:40), und -14,58 % für den LIPPER Mixed Asset USD Balanced Global Average. Der Fonds übertraf seinen Referenzwert, blieb jedoch hinter dem Sektordurchschnitt zurück.

Auf Titlebene verzeichnete ein Bestand in Gold über einen börsengehandelten iShares-Rohstofffonds die beste Wertentwicklung, denn der Goldpreis schnitt im Jahresverlauf besser ab als die meisten anderen Vermögenswerte und das Edelmetall profitierte von seinem Status als „sicherer Hafen“. Die Versicherungsgesellschaft AIA Group aus Hongkong leistete einen starken Beitrag, da die Zinsen stiegen und China seine Beschränkungen im Zusammenhang mit Covid lockerte. Hubbell erzielte eine gute Performance dank der soliden Ergebnisse und der robusten Aussichten für die Elektrifizierung der US-Infrastruktur – ein wichtiger Teil der Geschäftstätigkeit von Hubbell. Die Vermeidung von Meta Platforms und Tesla trug ebenfalls positiv zur Rendite bei, da die Aktienkurse beider Unternehmen erheblich fielen. Auch eine kurzlaufende US-Staatsanleihe wirkte sich positiv aus.

Negativ war indes der Kursrückgang bei Sony, wo Unwägbarkeiten in Bezug auf die Sparten Spiele und Halbleiter belasteten. Die Beteiligung am Hipgnosis Songs Fund schmälerte die Wertentwicklung aufgrund von Anlegerbedenken um die steigenden Schuldendienstkosten. Darüber hinaus fielen die Aktien von Ecolab, dessen Quartalsergebnis durch Komplikationen infolge von Covid-19 und Lieferkettenprobleme beeinträchtigt wurde. Langfristige US-amerikanische und österreichische Staatsanleihen minderten ebenfalls die Rendite.

Zu Beginn des Jahres wurde eine neue Position in Exelon eröffnet. Diese Aktie bietet in einer Zeit, in der die Elektrifizierungstrends an Fahrt aufnehmen, ein defensives Engagement in Wachstumsmärkten. Ferner eröffnete der Fonds eine Position in Lonza Group (Schweiz). Als Auftragsunternehmen für die Entwicklung und Herstellung von Medikamenten wird Lonza Nutznießer der wachsenden Nachfrage nach biologischen Wirkstoffen der nächsten Generation sein. Ferner wurde eine Beteiligung an Fanuc gekauft, einem in Japan ansässigen Unternehmen, das insbesondere Maschinen für die Fabrikautomation und Robotertechnik herstellt. Die Aktie dürfte von langfristigen Trends wie niedriger Arbeitslosigkeit, höheren Lohnkosten und der zunehmenden Automatisierung in Fertigungsstätten profitieren. Gegen Ende des Berichtszeitraums wurde eine inflationsindexierte US-Schatzanleihe mit Fälligkeit 2028 gekauft. Diese risikoarme Anlage bietet nach Ansicht des Fondsmanagers in einem unsicheren wirtschaftlichen Umfeld eine attraktive Realrendite. Ebenfalls investiert wurde in Sanofi, Eli Lilly, Trane Technologies, TE Connectivity, Cooper Companies und Chubb.

Die Fondsposition in Taiwan Semiconductor wurde zu Beginn des Jahres nach einer starken Phase des Halbleiterzyklus verkauft. Dem Sektor kommen zwar verschiedene strukturelle Impulse zugute, doch Sorgen um die Stärke der künftigen Nachfrage und geopolitische Spannungen veranlassten den Fondsmanager, die Aktie abzustoßen. Ebenfalls verkauft wurde Bureau Veritas, weil der Fondsmanager mit potenzieller kurzfristiger Umsatzschwäche infolge der drohenden wirtschaftlichen Abschwächung rechnete. Veräußert wurden unter anderem auch CRH, Texas Instruments, Citigroup, Fresenius Medical Care und GlaxoSmithKline.

Da sich die Straffung der Geldpolitik allmählich auf die Wachstums- und Inflationsaussichten auswirkt, könnte sich der Fokus der Anleger von den Zinssätzen auf den Gewinnzyklus verlagern. Unternehmen mit robusten Gewinnprofilen dürften in einem schwächeren Konjunkturmilieu am besten abschneiden.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro W (Accumulation) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -14,32 %, verglichen mit einer Rendite von 4,08 % für den als Vergleichswert dienenden 1-Monats-EURIBOR + 4 %. Der Fonds erzielte nach Abzug von Gebühren eine negative Rendite und schnitt schlechter ab als sein Referenzwert.

Die größten Abzüge von der Wertentwicklung des Fonds waren dem renditeorientierten Kern und vor allem globalen Aktien zuzuschreiben. Auf Aktienebene war die an der Nasdaq notierte HeadHunter Group, die im russischen Online-Stellenmarkt engagiert ist, einer der negativsten Anlagewerte. Sie wurde von den Turbulenzen bei russischen Aktien nach dem Angriff auf die Ukraine in Mitleidenschaft gezogen und vom Handel ausgesetzt. Technologiewerte wie Microsoft und ASML litten darunter, dass die Anleger aus Growth-Aktien in Value-Aktien umschichteten. Das chinesische Unternehmen LONGi Green Energy Technology geriet wegen Kursrückgängen am chinesischen Markt unter Druck.

Eher positiv wirkte sich dagegen aus, dass Titel aus dem Gesundheitswesen wie AstraZeneca und Eli Lilly, die von der defensiven Ausrichtung ihrer Geschäftstätigkeit und ermutigenden Gewinnmeldungen profitierten, den Ertrag steigerten. Hubbell schnitt ebenfalls gut ab, unterstützt durch die erfolgreiche Umsetzung seiner Strategie und den günstigen Rückenwind steigender Ausgaben für die Elektrifizierung. Ansonsten minderten die alternativen Anlagen das Ergebnis im Kernsegment, teilweise aufgrund des Fondsengagements in Bezug auf CO₂-Emissionen, nachdem die vom Europäischen Parlament vorgeschlagenen Reformen den CO₂-Preis zurückgehen ließen. Darüber hinaus schnitten im Vereinigten Königreich notierte Investmentfonds aufgrund steigender Anleiherenditen schlechter ab.

Die Entscheidung, im gesamten Berichtszeitraum ein beträchtliches US-Dollar-Engagement vorzuhalten, wirkte sich positiv aus, da die US-Währung gegenüber dem Euro zulegte. Das Engagement des Fonds in Gold durch börsengehandelte Anleihen auf Rohstoffbestände erwies sich als negativ, da der fester tendierende US-Dollar und die höheren globalen Zinssätze den Goldpreis belasteten. Staatsanleihen wirkten sich leicht negativ aus, da die Zinssätze stiegen.

Die größte Portfolioveränderung im Berichtsjahr bestand in der Verringerung des Aktienengagements des Fonds. Dies erfolgte zunächst durch den Verkauf von Aktien, unter anderem Salesforce, Alphabet und Amazon.com. Im weiteren Jahresverlauf wurden Positionen in Chubb, Ecolab und Accenture verkauft. Die Aktienbestände des Fonds wurden schrittweise in defensivere Werte umgeschichtet. Das US-amerikanische Optikerunternehmen Cooper war ein wichtiger Neuzugang in der zweiten Jahreshälfte. Ein weiterer maßgeblicher Kauf war der Bergbaukonzern Anglo American. Das Unternehmen hat sein Profil im Hinblick auf Umwelt, Soziales und Corporate Governance (ESG) in den letzten Jahren deutlich verbessert. Die Anlagethese für dieses Unternehmen ist auch insofern sehr gut auf

ESG-Ziele abgestimmt, als seine am schnellsten wachsende Rohstoffbeteiligung in Kupfer besteht, eine Schlüsselkomponente für den Übergang zu einer grüneren Welt.

Im festverzinslichen Bereich wurde das Engagement des Fonds in Unternehmensanleihen durch eine Allokation in einem börsengehandelten Fonds (ETF) für Unternehmensanleihen mit kurzer Laufzeit erhöht, während britische Unternehmensanleihen mit Investment Grade ebenfalls aufgestockt wurden.

Auf der stabilisierenden Ebene wurden Positionen in Staatsanleihen erhöht, und zwar durch eine Mischung aus physischen Positionen und Futures auf US-amerikanische, australische und deutsche Anleihen. Ferner baute der Fondsmanager die Position in dem ETC aus.

Künftig bietet sich laut Fondsmanager ein recht vorsichtiger Ansatz an. Obschon die beträchtlichen Aktienkursrückgänge im Jahr 2022 die weiteren Renditeaussichten deutlich verbessert haben, bestehen auch beträchtliche Risiken. Der Fondsschwerpunkt gilt daher dem Kapitalerhalt.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,43 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -11,62 % für den Lipper Bond Global USD Average, jeweils in US-Dollar. Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber seinen Referenzwert.

Der russische Einmarsch in der Ukraine versetzte den globalen Märkten 2022 einen Schock und verschlimmerte die Inflations Sorgen und die Abschwächung des globalen Wirtschaftswachstums. Eine Kombination aus steigenden Staatsanleiherenditen und sich weitenden Kreditspreads hatte für Anleiheanleger im Verlauf des Jahres einen perfekten Sturm zur Folge.

In der ersten Jahreshälfte waren die übergewichteten Positionen des Fonds in den USA, im Vereinigten Königreich, in Europa und in Australien hauptverantwortlich für negative Renditen. Eine übergewichtete Allokation in risikoreicheren Anlagen, allen voran Unternehmensanleihen, verbrieften Instrumenten und Schwellenländern, wirkte sich ebenfalls auf die Wertentwicklung des Fonds aus, da sich die Spreads der meisten Risikoanlagen im Berichtszeitraum spürbar weiteten. Ebenfalls schwierig für den Fonds war das dritte Quartal, dies angesichts einer Übergewichtung der Duration in Industrieländern, die der Wertentwicklung in diesem Zeitraum am meisten schadete. Die aktive Positionierung am britischen Zinsmarkt war von Nachteil, da die ungedeckten Ausgabenpläne der britischen Regierung die Tragfähigkeit der öffentlichen Finanzen in Frage stellten, wodurch die Zinsen deutlich stiegen.

In der ersten Jahreshälfte profitierte der Fonds generell von seiner Positionierung, bei der er von einer flacheren Renditekurve ausging. Im Schlussquartal des Jahres war ein Großteil der positiven Renditen auf seine Übergewichtung der Duration in Industrieländern zurückzuführen.

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND Forts.
Angesichts einer deutlichen Übergewichtung US-amerikanischer, britischer und europäischer Zinssätze profitierte der Fonds in erheblichem Maße von der nachlassenden Inflation in den Industrieländern, da die Renditen gegenüber ihren Höchstständen von Ende Oktober deutlich rückläufig waren.

Im Hinblick auf die Anlagetätigkeit erhöhte der Fondsmanager in der ersten Jahreshälfte die Duration des Fonds markant von rund 0,7 Jahren auf 1,7 Jahre. Der Fonds steigerte ferner seine Übergewichtung der Duration im australischen Dollar, verringerte die Untergewichtung der Duration im britischen Pfund und stellte sich in Bezug auf den US-Dollar von einer Untergewichtung auf eine deutliche Übergewichtung der Duration um.

Bei den Währungspositionen des Fonds veränderte der Fondsmanager seine Position im Euro von Unter- auf Übergewichtung, im südkoreanischen Won stellte er sich neutral bis untergewichtet auf und im neuen Taiwan-Dollar untergewichtet bis neutral. Außerdem verkleinerte er die Long-Position des Fonds in US-Dollar leicht.

Auf Sektorebene nahm der Fondsmanager einige Änderungen vor: So stieß er Unternehmensanleihen aus dem Industriesektor und auf Hartwährungen lautende Schwellenländer-Staatsanleihen ab. Stattdessen stockte er Anlagen in US-amerikanischen Treasuries auf und erhöhte das Engagement des Fonds in Finanztiteln moderat.

Die Renditen und Spreads sind deutlich gestiegen, weshalb erstmals seit mehr als zehn Jahren die Möglichkeit besteht, mit Anleihen nennenswerte Erträge und zugleich potenzielle Kapitalgewinne zu erzielen, sollten die Renditen im Laufe der Zeit wieder sinken.

**Insight North America LLC
Januar 2023**

GLOBALE AKTIENMÄRKTE

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND**

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -21,79 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -18,36 % für den MSCI All-Country World Index NR, beides in US-Dollar. Der Fonds lieferte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Beeinträchtigt wurde die Fondsrendite sowohl durch die Aktienausswahl als auch durch die Sektorallokation. Während die Titelauswahl im Bereich Informationstechnologie besonders positiv ausfiel, war sie im Gesundheitswesen und bei Basiskonsumgütertiteln schwach. Auch die Untergewichtung im Energiebereich belastete die Performance.

Auf Aktienebene gehörte die Position des Fonds in Amazon zu den schwächsten. Das Management des Unternehmens warnte vor niedrigen Verbraucherausgaben, und die Umsatz- und Betriebsergebnisprognosen für das vierte Quartal fielen enttäuschend aus. Die Aktien von Sony fielen aufgrund von Unwägbarkeiten in den Sparten Spiele und Halbleiter, und auch die Aktien von Darling Ingredients büßten nach enttäuschenden Drittquartalsgewinnen an Wert ein. Unerwartet schwach war insbesondere die Futtermittelsparte des Unternehmens, die eine bessere Leistung in den Segmenten Lebensmittel und Kraftstoffe zunichtemachte.

Andererseits steigerten die Aktien der AIA-Gruppe die Rendite, nachdem China seine Covid-19-Beschränkungen lockerte und die Versicherungsgesellschaft die Erlaubnis erhielt, in der Provinz Henan eine Zweigniederlassung aufzubauen. Der Elektrogerätehersteller Hubbell war ein weiterer Spitzenreiter im Fonds, der gute Ergebnisse erzielte und die Prognosen für 2022 anhebte. Trane Technologies leistete einen erstaunlichen Beitrag, nachdem Umsatz und Gewinn des Unternehmens im zweiten Quartal positiv überraschten. Der Verzicht auf Tesla und Meta Platforms trug ebenfalls dazu bei, die Verluste zu begrenzen: Deren Aktienkurse gaben im Spätherbst deutlich nach.

Zu den Veränderungen auf Portfolioebene zählten der Kauf des US-Versorgers Exelon durch Umschichtung aus Eversource Energy, da Exelon ein besseres Wachstum erzielen dürfte als Eversource. Der Fondsmanager investierte in Nestlé, weil er von der starken Cash-Generierung und den defensiven Eigenschaften dieses Unternehmens überzeugt war. In dem Stromnetzbetreiber SSE wurde unterdessen ebenfalls eine Position eröffnet. Das Unternehmen erzeugt Strom aus erneuerbaren Energien und ist gut aufgestellt, um mit seiner Sparte für erneuerbare Energien von der Dekarbonisierung der Strommärkte zu profitieren. Weitere Neuzugänge waren Chubb, Sanofi, die bereits erwähnten Titel von Trane und Hubbell, SCOR, Progressive und Bank Mandiri.

Vivendi wurde abgestoßen, weil Belege für eine immer schlechtere Erfolgsbilanz bei der Kapitalallokation und der Unternehmensführung vorlagen. Der Fondsmanager trennte sich ferner von Unilever und trug damit der zunehmenden Belastung der Verbrauchereinkommen sowie dem Preisdruck bei Rohstoffen auf der Input-Seite Rechnung. Das Engagement des Fonds im Bereich Halbleiter wurde durch den Verkauf von Texas Instruments verringert, denn bei Technologie-Hardware besteht die Möglichkeit eines zyklischen Abschwungs. Andere Verkäufe betrafen Ferguson, Citigroup, Suzuki Motor, Costco Wholesale, Informa und TE Connectivity.

Globale Aktienmärkte Forts.

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

Die Inflation und der Zinserhöhungszyklus haben zu einem sprunghaften Anstieg der Anleiherenditen geführt, was sich in der jüngsten Vergangenheit wiederum negativ auf die Bewertung von Finanzanlagen auswirkte. Da sich die Straffung der Geldpolitik allmählich auf die Wachstums- und Inflationsaussichten auswirkt, könnte sich der Fokus der Anleger von den Zinssätzen auf den Gewinnzyklus verlagern. Unternehmen mit robusten Gewinnprofilen dürften nach Ansicht des Fondsmanagers in einem schwächeren Konjunkturmilieu am besten abschneiden.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -4,73 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -17,54 % für den FTSE World Index TR, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite, übertraf jedoch seinen Referenzwert. Verantwortlich dafür war vor allem die starke Aktienauswahl.

Auf Aktienebene leistete Marathon Petroleum den stärksten Beitrag. Die Quartalsgewinne des Unternehmens übertrafen die Marktprognosen, denn der US-Raffineriekonzern profitierte von einem Anstieg der Kraftstoffpreise. BAE Systems entwickelte sich positiv. Das Rüstungsunternehmen dürfte von steigenden Staatsausgaben profitieren, da die geopolitischen Spannungen anhalten. British American Tobacco zeigte ebenfalls Stärke, was seinen robusten Cashflows zu verdanken war, die auf hohe Zigarettenpreise zurückzuführen sind. Zudem wirkte sich die Nullgewichtung der renditeschwachen Aktien von Meta Platforms und Tesla positiv aus, denn die Kurse beider Unternehmen fielen mit Nachdruck.

Negativ war hingegen die Entwicklung von Taylor Wimpey für die Performance, was an der Nachricht lag, dass Bauträger von der Regierung gezwungen werden, für die hohen Kosten der Sanierung von Fassaden mittelgroßer Gebäude aufzukommen. Darüber hinaus belasteten die potenziellen Auswirkungen steigender Zinsen und Energiekosten auf den Wohnungsmarkt die Stimmung. Die Aktien von Continental tendierten schwach, da die Gewinne des deutschen Reifenherstellers hinter den Marktprognosen zurückblieben. Medtronic zeigte ebenfalls Schwäche. Hier führten Lieferkettenprobleme zu geringerem Wachstum. Außerdem schmälerte der starke US-Dollar das ausgewiesene Ergebnis.

Im Hinblick auf die Portfolioaktivitäten wurde eine Beteiligung an Johnson Controls erworben. Da die Lieferkettenengpässe nachlassen, könnten niedrigere Inputkosten für höhere Gewinnspannen sorgen. Der Fondsmanager ist der Meinung, dass höhere Produktpreise und wachsende Margen zu einer größeren Ertragskraft und höheren freien Cashflows führen sollten, als derzeit am Markt eingepreist. Eine Position in Broadcom wurde eröffnet. Dieses Unternehmen kann eine beeindruckende Erfolgsbilanz bei Fusionen und Übernahmen vorweisen und transformiert seine Rentabilität, indem es sich nur noch auf sein Kerngeschäft und die größten Kunden konzentriert. Eine weitere Position wurde in dem deutschen

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND Forts.

Automobilhersteller Mercedes-Benz eingegangen. Das Management legt den Schwerpunkt eindeutig auf die Rentabilität statt auf den Absatz und führt erfolgreich Einsparungen bei den Fixkosten durch. Weitere Neuzugänge waren FedEx, Fidelity National Information Services, Enel und Garmin.

Die Beteiligung an Citigroup wurde in der Erwartung veräußert, dass die Bank infolge des Ausschlusses von Russland aus dem Finanzsystem Umsatzeinbußen erleiden könnte. Ebenso wurde Merck & Co verkauft. Die Aktie hatte sich gut entwickelt, zuletzt aufgrund von Gerüchten, dass das Unternehmen Seagen (Pharmazie) übernehmen wolle. Die Beteiligung an Hasbro wurde abgestoßen, weil Zweifel an der Nachhaltigkeit der Umsätze in der Sparte „Wizards of the Coast“ aufkamen.

Der Fondsmanager glaubt, dass ein Umfeld mit langsamerem Wachstum, höheren Zinsen und hoher Inflation für ertragsorientierte Aktien im Jahr 2023 relativ günstige Bedingungen schaffen könnte. Seit der Pandemie haben sich die Bilanzen verbessert, und die Gewinne haben sich schnell erholt, so dass Dividendenausschüttungen problemlos bestritten werden können. Laut Einschätzung des Fondsmanagers werden ertragsorientierte Aktien derzeit zu attraktiven Bewertungen gehandelt.

Newton Investment Management Limited** Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -22,92 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verbuchten der MSCI World Index -18,14 % und der LIPPER Equity Global Average -20,87 %, jeweils in US-Dollar. Der Fonds erzielte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert und dem Sektordurchschnitt zurück.

Für die Aktienmärkte war 2022 ein turbulentes Jahr. Russlands Einmarsch in der Ukraine erschütterte das ohnehin schon schwache Vertrauen der Anleger zu Beginn des Jahres, unterbrach Lieferketten und sorgte für Aufwärtsdruck bei den Rohstoff- und Energiepreisen. Die Inflation und die Reaktionen der Zentralbanken standen für die Anleger über weite Teile des Jahres im Vordergrund. Da die Preise stärker und schneller stiegen, als viele erwartet hatten, sahen sich die geldpolitischen Entscheidungsträger zu aggressiven Zinserhöhungen gezwungen. Dies wiederum schürte Befürchtungen, wonach es weltweit zu einer Konjunkturabschwächung kommen könnte, wengleich sich die Datenlage in den letzten Monaten des Jahres als widerstandsfähiger erwies als vielfach gedacht.

Am meisten belastete die Titelauswahl im Gesundheitssektor. Auch ein mangelndes Engagement im Energiesektor wirkte sich negativ aus, denn dieser Sektor verzeichnete infolge höherer Öl- und Gaspreise starke Zugewinne. Die Portfoliobestände in den schwächeren zyklischen Konsumgüterwerten schnitten jedoch im Vergleich besser ab und waren die Hauptquelle für positive Renditen im Fonds. Der Informationstechnologiesektor zeigte zwar ebenfalls Schwäche, doch entwickelten sich die Fondsanlagen in diesem Sektor besser als die des Referenzwerts.

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND Forts.

Auf Unternehmensebene schälerten zwei Titel aus dem Gesundheitswesen – Illumina und Edwards Lifesciences – die Performance deutlich. Illumina hatte mit enttäuschenden Ergebnissen zu kämpfen, Edwards Lifesciences dagegen mit unerwartet niedrigen Umsätzen eines Produkt für die Transkatheter-Aortenklappenimplantation. Beide Unternehmen bleiben nach Ansicht des Fondsmanagers auf lange Sicht überzeugend.

Positiver fiel dagegen die Entwicklung des dänischen Pharmakonzerns Novo Nordisk aus. Die Umsätze mit seinen Diabetes- und Adipositas-Therapien waren das ganze Jahr über robust. Die asiatische Versicherungsgesellschaft AIA Group erzielte ebenfalls gute Ergebnisse, die vor allem im Schlussquartal des Jahres von der Lockerung der Covid-19-Beschränkungen in China und Hongkong profitierten.

Drei Positionen wurden im Geschäftsjahr verkauft: Ecolab, Fanuc und Tencent Holdings. Alle drei hatten mit Herausforderungen zu kämpfen, und es entstand der Eindruck, dass anderswo bessere Fundamentaldaten und langfristige Wachstumsaussichten zu finden seien. Zu den Neuzugängen gehörten Fastenal, West Pharmaceutical Services und Old Dominion Freight Line.

Angesichts der anhaltenden Inflation und der höheren Zinssätze bestehen unvermindert Bedenken um das Wirtschaftswachstum. In vielen Ländern werden die Verbraucher nach wie vor durch höhere Preise unter Druck gesetzt. Zugleich haben einige Unternehmen mit einer schrumpfenden Nachfrage und erhöhten Kosten zu kämpfen. Während jedoch die Wachstumsdynamik im Zuge von Covid abgenommen hat und einige Regionen Gefahr laufen, in eine Rezession abzurutschen, sind die Wirtschaftsdaten relativ stabil geblieben. In China könnte die Aufhebung der Covid-19-Beschränkungen das Wachstum ankurbeln. Allerdings bleibt abzuwarten, ob die im Anschluss sprunghaft steigenden Infektionszahlen die Erholung behindern werden. Die Ereignisse in der Ukraine und die Spannungen zwischen China und dem Westen sind indes allgegenwärtig und könnten auch im Jahr 2023 weiterhin für Volatilität sorgen.

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -22,40 % nach Abzug von Gebühren, während der MSCI AC World Index NR eine Rendite von -18,36 % verbuchte, beide Angaben in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die Aktienauswahl in den USA schälerte die Rendite in dieser Region. Das Gesundheitswesen war der Sektor mit der schlechtesten Wertentwicklung und wirkte sich ebenfalls negativ aus. Sony war aufgrund von Unwägbarkeiten in den Sparten Spiele und Halbleiter die schwächste Position im Fonds. Auch die Aktien von Amazon entwickelten sich schwach. Die Unternehmensleitung warnte vor niedrigen Verbraucherausgaben, und die Umsatz- und Betriebsergebnisprognosen für das vierte Quartal fielen enttäuschend aus. Die Aktien von Ferguson verloren an Wert, da sich die Anleger über die nachlassende Dynamik bei den Absätzen und Margen sorgten. Auch der Verzicht auf ein Engagement in den Aktien von Exxon Mobil belastete die Performance, denn der Aktienkurs wurde vom Anstieg der Energiepreise begünstigt.

Positiv war hingegen, dass sich der Informationstechnologiesektor gut entwickelte, wobei Mastercard und NVIDIA dazu beitrugen, die Verluste zu begrenzen. Eine Position in der AIA Group leistete den stärksten Beitrag im Fonds. Die Aktien stiegen, nachdem China seine Covid-19-Beschränkungen lockerte und die Versicherungsgesellschaft die Erlaubnis erhielt, in der Provinz Henan eine Zweigniederlassung aufzubauen. Der Hersteller von Elektronikgütern Hubbell erzielte gute Ergebnisse und hob gleichzeitig die Prognose für 2022 an. Trane Technologies leistete ebenfalls einen erstaunlichen Beitrag, da Umsatz und Gewinn des Unternehmens positiv überraschten. Das mangelnde Engagement in Tesla oder Meta Plattformen war von Vorteil, da die Aktienkurse dieser Unternehmen deutlich fielen.

Zu Beginn des Berichtszeitraums wurde eine Beteiligung an Exelon erworben. Der Fondsmanager geht davon aus, dass das Unternehmen ein höheres Wachstum der Vermögensbasis erzielen wird als manche Mitbewerber. Darüber hinaus wurde eine Position in Hubbell begründet. Die Aktie bietet ein hochwertiges Engagement bezogen auf Investitionsausgaben im US-amerikanischen Versorgungssektor und könnte auch vom allgemeinem Rückenwind durch den Elektrifizierungstrend profitieren. Außerdem wurde eine Position in dem Stromnetzbetreiber SSE eröffnet. Das Unternehmen erzeugt Strom aus erneuerbaren Energien und ist gut positioniert, um von der Dekarbonisierung der Strommärkte zu profitieren. Ein weiterer Neuzugang war Fanuc, ein in Japan ansässiges Unternehmen, das insbesondere Maschinen für die Fabrikautomation und Robotertechnik herstellt. Hier ist der Fondsmanager davon überzeugt, dass sich die Branchentrends verbessern dürften. Dazu zählen die niedrige Arbeitslosigkeit, höhere Lohnkosten und die zunehmende Automatisierung in den Fabriken.

Der Fondsmanager trennte sich auch von Unilever und trug damit der zunehmenden Belastung der Verbrauchereinkommen sowie dem Preisdruck bei Rohstoffen auf der Input-Seite Rechnung. Der Bestand in Ferguson, einem Vertriebsunternehmen für Industribedarf, wurde infolge des schwächeren Konjunkturausblicks und der Erwartung des Fondsmanagers veräußert, dass die Margen in Zukunft nur wenig expandieren werden. Nach ihrer positiven Entwicklung in einem inflationären Umfeld wurde die Beteiligung an Costco Wholesale abgestoßen. Die Aktienbewertung des Unternehmens erschien im Verhältnis zu seinem zugrunde liegenden Wachstum hoch.

Die hohe Inflation in Verbindung mit gestiegenen Zinssätzen führte zu einem sprunghaften Anstieg der Anleiherenditen, was sich in der jüngsten Vergangenheit negativ auf die Bewertung von Finanzanlagen ausgewirkt hat. Da die Straffung der Geldpolitik allmählich auf die Wachstums- und Inflationsaussichten durchschlägt, könnte sich laut Einschätzung des Fondsmanagers der Fokus der Anleger von den Zinssätzen auf den Gewinnzyklus verlagern. Unternehmen mit robusten Gewinnprofilen dürften demnach in einem schwächeren Konjunkturmilieu am besten abschneiden.

Newton Investment Management Limited**
Januar 2023

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -15,41 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verbuchten der MSCI World Index -12,78 % und der Lipper Equity Global Average -15,67 % (alle Angaben in Euro). Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert und dem Sektordurchschnitt zurück.

Aufgrund von Bedenken über die steigende Inflation tendierten die Aktienmärkte 2022 schwach. Verschärft wurde dies durch den Krieg in der Ukraine und die daraus resultierenden Zinserhöhungen seitens maßgeblicher Zentralbanken. Befürchtungen, wonach ein erheblicher wirtschaftlicher Abschwung die kurzfristigen Aussichten für die Unternehmensgewinne belasten würde, nahmen überhand.

Am meisten beeinträchtigte auf Sektorebene das mangelnde Engagement in Energietiteln, die sich im Laufe des Jahres dank höherer Öl- und Gaspreise gut entwickelten. Wertabzüge brachten aber auch Industrierwerte, die im Vergleich zum Referenzwert schwach abschnitten.

Im Laufe des Jahres führten die Konjunkturbedenken und die steigenden Zinsen zu einer Verschiebung der Anlegerpräferenz von Growth- auf Value-Titel. Die Bestände des Fonds im schwachen zyklischen Konsumgütersektor schnitten im Vergleich allerdings deutlich besser ab und leisteten letztlich einen Beitrag zur Performance im Berichtszeitraum. Die Bestände des Fonds im Bereich Informationstechnologie (IT) entwickelten sich ebenfalls besser als diejenigen des Referenzwerts.

Zwei große IT-Unternehmen, Taiwan Semiconductor und Keyence, zählten dagegen zu den größten Verlierern auf Aktienebene. Obwohl beide Unternehmen ein gutes Gewinnwachstum verzeichneten, wurden ihre Aktien durch die Marktpräferenz für Value-Titel beeinträchtigt. Zudem wirkte sich die Sorge um die Beziehungen zwischen China und Taiwan negativ auf Taiwan Semiconductor aus. Die Position des Fonds in dem auf Diabetes und Adipositas spezialisierten Unternehmen Novo Nordisk half, die Verluste zu mindern. Das Unternehmen hat dank der guten Umsätze mit seinen GLP1-Produkten erneut hervorragende Ergebnisse erzielt, und sein neues Medikament gegen Fettleibigkeit, Wegovy, sorgt unvermindert für Anlegerinteresse. Die Aktien des im gesamtasiatischen Raum tätigen Lebensversicherers AIA Group legten im Jahresverlauf ebenfalls zu. Hier hellte die Lockerung der Pandemiebeschränkungen in China und Hongkong die Anlegerstimmung auf. Auch das Gesundheitsunternehmen Johnson & Johnson hat sich im Jahresverlauf gut entwickelt.

Dennoch beschloss der Fondsmanager gegen Ende des Berichtszeitraums, Johnson & Johnson zu verkaufen. Begründet wird dies damit, dass das Unternehmen eine umstrittene Rechtsstruktur anwendet, um potenzielle Haftungsansprüche im Zusammenhang mit seinen Talkumpuderprodukten abzuwehren. Weitere nennenswerte Verkäufe betrafen unter anderem Fanuc, Colgate-Palmolive und Oracle. Angesichts der Verschlechterung der Unternehmensbilanz von Oracle entschied sich der Fondsmanager, die Erlöse in Unternehmen mit einem attraktiveren Finanzprofil umzuschichten.

Unterdessen wurden Bestände in Costco Wholesale, einem weltweit führenden Betreiber von Mitglieder-Großmärkten, und West Pharmaceutical Services, einem Hersteller von Verbrauchsmaterialien für injizierbare Arzneimittel, erworben.

Der Fondsmanager geht auf kurze Sicht von Volatilität an den Aktienmärkten aus. Der Kampf gegen die Inflation ist noch nicht gewonnen und die Zentralbanken bleiben defensiv. Positiv war hingegen, dass mehrere Rohstoff- und Energiepreise von ihren Höchstständen zurückgefallen sind und der Druck auf die Lieferketten nachgelassen hat, auch wenn dies zum Teil auf das schwächere Wachstum zurückzuführen ist. Bislang haben sich die Wirtschaftsindikatoren jedoch als robuster erwiesen, als laut Prognosen zu erwarten war. Die geopolitische Unsicherheit ist angesichts des Krieges in der Ukraine und der angespannten Beziehungen zwischen dem Westen und China nach wie vor groß, wenngleich wirtschaftlicher Pragmatismus in letzterem Punkt das Ausmaß einer weiteren Verschlechterung mindern könnte.

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2023

REGIONALE AKTIEN

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Inc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -11,11 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -16,41 % im FTSE Asia Pacific ex Japan Index TR (US-Dollar). Der Fonds verbuchte eine negative Rendite, übertraf jedoch seinen Referenzwert. Verantwortlich dafür waren zum einen die starke Aktienausswahl und zum anderen die Vermögensallokation.

Auf Aktienebene war die ertragsstärkste Fondsposition das indische Tabakunternehmen ITC, dessen defensive Merkmale den Anlegern angesichts eines unsicheren Konjunkturausblicks attraktiv erschienen. Zudem profitierte der Fonds spürbar von seiner Sektorpositionierung im Finanzwesen, da die Beteiligungen an den Banken DBS, United Overseas Bank und Bank Rakyat Indonesia im Umfeld steigender Zinssätze gut abschnitten. Auch die Insurance Australia Group leistete angesichts einer erwarteten Gewinnerholung im Zuge verbesserter Preistrends einen starken Beitrag.

Samsung Electronics hingegen war die ertragsschwächste Aktie, was auf einen zyklischen Abschwung im Sektor für Speicherprodukte und eine allgemeine Schwäche bei Technologieaktien zurückzuführen war. Andere Technologiewerte wie der Halbleiterchip-Hersteller MediaTek, der indische IT-Dienstleister Infosys und der Hersteller von kupferkaschierten Laminaten Elite Materials entwickelten sich angesichts der schleppenden Endnachfrage und enttäuschender Gewinnraten ebenfalls schwach.

Zu den Veränderungen auf Portfolioebene zählte der Kauf von Hanon Systems aus Südkorea. Das Unternehmen ist überwiegend in der Produktion und im Vertrieb von Heizungs-, Lüftungs- und Klimaanlage (HLK) für Autos tätig. Hanon ist eines der führenden Unternehmen in der HLK-Technologie. Der Fonds eröffnete eine Position in der National Australia Bank. Deren Geschäft hat sich stark gewandelt. Die Technologiesysteme wurden modernisiert und nicht zum Kerngeschäft zählende Sparten wurden abgestoßen. Dass sich die australische Wirtschaft relativ robust zeigt, könnte dem Unternehmen zusätzliche Impulse geben. Unterdessen wurde in Advantech, einem weltweit führenden Unternehmen für Industriecomputer aus Taiwan, eine neue Position eröffnet. Nach Einschätzung des Fondsmanagers ist Advantech ein qualitativ hochwertiges Unternehmen mit wettbewerbsfähigen Lösungen sowohl im Bereich der Hardware als auch der Software für das industrielle Internet der Dinge. Ebenfalls zugekauft wurden Woodside Energy, Singapore Exchange und KT Corporation.

Der australische Kasinobetreiber Star Entertainment wurde verkauft, da er keine Dividende ausschüttet. Belastet wurde die Aktie weiterhin von regulatorischen Bedenken, da die australische Aufsichtsbehörde für Finanzkriminalität ihre laufenden Ermittlungen gegen das Unternehmen ausweitete. Ebenso wurde der neuseeländische Kasinobetreiber SkyCity Entertainment aufgrund anhaltender regulatorischer Bedenken und Einschränkungen bei den diskretionären Verbraucherausgaben in einem Umfeld steigender Zinssätze verkauft. Der Fonds trennte sich von Delta Electronics, nachdem die Dividendenrendite beinahe die Untergrenze des Fonds markierte. Weitere Verkäufe betrafen die Bank Central Asia und die Kasikornbank.

Mit Blick auf die Zukunft könnte die Straffung der Finanzbedingungen in Verbindung mit der hohen Inflation die Aussichten sowohl für die

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND Forts.

Verbraucherausgaben als auch für die Rentabilität der Unternehmen beeinträchtigen. In Asien könnte indes die Wiederöffnung der Wirtschaft in China nach den Covid-19-Beschränkungen für eine gewisse Unterstützung sorgen. Schließlich steht für die größte Volkswirtschaft der Region nun eine gewisse Normalisierung der Konjunktur an.

Vor dem Hintergrund einer anfälligen Weltwirtschaft bleiben die Argumente für ertragsorientierte Anlagen stark. Der Fondsmanager ist der Überzeugung, dass der Fondsschwerpunkt auf Qualitätswerten mit starken Bilanzen und Preismacht etwaige Volatilitätsschübe mindern dürfte.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON ASIAN OPPORTUNITIES FUND*

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -22,31 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -17,19 % im MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR (jeweils in US-Dollar). Der Fonds generierte eine negative Rendite und blieb hinter dem Referenzwert zurück. Sowohl die Aktienausswahl als auch die Sektorallokation waren für die relativen Renditen abträglich.

Das mangelnde Engagement in der BHP Group schadete den Renditen auf Aktienebene am meisten, denn die australische Bergbaugesellschaft schnitt angesichts robuster Rohstoffpreise gut ab. Der chinesische Batteriehersteller Wuxi Lead Intelligent Equipment entwickelte sich unterdurchschnittlich, da die Anleger die Widerstandsfähigkeit der Aufträge in einer Rezession und angesichts von Herausforderungen rund um die Nachfrage nach Elektrofahrzeugen in Frage stellten. Tencent Music Entertainment tendierte nach rückläufigen Umsätzen mit Social-Entertainment-Diensten angesichts eines schwierigen Wettbewerbsumfelds und einer schwachen Konjunktur ebenfalls schwach. Darüber hinaus brachte auch ASML Renditeabzüge, obwohl das Unternehmen solide Zahlen vorlegte und Kapazitätssteigerungen zusicherte, um die hohe Nachfrage nach seinen EUV-Lithografie-Geräten zu decken.

Ein positiver Faktor war, dass die Versicherungsgesellschaft AIA Group aus Hongkong einen wesentlichen Performancebeitrag leistete, nachdem sie gute Ergebnisse ausgewiesen, ein umfangreiches Aktienrückkaufprogramm angekündigt und verbesserte Aussichten im Neugeschäft gemeldet hatte. Delta Electronics zeigte ebenfalls eine gute Performance und übertraf mit seinem Umsatz und Gewinn im zweiten Quartal die Konsenserwartungen. Der indische Automobilhersteller Maruti Suzuki leistete im Berichtsjahr einen positiven Beitrag, da er weiterhin Rekordumsätze im In- und Ausland erzielte.

Im Hinblick auf die Portfolioveränderungen wurde das indonesische Unternehmen Sea, eine E-Commerce- und Gaming-Plattform, erworben. Dieses scheint gut positioniert zu sein, um von den beträchtlichen E-Commerce-Möglichkeiten in der ASEAN-Region (Association of Southeast Asian Nations) zu profitieren. In dem taiwanesischen Unternehmen Delta Electronics, das Stromerzeugerausrüstung herstellt und verkauft, wurde eine neue Position eröffnet. Das Unternehmen ist gut positioniert, um vom langfristigen Wachstum in den Bereichen Industrieautomatisierung und saubere Energie in den Schwellenländern zu profitieren. Außerdem wurde Bank Mandiri

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON ASIAN OPPORTUNITIES FUND* Forts.

in den Fonds aufgenommen. Die makroökonomische Dynamik in Indonesien erscheint attraktiv. Nach Ansicht des Fondsmanagers weist Mandiri Wettbewerbsvorteile auf, dank derer die Bank überdurchschnittliche Renditen auf das investierte Kapital erzielen könnte. Ebenfalls neu im Portfolio waren HDFC Life, NetEase und Meituan.

Der Bestand in dem indischen Schmuckunternehmen Titan wurde nach einem Zeitraum der starken relativen Performance veräußert. Die Position in Elite Materials, das kupferkaschiertes Laminat herstellt, wurde ebenfalls verkauft, weil nach einer Phase mit starker relativer Wertentwicklung von einem schwächeren Gewinnzyklus ausgegangen wurde. Die Beteiligung an LG Chem wurde nach ihrer starken relativen Performance veräußert. Ebenfalls abgestoßen wurden Jubilant Foodworks und Alibaba.

Derzeit notieren asiatische Aktien mit einem ungewöhnlich hohen Abschlag gegenüber ihren Pendanten aus Industrieländern, was für die Märkte der Schwellenländer ein günstiges Umfeld schafft. Die auf lange Sicht eindeutigen Chancen in den asiatischen Märkten beruhen auf einem relativ hohen Einkommenswachstum, einer raschen Zunahme der Produktdurchdringung und Spielraum für eine Branchenkonsolidierung. Dem Fondsmanager zufolge bietet sich eine einzigartige Chance für Unternehmen aus dem asiatischen Markt. Dies trifft insbesondere auf diejenigen zu, die gut auf stabile langfristige Wachstumstrends ausgerichtet sind und angesichts ihres differenzierten Kundenangebots und ihrer Geschäftsausführung von solchen Chancen stärker profitieren können als ihre Vergleichsgruppe.

Newton Investment Management Limited** Januar 2023

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A des Fonds eine Rendite von 1,44 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI Brazil 10/40 NR Index eine Rendite von 8,77 % und der LIPPER Equity Brazil Average verbuchte 4,06 %, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds generierte eine positive Rendite, blieb aber nach Gebühren hinter seinem Referenzwert zurück.

Auf Branchenebene leisteten die Fondsanlagen (insbesondere die Aktienausswahl des Fondsmanagers) in Logistik sowie die Übergewichtung und Aktienausswahl in Stahl den Hauptbeitrag zur Performance des Fonds im Vergleich zum Referenzwert. Eine negative relative Performance entstand durch die Allokation des Fonds in globalen Investitionsgüterwerten, eine untergewichtete Position im Öl- und Gassektor und die Titelauswahl im Versorgungssektor.

Auf Titlebene profitierte der Fonds am meisten von seinem Engagement in Assaí und Santos Brasil. Die Aktien von Assaí lieferten im Berichtsjahr starke Ergebnisse, da die Verbraucher in einem Umfeld hoher Inflation und hoher Zinssätze zu kostengünstigeren Lebensmitteleinzelhändlern wechselten. Darüber hinaus kündigte der Hauptaktionär an, dass er seinen Anteil an dem Unternehmen verkaufen könnte. Dies dürfte der Corporate Governance zugutekommen. Santos Brasil lieferte mit hohen Volumina im Vergleich zu den bereits starken Zahlen im Jahr 2021 ebenfalls starke Ergebnisse in allen Segmenten.

Zu den Schlusslichtern auf Aktienebene zählten Americanas, Marfrig, Embraer und BRF. Americanas verlor aufgrund der erneuten Schwäche unter Konsumgüterwerten, die auf den Ausverkauf globaler Wachstumsunternehmen und höhere inländische Zinssätze zurückzuführen war. Die Aktien von Marfrig gaben nach, weil die Gewinnspannen für Rindfleisch in den USA im Laufe des Jahres zurückgingen. Ein weiterer Grund war die Beteiligung von 33 % an BRF, dessen Kurs aus Sorge um die Verschuldung angesichts der anhaltend hohen Zinssätze abrutschte. Die Aktie von Embraer geriet unter Druck, nachdem Probleme in der Lieferkette zu Verzögerungen führten, die sich in geringeren Gewinnspannen niederschlugen. Zugleich hat das Unternehmen nach wie vor an den Kosten für das Schiedsverfahren gegen Boeing zu knapsen.

Im Jahresverlauf eröffnete der Anlageverwalter neue Positionen in: BB Seguridade (defensive Finanzdienstleistungen), Banco Pactual (Banken), BRF (Lebensmittelhersteller), Eletrobras (Versorgungsunternehmen) und 3R (Öl und Gas). Ferner veräußerte der Fondsmanager die Fondsbestände in C&A (Nicht-Basiskonsumgüter), CESP (Versorgungsunternehmen) und Petrobras (Öl und Gas).

2022 spielten an den Aktienmärkten mehrere Faktoren eine Rolle, darunter die weltweite Inflation, die steigenden Zinssätze in den meisten Industrieländern, die Einschränkungen durch die Null-Covid-Politik in China und das Risiko einer weltweiten Rezession. Infolgedessen verzeichneten die Märkte in den meisten Industrieländern auf Jahresbasis ein Minus (in einigen Fällen, wie in den USA, waren die maßgeblichen Indizes stark rückläufig). Abgesehen von den externen Faktoren kam es in Brasilien im Berichtszeitraum zu Parlamentswahlen, die zusätzlich für Volatilität an den Märkten sorgten.

Trotz dieser Herausforderungen erzielten einige Sektoren in Brasilien eine starke Performance, insbesondere Unternehmen aus dem Rohstoffsektor (z. B. Öl und Gas sowie Bergbau). Dies erklärt auch die erheblichen Renditeunterschiede nach Sektoren.

Obleich die neue Regierung vor einigen Herausforderungen steht, preisen die Kurse nach Ansicht des Fondsmanagers bereits viele der künftig potenziellen Risiken ein, insbesondere im Hinblick auf die fiskalpolitische Situation. Ungeachtet der Marktskepsis hat die neue Regierung Maßnahmen vorgeschlagen, mit denen bis 2024 ein Primärdefizit von null erreicht werden soll. In diesem Szenario dürfte der Fonds nach Ansicht des Fondsmanagers gut positioniert sein, um von günstigen Gelegenheiten zu ausgesprochen angemessenen Preisen zu profitieren.

ARX Investimentos Ltda Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES FUND*

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -24,57 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -20,09 % im MSCI Emerging Markets Index NR, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück. Verantwortlich dafür war vor allem die schwache Aktienausswahl.

Auf Aktienebene zeigte das Technologieunternehmen EPAM Systems spürbar Schwäche, als der Markt Kapital aus Growth-Aktien umschichtete.

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES FUND* Forts.

Außerdem wurde das Unternehmen in Mitleidenschaft gezogen, weil seine Belegschaft den Entwicklungen in Russland und der Ukraine ausgesetzt war. Die Flucht in als „sichere Hafen“ angesehene Anlagewerte und der hohe Ölpreis hatten eine Underperformance von Info Edge India zur Folge. Auch die Positionen in Globant und Sea schädigten die Performance des Fonds. Der chinesische Batteriehersteller Wuxi Lead Intelligent Equipment schnitt schlechter ab, da die Anlegerbedenken über die Widerstandsfähigkeit der Aufträge in einer Rezession und die Herausforderungen rund um die Nachfrage nach Elektrofahrzeugen zunahmen.

Positiv war indes die gute Entwicklung der HDFC Bank in Indien, dies dank des starken Verbraucherkreditgeschäfts, das ein robustes Gewinnwachstum nach sich zog. Innerhalb des Finanzsektors leisteten die Beteiligungen an dem Versicherer AIA Group (China/Hongkong) positive Beiträge. Hier verbesserten sich die Aussichten für das Neugeschäft, während sich China allmählich von den strengen Pandemiebeschränkungen erholte.

Im Hinblick auf die Portfolioaktivität ergab sich aus der Kursschwäche eine Gelegenheit, um eine Position in der E-Commerce- und Gaming-Plattform Sea aus Indonesien zu eröffnen. Laut Meinung des Fondsmanagers ist das Unternehmen gut positioniert, um aus der großen, im E-Commerce der ASEAN-Region (Association of Southeast Asian Nations) gebotenen Chance Kapital zu schlagen. Ferner wurde eine Position in der Bank Mandiri eröffnet, nach Vermögensbasis eine der größten Banken Indonesiens, dessen makroökonomische Dynamik sich attraktiv ausnimmt. Nach Ansicht des Fondsmanagers weist Mandiri Wettbewerbsvorteile auf, dank derer die Bank überdurchschnittliche Renditen auf das investierte Kapital erzielen könnte. Ein weiterer Neuzugang war XP, eine technologiegestützte Anlageplattform und ein Anbieter von Finanzprodukten und -dienstleistungen in Brasilien, der sich durch niedrige Gebühren auszeichnet. Nach Ansicht des Fondsmanagers verfügt das Unternehmen über ein erhebliches Wachstumspotenzial, da der Markt für Vermögensverwaltungsprodukte in Brasilien in den letzten 14 Jahren kontinuierlich zweistellig gewachsen ist. Weitere Neuzugänge waren SK Hynix, Delta Electronics, ICICI Prudential Life Insurance, Netease und ICICI Bank.

Die Position in EPAM Systems wurde abgestoßen aufgrund der Risiken, die damit verbunden sind, dass sich die Mehrheit der Beschäftigten des Unternehmens in Russland, der Ukraine und Belarus befindet. Der Hersteller von kupferkaschierten Laminaten Elite Materials wurde ebenfalls verkauft. Der Fondsmanager geht hier nach einer Periode starker relativer Performance von einer Verschlechterung des Gewinnzyklus aus. Auch die Position in Alibaba wurde veräußert. Das Unternehmen ist zwar nach wie vor die führende E-Commerce-Plattform in China. Allerdings ist das Wachstum aufgrund des zunehmenden Wettbewerbs und der nachlassenden Verbrauchernachfrage ins Stocken geraten. Darüber hinaus trennte sich der Fonds von den Beständen in Bilibili, Titan, Jubilant Foodworks, Tencent Music Entertainment und Flat Glass.

Schwellenländeraktien scheinen derzeit mit ungewöhnlich hohem Abschlag auf Titel aus Industrieländern zu notieren. Die langfristigen Chancen in den Schwellenländern beruhen nach Ansicht des Fondsmanagers auf einem relativ hohen Einkommenswachstum, einer raschen Zunahme der Produktdurchdringung und Spielraum für eine Branchenkonsolidierung. Dies könnte eine einzigartige

Gelegenheit für Anlagen in Unternehmen darstellen, die stark den Einflüssen zuverlässiger langfristiger Wachstumstrends ausgesetzt sind.

Newton Investment Management Limited** Januar 2023

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Die Anteilsklasse JPY W des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -1,03 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit 1,26 % im Russell/Nomura Small Cap Index und -8,72 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global Equity Japan Small & Mid Cap, jeweils in japanischen Yen. Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück, konnte aber den Sektordurchschnitt übertreffen.

Die Sektorauswahl brachte den größten negativen Performancebeitrag.

Auf Branchenebene waren vor allem Dienstleistungen, Information und Kommunikation abträglich – Bereich, in denen der Fonds übergewichtet positioniert war. Auch der Verzicht auf Bankwerte war von Nachteil. Dagegen wirkten sich insbesondere das sonstige Finanzierungsgeschäft, Nichteisenmetalle, in denen der Fonds übergewichtet war, und Pharmazeutika, in denen der Fonds keine Positionen hielt, positiv auf die Wertentwicklung aus.

Auf Einzeltitelebene schlugen vor allem Atrac, ein IT-Dienstleister im Bereich Personalwesen, Japan Medical Dynamic Marketing, ein Anbieter medizinischer Geräte, und Anicom Holdings, ein Anbieter von Krankenversicherungen für Haustiere, negativ zu Buche. Zu den Titeln mit den stärksten Beiträgen zählten m-up holdings, ein Unternehmen, das Fanclub-Websites und ein elektronisches Ticketgeschäft betreibt, Premium Group, das Autokredite und Mikrokredite für Verbraucher anbietet, und Nippon Gas, ein Anbieter von Flüssiggas und Stadtgas.

Der Fonds nahm drei neue Positionen auf. Dazu zählten ADEKA, das eine breite Palette von Chemie- und Nahrungsmittelprodukten herstellt, Minkabu The Infonoid, ein führender japanischer Finanzinformationsdienst, sowie Nakanishi, ein Unternehmen, das sich auf zahnmedizinische, chirurgische und allgemeine Industrieprodukte fokussiert. Außerdem wurde der Verkauf von Arata, einem Großhändler für Kosmetik, Produkte des täglichen Bedarfs und Haushaltswaren, von Takeuchi MFG, einem der größten Baumaschinenhersteller, von Totetsu Kogyo, einem führenden Unternehmen für die Schieneninstandhaltung, sowie von Anritsu, einem führenden globalen Produzenten elektronischer Test- und Messprodukte, abgeschlossen. Darüber hinaus erhöhte der Fonds die Gewichtung von Aktien, die mittelfristig attraktiv bewertet waren. Finanziert wurden diese Zukäufe durch den Verkauf von Aktien, die sich bislang relativ gut behauptet haben.

Ende Dezember 2022 befanden sich 30 Aktien im Portfolio und es bestanden übergewichtete Positionen in Dienstleistungen, Information und Kommunikation sowie sonstigen Finanzunternehmen.

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND Forts.

Am stärksten übergewichtet waren Vector, das Verkaufsförderung betreibt und unter anderem Pressemitteilungen betreut, m-up holdings, Direct Marketing MiX, das über seine Outbound-Callcenter Marketingdienste bietet, TechMatrix, das sich auf Systemintegrations- und Lösungsdienstleistungen konzentriert und sich auf Cybersicherheit und Cloud-basierte Informationsdienste im Gesundheitswesen spezialisiert hat, sowie OPTORUN, das optische Werkzeuge zur Dünnschicht-Abscheidung herstellt.

Nach der angepassten Renditekurvensteuerung durch die Bank of Japan fielen die Anleihekurse, der Yen wurde stärker und Growth-Aktien gaben nach. Wenngleich der Fondsmanager davon überzeugt ist, dass die Änderung an der Geldpolitik nur begrenzte Auswirkungen auf die japanische Wirtschaft haben dürfte, könnte ein stärkerer Yen den Exportunternehmen schaden, die den Auswirkungen eines wirtschaftlichen Abschwungs in einem schwächeren Währungsumfeld bislang weniger stark ausgesetzt waren.

Russlands Invasion in der Ukraine verschlimmert die Inflation aufgrund von Angebotsengpässen, die sich bereits während der Covid-19-Pandemie abzeichneten. Die Kombination aus Krieg und geldpolitischer Straffung schafft zusätzliche Unsicherheit an den Finanzmärkten. Folglich nimmt die Risikobereitschaft der Anleger ab, weshalb die Kurse von Anlagewerten auf kürzere Sicht, zumindest bis die Situation in der Ukraine klarer wird, volatil bleiben könnten.

Strategisch wird der Fonds nach wie vor Aktien halten, deren Wachstumsaussichten attraktiv erscheinen. Sobald sich die wirtschaftlichen Bedingungen normalisiert haben, wird das längerfristige Thema, nämlich dass Japan nach vielen Jahren der deflationsbedingten Schrumpfung des nominalen BIP in eine expansive Phase eingetreten ist, wieder in den Fokus rücken.

BNY Mellon Asset Management Japan Limited** Januar 2023

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -14,58 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des S&P Eurozone Small & Mid Cap Average Index bei -15,85 %. Der Fonds generierte eine negative Rendite, übertraf jedoch seinen Referenzwert.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beschlossen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt glich, im Minus. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die in Anbetracht der seit Jahrzehnten nicht mehr so hohen Inflation und der geldpolitischen Straffung durch die Zentralbanken bereits ausgeprägten Bedenken der Anleger. In diesem Umfeld schnitt der Fonds besser ab als sein Referenzwert.

Die positive Aktienauswahl in Frankreich trug am meisten zur relativen Rendite bei, gefolgt von der günstigen Aktienauswahl in Deutschland. Umgekehrt belasteten die schwierige Aktienauswahl und Positionierung in Irland und den Niederlanden die relative Rendite. Auf Sektorebene erzielten Immobilien- und Nicht-Basiskonsumgüterwerte die höchsten relativen Renditen, während das Finanz- und das Gesundheitswesen die größten Verluste verzeichneten.

Eine vorteilhafte Aktienauswahl, insbesondere in Deutschland, war für die Outperformance im Immobiliensektor hauptverantwortlich. Die positive Titelauswahl und die Positionierung im zyklischen Konsumgüterbereich trugen ebenfalls zum relativen Ergebnis bei. Auch die Nullgewichtung des Fonds in finnischen Beständen und die effektive Titelauswahl in Deutschland waren den Sektorergebnissen zuträglich. Die Position des Fonds in Rheinmetall, einem deutschen Unternehmen der Luft-, Raumfahrt- und Verteidigungsindustrie, leistete einen positiven Performancebeitrag, da das Unternehmen dreistellige Renditen erzielte.

Im Finanzsektor beeinträchtigten eine schwache Titelauswahl und eine untergewichtete Positionierung die relative Performance am meisten. Die Nullgewichtung des Fonds in irischen und spanischen Titeln belastete die Ergebnisse des Sektors besonders deutlich. Eine schwierige Aktienauswahl und die Positionierung im Gesundheitswesen, darunter ein mangelndes Engagement in niederländischen Beständen und eine Position außerhalb des Referenzwerts in einem dänischen Unternehmen, schmälerten die relativen Renditen. Einen der größten Negativbeiträge leistete im Berichtszeitraum die Position des Fonds in der deutschen Immobilienverwaltungs- und Bauträgergesellschaft CORESTATE Capital Holding.

Der Fondsmanager stockte die Fondspositionen in Kommunikationsdienstleistungen und Industrierwerten auf und eröffnete Positionen in JCDecaux (Kommunikationsdienstleistungen) und Sacyr (Industrie). Das Engagement des Fonds in Finanz- und Versorgungswerten wurde verringert. So wurde ein Bestand in dem Finanzunternehmen Unipol Gruppo abgestoßen. Zugleich wurden einige andere Bestandspositionen in diesem und im Versorgungssektor gestutzt.

Die Aussichten für Aktien aus der Eurozone bleiben mit Blick auf 2023 positiv. Nach der starken Aufwertung des US-Dollar und der Schwäche des Euro scheint die Geldpolitik der Zentralbanken im Großen und Ganzen aufeinander abgestimmt zu sein, so dass der Fondsmanager eine ähnliche Währungsentwicklung in den nächsten zwölf Monaten für eher unwahrscheinlich hält.

Die Bewertungen in der Eurozone sind im Vergleich zu US-Aktien nach wie vor günstig. Da das globale Wachstum nachlässt, dürfte dies im nächsten Jahr eine noch größere Rolle spielen. Unterdessen erkennt der Fondsmanager weiterhin Chancen im Versorgungssektor. Ein besseres regulatorisches Umfeld, attraktive Bewertungen und defensive Geschäftsmodelle dürften für den Sektor 2023 Gutes verheißen. Globale Konsumgüterunternehmen haben für die nächsten sechs Monate viel Negatives eingepreist. Im Vergleich zu den USA hat ein großer Teil Europas im letzten Jahr im Konsumsektor bereits erhebliche Schwäche hinter sich gebracht. Der Fondsmanager ist daher der Meinung, dass sich die Vergleichsbasis im ersten Quartal 2023 verbessern wird.

In Anbetracht des schwächeren globalen Wachstumshintergrunds bis 2023 und der aktuellen Ausrichtung des Fonds im Hinblick auf Währungen, Bewertungen und Sektorgewichtungen bleibt der Fondsmanager gegenüber internationalen Aktien konstruktiv eingestellt.

Newton Investment Management North America LLC** Januar 2023

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Während des kurzen Zeitraums seit Auflegung des Fonds vom 23. September 2022 bis zum 31. Dezember 2022 erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds eine Rendite von 6,90 % nach Abzug von Gebühren, während die Rendite des MSCI Emerging Markets Index NR 6,13 % betrug. Der Teilfonds wies eine positive Rendite aus und übertraf seinen Referenzwert.

Die Aktienausswahl war schwach, vor allem in den Sektoren Industrie und Grundstoffe. Dagegen wirkte die Sektorallokation leicht positiv. Die Fondsposition in der AIA Group leistete den stärksten Beitrag. Die Aktie entwickelte sich überdurchschnittlich, weil Zuversicht herrschte, dass das Ende der Pandemiebeschränkungen in China das Wirtschaftswachstum ankurbeln würde. Die Beteiligung an dem brasilianischen Hersteller von Industrieelektronik WEG wirkte sich ebenfalls vorteilhaft aus, da das Unternehmen eine starke Nachfrage nach seiner Energieeffizienztechnologie verzeichnete. Der Chiphersteller ASML profitierte von seiner positiven Gewinndynamik und dem Vertrauen der Anleger in den langfristigen Wachstumsausblick. Auch das Unternehmen By-health, das Nahrungsergänzungsmittel herstellt und vertreibt, entwickelte sich gut.

Andererseits verlor der Lithiumbergbaukonzern Livent, weil die Anleger befürchteten, dass potenzielle Überkapazitäten und kurzfristiger Gegenwind bei den Absatzzahlen für Elektrofahrzeuge den Lithiummarkt belasten könnten. Bei den Basiskonsumgüterwerten belasteten die Beteiligungen an den indischen Konsumgüterunternehmen Hindustan Unilever, Marico und Godrej die Renditen. Hier waren die defensiven Merkmale, die ihnen über weite Strecken des Jahres zu einer Outperformance verholfen hatten, während des risikofreudigeren vierten Quartals nicht mehr gefragt. LONGi Green Energy Technology tendierte ebenfalls schwächer, dies aufgrund von Besorgnis über den sich verschärfenden Wettbewerb. Zudem war die Nullgewichtung des chinesischen Internetgiganten Tencent Holdings von Nachteil, da dieses Indexschwergewicht Kursgewinne verbuchte.

Schwellenländeraktien notieren derzeit mit einem offensichtlich ungewöhnlich hohen Abschlag im Vergleich zu Titeln aus Industrieländern. Die langfristigen Chancen in den Schwellenländern beruhen nach Ansicht des Fondsmanagers auf einem relativ hohen Einkommenswachstum, einer raschen Zunahme der Produktdurchdringung und Spielraum für eine Branchenkonsolidierung. Dies könnte als solches eine einzigartige Gelegenheit für Anlagen in Unternehmen darstellen, die stark den Einflüssen zuverlässiger langfristiger Wachstumstrends ausgesetzt sind.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD C (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 3,48 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit -18,51 % für den S&P 500 NR Index (jeweils in US-Dollar). Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Referenzwert.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beschlossen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt glich, im Minus. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die in Anbetracht der seit Jahrzehnten nicht mehr so hohen Inflation und der geldpolitischen Straffung durch die Zentralbanken bereits ausgeprägten Bedenken der Anleger. In diesem Umfeld schnitt der Fonds besser ab als sein Referenzwert.

Auf Sektorebene leisteten Energie und Informationstechnologie (IT) den stärksten Beitrag zur relativen Performance. Basiskonsumgütertitel waren der einzige Sektor, der die relativen Ergebnisse im Berichtszeitraum beeinträchtigte.

Eine Übergewichtung und effektive Titelauswahl im Energiesektor stützten im Berichtszeitraum die Performance, weil der Sektor zu Beginn des Jahres von den steigenden Ölpreisen profitierte. Zu den stärksten Beständen des Fonds gehörten zwei namhafte Unternehmen aus dem Subsektor Heizöl, Gas und Brennstoffe. Die Untergewichtung des IT-Sektors im Fonds war den relativen Renditen zuträglich, insbesondere die Nullgewichtung von Softwaretiteln. Eine untergewichtete Position in defensiven Basiskonsumgüterwerten schadete hingegen der relativen Wertentwicklung. Die Untergewichtung bei Getränken und Nahrungsmitteln sowie eine Nullgewichtung bei Haushaltsprodukten schlugen besonders negativ zu Buche.

Der Fonds blieb in Finanz-, Energie-, Versorger- und Gesundheitswerten übergewichtet und in IT-, Nicht-Basiskonsumgüter-, Kommunikationsdienstleistungs- und Basiskonsumgüterwerten untergewichtet. Der Fondsmanager erhöhte durch die Aufnahme von Caterpillar, FedEx und Raytheon Technologies das Fondsengagement in Industriegüterwerten. Die Fondsallokation in Immobilien wurde durch den Verkauf der Immobilienaktiengesellschaften Medical Properties Trust und Weyerhaeuser Company aufgelöst. Indem er Positionen in AES, Clearway Energy und Vistra Corp. aufgab, stützte der Fondsmanager die übergewichtete Position des Fonds in Versorgern. In absoluten Zahlen werden weiterhin Finanzwerte am stärksten gewichtet.

Der Fondsmanager ist der Meinung, dass Value-Unternehmen mit besseren relativen Ertragstrends gut positioniert sind, um den breiteren Markt 2023 zu übertreffen. Der Einschätzung des Fondsmanagers zufolge könnten Unternehmen mit soliden Bilanzen und Cashflows, die im Vergleich zu ihrer zukünftigen Cashflow-Generierungskraft zu attraktiven Preisen notieren, überzeugende Anlagegelegenheiten darstellen. Darüber hinaus gilt es laut Fondsmanager für den Zeitpunkt positioniert zu sein, an dem die Phase des gedämpften Wirtschaftswachstums nachlässt und zyklische Unternehmen von einem potenziellen Aufschwung am Markt profitieren können. Solche zyklischen Unternehmen sind im Value-Bereich gut vertreten und hatten in der Vergangenheit bei Marktaufschwüngen die Nase vorn.

Der Fondsmanager geht davon aus, dass einzelne Marktsegmente weiterhin damit beschäftigt sein werden, den durch die Pandemie ausgelösten Nachfrageschub zu bewältigen. Ferner rechnet sie mit einer starken Entwicklung von Anlagen in der „Old Economy“, die von verschiedenen Faktoren wie Onshoring, Automatisierung, elektrische Infrastruktur und Bemühungen zur Verringerung von Lieferengpässen profitieren. Dieses neue Marktregime sollte angesichts der Renditejagd der Anleger rentablen und soliden Geschäftsmodellen eher entgegenkommen.

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND Forts.

Der Einschätzung des Fondsmanagers zufolge wird das Marktumfeld 2023 der seit langem verfolgten Anlagephilosophie des Fonds mit Schwerpunkt auf groß kapitalisierten Value-Titeln und ertragsstarken Aktien aus den USA, die sich auf Chancen an der Schnittstelle von Bewertung, Fundamentaldaten und Geschäftsdynamik konzentrieren, zuträglich sein.

Wie immer wird sich der Fondsmanager darauf konzentrieren, kurzfristige volatile Episoden zu nutzen, um im Vergleich attraktive Gelegenheiten zu identifizieren. Der Fonds ist gegenüber zyklischen Markt Bereichen unvermindert konstruktiv eingestellt: Diese bieten in unsicheren Zeiten positive relative Bewertungen und robuste Unternehmensbilanzen. Der Fondsmanager geht bei seiner Suche nach Gelegenheiten mit stabilen Cashflows zu attraktiven Bewertungen und Treibern für eine Verbesserung des Geschäfts selektiv vor.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2023**

SPEZIALAKTIEN

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum nach Abzug von Gebühren in US-Dollar eine Rendite von -46,68 %. Sein Referenzwert, der MSCI AC World NR USD, verzeichnete -18,36 %.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beendeten unterdessen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt glich, im Minus. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die Bedenken der Anleger über Inflationsraten, die sich auf seit Jahrzehnten nicht mehr verzeichneten Hochs befanden, und über steigende Zinssätze. In diesem Umfeld hielt der Fonds nicht mit seinem Referenzwert Schritt.

Am schädlichsten für die Performance war die schwierige Aktienauswahl unter Banken. Besonders negativ wirkte sich die nicht im Referenzwert vertretene Position in Silvergate Capital aus. Die übergewichtete Positionierung und ungünstige Titelauswahl in den Bereichen Kapitalmärkte und IT-Dienstleistungen belasteten die Ergebnisse ebenfalls.

Renditesteigernd wirkte im Berichtszeitraum indes die effektive Titelauswahl bei Halbleitern und Halbleiterausstattung, insbesondere die Position in Enphase Energy. Zudem wurden die Verluste durch die vorteilhafte Aktienauswahl im Automobilsektor und das mangelnde Engagement in Technologie-Hardware (Speicherprodukte und Peripheriegeräte) gemindert.

Der Fondsmanager erhöhte das Engagement des Fonds in den Subsektoren Textilien, Bekleidung und Luxusgüter, indem eine bestehende Position aufgestockt und die Gewichtung in Versicherungsgesellschaften durch Neueröffnung einer Position in Zurich Insurance erhöht wurde. Das Engagement im Bankensektor wurde durch den Verkauf von Metropolitan Bank, der bereits erwähnten Silvergate Capital und der SVB Financial verringert. Verschiedene Positionen in der Softwarebranche, darunter MicroStrategy, Unity Software und Hut 8 Mining, fielen aus dem Portfolio heraus. Im Vergleich zum Referenzwert war der Fonds an den Kapitalmärkten am stärksten übergewichtet und in Technologie-Hardware mit Speicherprodukten und Peripheriegeräte am stärksten untergewichtet.

Eine der attraktivsten Eigenschaften der Blockchain ist, dass es sich um ein flexibles Konstrukt handelt, das auf eine Vielzahl von Anwendungen in verschiedenen Endmärkten zugeschnitten werden kann. Es gibt ganz unterschiedliche Blockchain-Lösungen, öffentliche oder private, mit oder ohne Erlaubnis, und die Governance kann zentral oder dezentral erfolgen. Eine ordnungsgemäße Konstruktion ist unerlässlich, um die Anreize von Netzteilnehmern abzustimmen, Risiken zu verringern und die betriebliche Effizienz zu verbessern. Diese Überlegungen unterstreichen den Bedarf an Drittanbietern oder sogenannten Enablern, die Beratungs- oder Umsetzungsdienste für robuste Blockchain-Lösungen sowohl auf Ebene von einzelnen Unternehmen als auch von Branchenkonsortien bieten.

Um diesem Thema Rechnung zu tragen, erhöhte der Fonds im Laufe des Jahres 2022 seine Beteiligung an Blockchain-Anbietern. Der Fonds hat mehrere Unternehmen im Portfolio, die differenzierte Blockchain-Produkte, -Dienstleistungen und -Lösungen für Firmenkunden und Finanzinstitute bieten.

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND Forts.

Die jüngsten Verwerfungen auf den Kryptowährungsmärkten unterstreichen den Bedarf an solider Beratung und technischem Know-how innerhalb dieser Ökosysteme. Sowohl regulierte als auch nicht regulierte Plattformen für digitale Vermögenswerte hatten mit operativen, Compliance- und Governance-Problemen zu kämpfen. Laut Einschätzung des Fondsmanagers hätten diese mit einer durchdachten Implementierung angemessener Organisationsstrukturen verringert werden können. Der Fondsmanager kann weiterhin mit der Einführung verbundene Reibungsverluste erkennen, sieht diese aber als Gelegenheit für die im Fonds enthaltenen Enabler der Blockchain-Technologie.

Newton Investment Management North America LLC Januar 2023

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -22,43 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -18,51 % für den S&P 500 NR Index, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die Finanzmärkte wurden durch den unerwarteten Einmarsch Russlands in der Ukraine und die Folgen der Lieferkettenprobleme im Zuge der Pandemie sowie durch die Abschwächung des globalen Wachstums, die steigende Inflation und die restriktive Geldpolitik vieler Zentralbanken belastet. Insgesamt führte der Inflationsschock nach der Pandemie zu einer Abkehr vom jahrzehntelangen Muster niedriger Zinssätze und expansiver Geldpolitik. Die Fondsallokationen in riskanteren Anlagewerten brachten den Fonds in Rückstand.

Die Aktienallokation des Fonds lag zu Beginn des Jahres bei etwa 115 %. Die Risikoprämie von Aktien gegenüber Anleihen (erwartete Rendite von Aktien gegenüber Anleihen) nahm sich – unterstützt durch ein starkes prognostiziertes Wirtschaftswachstum und ein erwartetes Gewinnwachstum der Unternehmen im S&P 500 Index – zunächst attraktiv aus. Wenngleich die steigende Inflation und die anhaltenden Lieferkettenengpässe eine Gefahr darstellten, war das Risiko einer Rezession noch relativ gering. Allerdings stieg die Inflation sprunghaft an, das weltweite Wachstum verlangsamte sich, und die Zentralbanken drehten in dem Bestreben, die Preisstabilität wiederherzustellen, zusehends an der Zinsschraube, um ihre Geldpolitik zu straffen. Im Mai senkte der Fonds seine Zielaktienquote von 110 % auf 100 %. Dies lag daran, dass die Volatilität der Anlageklassen zugenommen hatte und die Korrelation zwischen Aktien und Anleihen nahe null lag.

Von Mitte Mai bis Anfang September behielt der Fonds diese Zielgewichtung von 100 % in Aktien bei, was kaum Auswirkungen auf die Wertentwicklung hatte. Obschon das makroökonomische Umfeld weiterhin unsicher war, erholten sich die Aktienmärkte von Mitte Juni bis Mitte September. Angesichts der makroökonomischen Top-down-Prognosen des Fondsmanagers, die auf eine länger anhaltende Inflation und eine Verlangsamung des Wirtschafts- und Gewinnwachstums hinausliefen, nahm der Fonds eine neutrale Aktienposition ein. Darüber hinaus hat der starke Anstieg der langfristigen Anleiherenditen die relative Attraktivität von Aktien verringert. Mitte September ging der Fonds zu einer Zielquote für Aktien von 90 % über, woran sich bis zum Jahresende nichts mehr änderte. Die vom Fondsmanager geschätzte Aktienrisikoprämie war nun deutlich niedriger, was in erster Linie auf die gesunkenen Gewinnprognosen für die kommenden zwölf Monate zurückzuführen war.

Dies führte zu niedrigeren erwarteten Aktienrenditen.

Zu Beginn des Jahres wies der Fonds eine Zielgewichtung von 10 % für Anleihen (umgesetzt mit 5 %) und eine Zielgewichtung von 0 % für Barmittel auf. Er investiert in langfristige US-Staatsanleihen, die sich früher als sehr wirksame Absicherung gegen Aktienmarktkorrekturen erwiesen haben. In Sachen Positionierung behielt der Fonds bis Anfang September eine Zielgewichtung von 10 % in Anleihen bei. Danach senkte der Fondsmanager die Zielwerte auf 90 % für Aktien und 0 % für Anleihen. Für Barmittel betrug das Ziel nun 10 %. Während der ersten acht Monate des Jahres brachte die durchschnittliche Anleiheallokation von 6 % eine vorsichtigeren Haltung zum Ausdruck, erwies sich jedoch für die Überrenditen als negativ, da die Verzinsung 30-jähriger US-Staatsanleihen stieg. Mitte September war die Schätzung für langfristige Barmittel stärker gestiegen als die Renditen langfristiger US-Staatsanleihen. Folglich verlagerte sich die Strategie auf ein Ziel von 0 % für Anleihen und ein Ziel von 10 % für Barmittel.

Ende 2022 war der Fonds in Aktien untergewichtet positioniert, wies keinerlei Engagement in Anleihen auf und strebte eine positive Allokation in Barmitteln von 10 % an. Die aktuelle Prognose des Fondsmanagers zu den Aktienrisikoprämien entspricht dem langfristigen Durchschnitt. Allerdings geht der Fondsmanager für die nächsten zwölf Monate von einem neutralen Gewinnwachstum für die Unternehmen im S&P 500 Index aus. Die Wahrscheinlichkeit eines Gewinnrückgangs schätzt er nun als erhöht ein. Der Fonds hält keine Anleihen, denn die Prognose des Fondsmanagers für langfristige US-Anleihen ist nach wie vor unattraktiv. Angesichts des hohen Niveaus der kurzfristigen Zinssätze sind Barmittel eine attraktivere Alternative zu langlaufenden Anleihen.

Newton Investment Management North America LLC Januar 2023

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND

Die Anteilsklasse W (Acc) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -20,99 % nach Abzug von Gebühren, während sein Referenzwert, der MSCI AC World NR Index, -18,36 % verbuchte (jeweils in US-Dollar). Der Fonds lieferte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Für den Future Earth Fund war das Jahr 2022 ein Übergangsjahr, in dem die Portfoliomanager ausgewechselt wurden und ein verbesserter Anlageprozess zur Verwaltung des Fonds implementiert wurde. Diese Änderungen hatten zur Folge dass sich der Fonds von einem Mandat mit leichter thematischer Ausrichtung in einen nach Artikel 9 eingestuften Fonds mit ökologischen Merkmalen wandelte. Dementsprechend war der Portfolioumschlag im Jahr 2022 höher als üblich. Allerdings stimmte die Tatsache zuversichtlich, dass sich die Performance ab März mit Umsetzung der Änderungen verbesserte.

Beeinträchtigt wurde die Fondsrendite durch die Aktienausswahl. Genuit hatte mit einer Verschlechterung des makroökonomischen Hintergrunds und des Handelsumfelds zu kämpfen. Infineon Technologies schwächelte wegen Bedenken über die Herausforderungen in der Halbleiterindustrie. Nidec wurde unterdessen wegen der schwierigen Rahmenbedingungen für die Gewinne des Unternehmens unter Druck gesetzt. Smurfit Kappa zeigte

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND Forts.

als unmittelbare Folge der Russland-Ukraine-Krise Schwäche, dies aufgrund von Bedenken über die Nachfrage in Europa, sowie der Möglichkeit, dass explodierende Rohstoffpreise Abwärtsdruck auf die Margen ausüben würden.

Positiv war indes die Performance von Hubbell, dem Spitzenreiter im Fonds. Die Aktie ist eindeutig Nutznießer der Investitionsausgaben im US-Versorgungssektor und sie profitiert vom Rückenwind der Elektrifizierung. Deere & Co schnitt gut ab. Hier stimmte offenbar der günstige Nachfrageausblick die Anleger zuversichtlich. Die Ergebnisse wurden zudem durch höhere Produktionsraten und eine Verringerung der Lagerbestände in teilfertigen Maschinen vorangetrieben. NextEra Energy, Entwickler erneuerbarer Energien von Weltrang und solider Betreiber von regulierten Anlagen in Florida, machte ebenfalls eine gute Figur. Die defensiven Attribute des Unternehmens fanden angesichts des ungewissen Konjunkturausblicks Anklang. Gleichzeitig bot die neuerliche Konzentration auf die Energiewende und die Energiesicherheit Unterstützung.

Im Hinblick auf die Portfolioveränderungen investierte der Fondsmanager Anfang des Jahres in Voltronic Power Technology. Das Unternehmen dürfte vom beschleunigten Endmarktwachstum infolge der ausgeprägten Elektrifizierungstrends profitieren. Der Fondsmanager eröffnete eine Position in SolarEdge Technologies. Er erachtet das Unternehmen als einen der weltweit führenden Hersteller von Solarwechselrichtern und -optimierern für private und gewerbliche Anwendungen. Das Wachstum profitiert von strengeren Umweltvorschriften, allmählich rückläufigen Ausrüstungskosten und einer robusten Wettbewerbsposition. Darüber hinaus wurde eine Position in Darling Ingredients eingegangen. Als weltweit führendes Unternehmen im Bereich der Kreislaufwirtschaft von Abfällen nimmt das Unternehmen eine wichtige Position in der Agrar- und Nahrungsmittelindustrie ein. Das Unternehmen sammelt tierische Nebenprodukte und recycelte Öle (z. B. Speiseöl, tierische Fette) und verwendet sie zur Herstellung einer breiten Palette von Produkten, unter anderem Biokraftstoff. Ebenfalls in das Portfolio aufgenommen wurde Ingersoll Rand, ein führender Anbieter von Kompressionstechnologie. Der Einschätzung des Fondsmanagers zufolge ist das Unternehmen gut positioniert, um von den Trends bezogen auf Energieeffizienz zu profitieren. Seine Produkte führen zu deutlich niedrigeren Emissionen in Produktionsanlagen und einer geringeren Energieintensität seiner Kunden. Ebenfalls erworben wurden LONGi Green Energy Technology, Sungrow Power Supply, RWE, Aker Carbon Capture, Epiroc und Contemporary Amperex Technology.

Positionen in Vestas, Texas Instruments, Eversource Energy, Ebara, Microsoft, Unilever, Johnson Matthey, Kubota und Weyerhaeuser wurden hingegen im Berichtsjahr veräußert.

Nach Einschätzung des Fondsmanagers ist es unwahrscheinlich, dass 2023 die gleichen Zinserhöhungen wie 2022 anstehen. Daher dürfte der Entwicklung der Unternehmensgewinne eine größere Bedeutung zukommen. Der Fonds bleibt auf die Identifizierung von Anlagen ausgerichtet, die von globalen Initiativen im Kampf gegen den Klimawandel sowie zur Entlastung der Natur profitieren und einen Beitrag dazu leisten.

Newton Investment Management Limited
Januar 2023

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND**

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -13,52 % nach Abzug von Gebühren, während der MSCI AC World NR -18,36 % verbuchte (jeweils in US-Dollar). Der Fonds lieferte eine negative Rendite, entwickelte sich aber besser als der Referenzwert.

Ausschlaggebend für die Outperformance des Fonds war die Sektorallokation, insbesondere die starke Übergewichtung von Basiskonsumgütern. Allerdings war die Aktienausswahl für die Renditen von Nachteil. Die schwächste Aktienposition im Fonds war Trimble. Die Aktie verlor an Wert, nachdem die Prognosen für das Gesamtjahr aufgrund von Gegenwind durch Wechselkurseffekte und Lieferkettenproblemen sowie einer gewissen Abschwächung der Nachfrage in bestimmten Endmärkten gesenkt wurden. Die Aktien des Tiergenetik-Unternehmens Genus verloren an Wert, da der Ausblick für seine Schweinesparte auf kürzere Sicht von Preisschwäche getrübt wurde. Ecolab, ein Anbieter von Wasser-, Hygiene- und Energietechnik und -dienstleistungen, dessen Quartalsergebnis unter Covid-19 und lieferkettenbedingten Problemen gelitten hatte, gab nach, weil er aufgrund steigender Kosten und Lieferengpässen unter Druck stand.

Ein positiver Faktor war dagegen die gute Wertentwicklung von Deere & Co. Das Unternehmen wies robuste Quartalsergebnisse aus. Zu verdanken waren diese einer starken Nachfrage, höheren Produktionsraten und niedrigeren Lagerbeständen. Angesichts des erheblichen Einflusses, den ein Aufwärtstrend auf dem Kalimarkt auf die Aktien von Nutrien ausübt, legte der Titel nach dem russischen Einmarsch in der Ukraine kräftig zu. Auch die Gewinndaten von Corteva stimmten zuversichtlich. AGCO war den Renditen ebenso zuträglich. Hier unterstützten starke Erntepreise die höheren Investitionsausgaben für landwirtschaftliche Maschinen.

Zu den Veränderungen, die der Fondsmanager am Portfolio vornahm, zählte der Kauf von Sysco, dem größten Akteur in einem relativ fragmentierten US-amerikanischen Lebensmittelvertriebssektor. Ungeachtet der Beeinträchtigung durch Covid-19-Lockdowns und den vorübergehenden Kostendruck könnte das Unternehmen laut Einschätzung des Fondsmanagers gestärkt aus der Pandemie hervorgehen. Ein weiterer Neuzugang war Grocery Outlet. Hier bestand die Absicht des Fondsmanagers darin, das Engagement im Discount-Einzelhandel zu erhöhen, nachdem die Verbrauchereinkommen infolge der höheren Inflation unter Druck geraten waren. Darüber hinaus wurde eine Position in Darling Ingredients eingegangen. Als weltweit führendes Unternehmen im Bereich der Kreislaufwirtschaft von Abfällen nimmt das Unternehmen eine wichtige Position in der Agrar- und Nahrungsmittelindustrie ein. Das Unternehmen sammelt tierische Nebenprodukte und recycelte Öle (z. B. Speiseöl, tierische Fette) und verwendet diese zur Herstellung einer breiten Palette von Produkten, unter anderem Biokraftstoff. Ebenfalls zugekauft wurden Zebra Technologies, Twist Bioscience und Archer Daniels Midland.

Der Nutzfahrzeughersteller Iveco wurde verkauft, da schwächere Nachfragetrends langfristig die Argumente für eine Anlage entkräfteten. Delivery Hero wurde veräußert, denn der Fondsmanager bewertete das langfristige Geschäftsmodell und die Rentabilität des Unternehmens zunehmend als problematisch. Andere Verkäufe betrafen Tyson Foods, Ingredient, Givaudan und Beyond Meat.

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND Forts.

Nach Einschätzung des Fondsmanagers ist es unwahrscheinlich, dass die Zinsen 2023 weiter so stark erhöht werden wie 2022. Daher dürfte der Entwicklung der Unternehmensgewinne eine größere Bedeutung zukommen.

Der Schwerpunkt des Fonds liegt nach wie vor darauf, dass die Menschheit forschen, investieren und erfinderisch sein muss, um neue, bessere Wege zu finden, eine wachsende Bevölkerung zu ernähren. Das gilt umso mehr, da die Sorgen um die weltweite Nahrungsmittelversorgung durch den Krieg in der Ukraine und klimabedingte Schocks noch verschärft wurden.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND

Die Anteilsklasse W (Acc) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -10,61 % nach Abzug von Gebühren, während sein Referenzwert, der MSCI AC World NR Index, -18,36 % verbuchte (jeweils in US-Dollar). Der Fonds verbuchte eine negative Rendite, übertraf jedoch seinen Referenzwert.

Die Sektorallokation, insbesondere die Übergewichtung im Gesundheitswesen, war hauptverantwortlich für die Rendite des Fonds, wohingegen die Aktienauswahl negativ zu Buche schlug. Generell distanzierten sich die Anleger im Berichtsjahr von Aktien wachstumsstarker Unternehmen. Die schwächste Aktienposition im Fonds war Edwards Lifesciences. Das Unternehmen verzeichnete eine Reihe enttäuschender Quartalsergebnisse, die vor allem durch den Personalmangel in den Krankenhäusern bedingt waren. Teladoc Health gab nach, da die korrigierten Vorgaben für 2022 die Erwartungen verfehlten, was auf Probleme in den Sparten Direct-to-Consumer-Verhaltensmedizin und Chronic Care zurückzuführen war. Abbott Laboratories entwickelte sich aufgrund von Bedenken über die Rentabilität im Zuge der Covid-19-Pandemie unterdurchschnittlich. Home Depot wurde von der Besorgnis über steigende Zinssätze und deren Auswirkungen auf die Verbraucher sowie dem gedämpften Ausblick für das kommende Jahr beeinträchtigt.

Dagegen tendierte die Eli-Lilly-Aktie bemerkenswert stark. Das Potenzial des Medikaments Tirzepatid zur Behandlung von Patienten mit Typ-2-Diabetes stimmte die Anleger weiterhin zuversichtlich. Die Aktien von Novo Nordisk zogen ebenfalls an, nachdem das Unternehmen das erhebliche Wachstumspotenzial hervorgehoben hatte, das es in Bereichen wie Diabetes und Adipositas wahrnimmt. Die UnitedHealth Group legte auf die Bekanntgabe von Plänen zur Übernahme des Pflegedienstes LHC Group hin zu, wodurch sie ihre Kapazitäten in der häuslichen Pflege ausbauen würde. AstraZeneca präsentierte sich stark, da die Gewinne des Unternehmens die Erwartungen in den Schatten stellten. Ferner lieferte eine wichtige Studie über sein Brustkrebsmedikament Enhertu positive Daten.

In Sachen Portfolioaktivität wurde das globale Pharmaunternehmen Eli Lilly zugekauft, das auf die Entwicklung von Arzneimitteln gegen Stoffwechsel-, Krebs-, Immun- und andere Erkrankungen fokussiert ist. Der Wachstumsausblick für das Unternehmen wirkt angesichts der erheblichen Chancen, die seine Pipeline bietet, durchaus vielversprechend. Der Fondsmanager fügte Edwards Lifesciences hinzu, einen Hersteller von Herzklappensystemen und Reparaturprodukten. Das qualitativ hochwertige und innovative Unternehmen ist Vorreiter für weniger invasive, aber wachstumsstarke Lösungen.

Illumina, ein führender Anbieter von Sequenzierungs- und Array-basierten Lösungen für Gen- und Genomanalysen, wurde ebenfalls in das Portfolio aufgenommen. Der langfristige Trend hin zum Einsatz von Gensequenzierungswerkzeugen ist der Hauptgrund für den Fondsbestand in dieser Aktie. Ebenfalls investiert wurde in Alnylam Pharmaceuticals, ein Biopharma-Unternehmen, das sich auf die Entwicklung von RNA-Interferenz-Medikamenten konzentriert, Boston Scientific, ein Entwickler, Hersteller und Vermarkter medizinischer Geräte, und Regeneron Pharmaceuticals, ein integriertes Biotechnologieunternehmen, das Medikamente für schwere Erkrankungen erforscht, erfindet, entwickelt, herstellt und vermarktet.

Zu den maßgeblichen Verkäufen im Berichtsjahr gehörten Novartis, GSK, Teladoc Health, Straumann, Fresenius Medical Care, Sugi Holdings, Lonza Group, Thermo Fisher Scientific und Ping An Insurance.

Da sich die höheren Zinssätze zusehends auf die Wachstums- und Inflationsaussichten auswirken, könnte sich der Fokus der Anleger von den Zinssätzen auf den Gewinnzyklus verlagern. Unternehmen mit robusten Gewinnprofilen dürften in einem schwächeren Konjunkturmilieu am besten abschneiden. Der primäre Fokus des Fondsmanagers liegt unvermindert auf Unternehmen, die erstklassige und innovative Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, mit denen die Bedürfnisse und der Geschmack einer alternden Weltbevölkerung bedient werden können.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -7,56 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -0,99 % für den S&P Global Infrastructure NR Index, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte nach Abzug von Gebühren eine negative Rendite und schnitt schlechter ab als sein Referenzwert.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beschlossen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt gleich, im Minus. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die in Anbetracht der seit Jahrzehnten nicht mehr so hohen Inflation und der geldpolitischen Straffung durch die Zentralbanken bereits ausgeprägten Bedenken der Anleger. In diesem Umfeld hielt der Fonds nicht mit seinem Referenzwert Schritt.

Auf Sektorebene belasteten Versorger und Immobilien die relative Wertentwicklung am stärksten. Während des Berichtszeitraums gab es auf Sektorbasis keine positiven Beiträge zur relativen Performance.

Der Versorgungssektor schmälerte die Rendite am meisten, dies wegen der schwierigen Titelauswahl und einer übergewichteten Positionierung. Das indexunabhängige Engagement im Immobiliensektor minderte die Wertentwicklung ebenfalls. Die Positionen des Fonds in Exelon und Enel, beide aus dem Bereich der Stromversorger, gehörten zu den größten Verlustbringern auf Einzeltitelebene. Medical Properties Trust, ein Immobilienfonds (REIT), belastete die Performance im Berichtszeitraum ebenfalls.

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND Forts.

In absoluten Zahlen trugen vor allem Antero Midstream und ONEOK aus dem Subsektor Heizöl, Gas und Brennstoffe sowie Drax Group aus dem Bereich unabhängige und erneuerbare Stromerzeuger dazu bei, die Verluste zu begrenzen.

Der Fonds blieb in Immobilien, Kommunikationsdienste und Versorgern über- und in Industrie untergewichtet. Gegen Jahresende wurde eine Position in dem US-amerikanischen Energieversorger Dominion Energy eröffnet. Eine aufsichtsbehördliche Überprüfung hatte den Aktienkurs auf Talfahrt geschickt, was der Fondsmanager nutzte, um in den Titel einzusteigen. Der Fondsmanager reduzierte die Übergewichtung des Fonds in Versorgern, indem er die Bestände in Exelon, Naturgy Energy und Public Service Enterprise Group auflöste. Sie verringerte die Untergewichtung von Industrietiteln im Fonds durch Eröffnung einer Position in VINCI. Zudem stockte sie verschiedene weitere Bestände auf.

Aus der Sicht des Fondsmanagers bleibt der Ausblick für globale Infrastrukturwerte positiv: Seiner Meinung nach hat die Inflation die Ertragsmodelle dieser Unternehmen nicht beeinträchtigt. Angesichts der Tatsache, wie die höheren Kreditkosten auf die regulierten Unternehmen durchschlagen, ist der Fondsmanager unvermindert der Meinung, dass dieser Sektor einzigartig ist, da er dazu fähig ist, derartigen Kostendruck automatisch durchzureichen. Die Energiewende steht nach wie vor im Fokus und bietet dem Fondsmanager zufolge die größte Chance zur Wertschöpfung in diesem Bereich in Europa. Nach einem weiteren Quartal mit Gewinnveröffentlichungen dürften sich diese Mechanismen zur Weitergabe der Inflation auch weiterhin bei den Gewinnen bemerkbar machen.

Newton Investment Management North America LLC** Januar 2023

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums verzeichnete die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds eine Rendite von -35,14 % nach Abzug von Gebühren, gegenüber -18,77 % im MSCI AC World Mid Cap TR Index, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beschlossen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt glich, im Minus. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die in Anbetracht der seit Jahrzehnten nicht mehr so hohen Inflation und der geldpolitischen Straffung durch die Zentralbanken bereits ausgeprägten Bedenken der Anleger. In diesem Umfeld hielt der Fonds nicht mit seinem Referenzwert Schritt.

Eine deutliche Übergewichtung und eine ungünstige Titelauswahl bei Halbleitern und Halbleiterausstattung schmälerten die Performance am meisten. Die Positionierung und Titelauswahl im Automobilsektor belasteten die Renditen ebenfalls. Dies war insbesondere auf indexunabhängige Positionen in mehreren Titeln zurückzuführen, die im Berichtszeitraum hinterherhinkten. Auf Einzeltitelebene war MP Materials der größte Verlierer. Der Aktienkurs des im Bereich Seltene Erden tätigen Unternehmens entwickelte sich unterdurchschnittlich, weil die Preise für Seltene Erden im Laufe des Jahres aufgrund globaler Rezessionsangst schwächer tendierten. Im Bereich Halbleiter und Halbleiterausstattung belastete Semtech die Ergebnisse ebenfalls, weil sich die Fundamentaldaten in der Halbleiterindustrie abschwächten.

Eine günstige Aktienausswahl im Bereich Chemie trug dazu bei, die Verluste zu begrenzen. Bedingt war dies vor allem durch die Beteiligung des Fonds an einem globalen Lithiumlieferanten. Auch das Nicht-Engagement in den Segmenten Life-Science-Tools und -Dienstleistungen leistete einen positiven Beitrag. Auf Einzeltitelebene war Hubbell, ein führender Anbieter von elektrischer Ausrüstung und Versorgungsinfrastruktur, der Spitzenreiter. Der Fondsmanager glaubt, dass das Unternehmen weiterhin vom langfristigen Rückenwind der Elektrifizierung und Netzinvestitionen zur Anbindung erneuerbarer Energien sowie zur Verbesserung der Resilienz profitieren dürfte. Visteon, ein globaler Zulieferer im Bereich Autoelektronik, zähle ebenfalls zu den Spitzenreitern. Nach Ansicht des Fondsmanagers ist Visteon ein Pure-Play-Zulieferer von Cockpit-Elektronik mit sowohl zyklischem als auch langfristigem Wachstumspotenzial.

Unterdessen erhöhte der Fondsmanager den Fondsbestand in elektronischen Ausrüstungsinstrumenten und Komponenten mittels einer neuen Position in Trimble. Das Engagement des Fonds im Maschinenbau wurde durch neue Positionen in Epiroc, Fanuc und Knorr-Bremse aufgestockt. Der Fondsmanager verringerte das Engagement des Fonds in den Bereichen Halbleiter und Halbleiterausstattung sowie interaktive Medien und Dienstleistungen, indem er bestehende Positionen abbaute.

Die insbesondere bei Halbleitern vorliegenden Lieferkettenprobleme gehen kontinuierlich zurück und beeinträchtigen die Automobilproduktion mittlerweile nicht mehr so stark. Der Fondsmanager ist überzeugt, dass sich die positiven Trends des Jahres 2022, die sich aus dem langfristigen Wachstum innerhalb des Themas ergeben, bis 2023 fortsetzen werden. Dies trifft vor allem auf den Bereich der Elektrofahrzeuge und aufgrund des wachsenden Anteils an fortschrittlichen Fahrerassistenzsystemen (ADAS) zu.

Unterdessen nehmen sich die mittel- bis langfristigen Wachstumsaussichten im Bereich der Mobilität für die Fondsbeteiligungen im Automobilsektor laut Fondsmanager sehr attraktiv aus. Ihrer Ansicht nach zählen ADAS/Autonomes Fahren, Konnektivität und Elektrifizierung nach wie vor zu den Bereichen, die für ein überdurchschnittliches Wachstum positioniert sind. ADAS-Inhalte und -Funktionen pro Fahrzeug nehmen in den wichtigsten Märkten unvermindert zu. Der zugrunde liegende Wandel hin zur Elektrifizierung von Fahrzeugen, der in China und Europa nach wie vor eine wichtige Rolle spielt, nimmt aufgrund von Vorschriften und Verbraucherinteresse ebenfalls weiter an Fahrt auf. Auch andere Märkte wie die USA dürften 2023 eine positive Dynamik aufweisen. Der Fondsmanager geht davon aus, dass der US Inflation Reduction Act das Wachstum im Bereich Elektrofahrzeuge in den USA ankurbeln wird.

Newton Investment Management North America LLC** Januar 2023

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -27,38 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu lag die Rendite des MSCI All-Country World NR Index bei -18,36 %. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Angesichts immer schwieriger Bedingungen für die Kapitalmärkte beendeten unterdessen die Aktienmärkte ein Jahr, das einer Achterbahnfahrt glich, im Minus.

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND Forts.

Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine verstärkte die Bedenken der Anleger über Inflationsraten auf seit Jahrzehnten nicht mehr verzeichneten Hochs und steigende Zinssätze.

Gemäß der themenbezogenen Smart-Cures-Perspektive ist das Portfolio zu 60 % in klinischen Vorreitern und 40 % in unterstützenden Akteuren engagiert.

Die Position des Fonds in Intellia Therapeutics, einem Pionier im Bereich In-vivo-Gene Editing, beeinträchtigte die Ergebnisse. Die präsentierten Daten des Unternehmens waren während des gesamten Jahres 2022 solide. Allerdings geriet die Aktie aufgrund härter umkämpfter Märkte unter Druck. Der Fondsmanager bleibt hingegen von der Technologie und ihren längerfristigen kommerziellen Aussichten überzeugt. Eine Position in Kymera Therapeutics belastete ebenfalls, was teilweise auf die ungünstige Entwicklung von Biotechnologiewerten mit geringer Marktkapitalisierung zurückzuführen war. Für das Unternehmen war ein unvorhergesehener potenzieller Sicherheitshinweis in einem Pipeline-Programm für atopische Dermatitis eine Herausforderung. Weitere klinische Studien ergaben jedoch, dass das Signal mit verschiedenen Dosierungsansätzen in den Griff zu bekommen war. Der Partner des Unternehmens beschloss daraufhin, das Programm in die Phase II zu überführen. Der Fondsmanager bleibt gegenüber der Proteinabbau-Plattform von Kymera und ihren vielfältigen Einsatzmöglichkeiten bei vielen genetischen Krankheiten positiv eingestellt.

Eine Position im Biopharmaunternehmen Eli Lilly half, die Verluste zu mildern. Das Unternehmen profitierte von der häufigeren Verordnung seines neu eingeführten Diabetesmedikaments Mounjaro sowie von seiner unmissverständlichen Verlautbarung, für dasselbe Medikament bis Mitte 2023 die Zulassung für die Indikation Adipositas zu beantragen. BioMarin Pharmaceuticals leistete ebenfalls einen Positivbeitrag. Das Unternehmen hat erhebliche Fortschritte bei seiner Gentherapie zur Behandlung von Hämophilie A erzielt, die eine langfristige funktionelle Heilung im Vergleich zu einer chronischen Therapie in Aussicht stellt. Das Unternehmen hat die Zulassung in der EU erhalten. Mit der Zulassung in den USA wird bis Mitte des Jahres 2023 gerechnet. Der Fondsmanager ist der Ansicht, dass diese neue Therapie zusammen mit einem soliden Kernportfolio und einer Pipeline anderer gentechnisch hergestellter Arzneimittel dazu beitragen könnte, den fundamentalen Geschäftsausblick für das Unternehmen zu transformieren.

2022 war ein Jahr mit soliden Fortschritten innerhalb des Sektors. Nach Ansicht des Fondsmanagers stehen wir an der Schwelle zu mehreren Neuzulassungen für gentechnisch hergestellte Arzneimittel gegen Hämophilie A, Duchenne-Muskeldystrophie und die Sichelzellenanämie. Im letzten Jahr konnten Erfolge bei der Nutzung der mRNA-Wissenschaft für personalisierte Krebsimpfstoffe sowie weitere Erfolge beim In-vivo-Gen-Editing verbucht werden. Die Zelltherapie ist in die Anfangsstadien der Krebstherapie vorgedrungen, was vermuten lässt, dass die klinischen Anwender immer mehr Zuversicht in Bezug auf eine Krebstherapie mit nur einer Einzeldosis haben.

Nach Einschätzung des Fondsmanagers könnten die klinischen Katalysatoren und eine kommerzielle Markteinführung 2023 für eine Verbesserung der Fundamentaldaten des Sektors und der Anlegerstimmung sorgen. Gentechnisch erzeugte Arzneimittel – von Gentherapie und Gen-Editierung bis hin zu RNA-basierten Therapien und Zelltechnik – könnten also in den kommenden zwei Jahrzehnten durchaus ein bahnbrechende Faktor im Gesundheitswesen sein.

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2023

GLOBALE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 eine Rendite von -11,84 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -10,73 % für den Bloomberg Global High Yield Corporate TR Index (USD Hedged). Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Im Jahr 2022 waren sowohl Aktien als auch Anleihen weltweit rückläufig. Ein restriktives Finanzumfeld, die doppelte Bedrohung durch Inflation und Rezession sowie der Krieg zwischen Russland und der Ukraine sorgten vor allem in der ersten Jahreshälfte für Kursverluste an den Märkten. Bei den Anleihen stieg die Rendite fünfjähriger US-Treasuries im Berichtsjahr von 1,26 % auf 4,00 %, nachdem die US-Notenbank Fed die Leitzinsen viermal in Folge um 75 Basispunkte (Bp.) erhöht hatte. Energietitel und energiebezogene Titel entwickelten sich gut, wohingegen die Sektoren Kommunikation, nichtzyklische Sektoren und Finanzunternehmen negativ tendierten.

Unterschiede in der Kursermittlung (der Fonds wird zum IDC-Geldkurs bewertet, während der Referenzwert zum Bloomberg-Geldkurs bewertet wird) waren 2022 für den Großteil der Underperformance im Fonds verantwortlich. Allerdings waren die Renditen auch ohne Berücksichtigung der unterschiedlichen Preisgestaltung leicht negativ.

Die modellbasierte Komponente erwies sich im Jahr 2022 als positiv, ebenso wie wertorientierte, qualitativ hochwertige Titel und Positionen in gefallenem Engeln (Anleihen, die kürzlich ihren Investment-Grade-Status eingebüßt haben). Allerdings konnten damit die Verluste aufgrund der Titelauswahl in einer Reihe von Sektoren (wie Technologie, Kommunikation und Investitionsgüter) nicht ausgeglichen werden.

Mit Beginn des Jahres 2023 bleibt das makroökonomische Umfeld unsicher. Die Inflation ist zwar von ihren Höchstständen zurückgegangen, bleibt aber weiter hoch. Frühindikatoren wie die Ölpreise, der Wohnungsbau, die Beschäftigung und Einkaufsmanagerindizes haben sich abgeschwächt, was die Inflation dämpfen dürfte. Angesichts dessen und nach vier aufeinanderfolgenden Zinserhöhungen um 75 Bp. durch die Fed geht der Fondsmanager davon aus, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 verlangsamen wird.

Darüber hinaus erscheinen die Unternehmensbilanzen der Emittenten von Hochzinsanleihen solide. Das derzeitige Kreditumfeld unterscheidet sich von früheren, vor einer Rezession vorherrschenden Bedingungen dahingehend, dass die Emittenten von Hochzinsanleihen einen relativ geringen Verschuldungsgrad und hohe Barmittelbestände aufweisen und ihre Verbindlichkeiten bis 2025 und darüber hinaus verlängert haben. Dies bedeutet, dass sie sich nicht sofort zu höheren Kosten refinanzieren müssen.

Der Fondsmanager ist der Meinung, dass sich die Renditen und Spreads attraktiv ausnehmen. Folglich geht er von einem recht gemäßigten Ausfallzyklus aus, zumal auch die Unternehmensbilanzen sehr robust sind. In Anbetracht der nach wie vor unterdurchschnittlichen Zahlungsausfälle und der Turbulenzen an den Aktienmärkten zeigen die Anleger zunehmend Interesse an liquideren, ertragsstarken Anlagen, darunter auch Hochzinsanleihen.

Insight North America LLC
Januar 2023

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -14,94 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -14,11 % im Bloomberg Global Aggregate Corporate TR Index, beide in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die negativen Renditen sowohl für den Fonds als auch für den Index waren auf die steigenden Zinssätze und die sich ausweitenden Spreads von Unternehmensanleihen im Berichtsjahr zurückzuführen. Die Anleger hatten zunehmend Sorge, dass höhere Zinssätze zu einer globalen Rezession führen würden. In den USA erwies sich der Inflationsdruck als hartnäckig und veranlasste die US-Notenbank Fed im März zu einer aggressiven Straffung der Geldpolitik. Der Anfang Januar auf ein Zielband von 0,00 % bis 0,25 % festgesetzte Leitzins (Fed Funds Rate) wurde 2022 mehrmals angehoben und lag zum Jahresende in einer Spanne von 4,25 % bis 4,50 %.

Andernorts zwangen die Auswirkungen des Krieges zwischen Russland und der Ukraine in Verbindung mit der seit Jahrzehnten nicht mehr so hohen Inflation die Europäische Zentralbank dazu, zum ersten Mal seit mehr als zehn Jahren die Zinsen zu erhöhen. Im Vereinigten Königreich kamen politische Probleme hinzu. Im September schlug der Versuch der neuen britischen Regierung fehl, die Wirtschaft zu stützen und die auf einem 40-Jahres-Hoch befindliche Inflation durch Steuersenkungen einzudämmen, woraufhin das Pfund Sterling abstürzte und die Zentralbank eingreifen musste. Diese Wirtschaftspläne waren unter Liz Truss verfolgt worden, die prompt als Premierministerin zurücktreten musste und von Rishi Sunak abgelöst wurde. Japan hielt über weite Strecken des Jahres an seiner expansiven Haltung festhielt. Ende Dezember lockerten die politischen Entscheidungsträger schließlich die Kontrolle über die Renditekurve. Dies dürfte einen weiteren Anstieg der langfristigen Zinssätze des Landes ermöglichen.

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

Insight North America LLC Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -16,39 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -17,31 % für den JP Morgan Global Government Bond Index (Unhedged) TR, jeweils in US-Dollar. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite, übertraf jedoch seinen Referenzwert.

Die Überrendite wurde durch untergewichtete Durationspositionen in den USA, der Eurozone, dem Vereinigten Königreich und Japan erzielt, also in Ländern, deren Zentralbanken während des gesamten Berichtszeitraums eine restriktive Politik verfolgten. Darüber hinaus war der Fonds angesichts der politischen Turbulenzen, mit denen die Wirtschaft im September zu kämpfen hatte, nur in sehr begrenztem Umfang

in britischen Staatsanleihen engagiert. Der Fondsmanager erhöhte die Fondsbestände in Gilts, nachdem die Renditen in die Höhe geschossen waren. Australien und Neuseeland waren im Portfolio deutlich übergewichtet und beeinträchtigten die Wertentwicklung, da die dortigen Renditen dem Anstieg bei US-Staatsanleihen folgten.

Der Fonds war im Vergleich zum Referenzwert vor allem in Wertpapieren mit längeren Laufzeiten investiert. Für die Wertentwicklung erwies sich dies als günstig, denn die hohe Inflation und die aggressiv vorgehenden Zentralbanken hatten eine Abflachung der globalen Renditekurven zur Folge. Staatsanleihen aus Schwellenländern, insbesondere Mexiko, Indonesien und Malaysia, erwiesen sich als widerstandsfähig. Sie legten weniger Volatilität an den Tag als ihre Pendants aus den Industrieländern und leisteten einen positiven Beitrag zur Gesamterrendite.

Das Währungsengagement erwies sich als abträglich. Verluste wurden etwa bei Short-Positionen eingefahren, etwa im koreanischen Won sowie mit einer Kreuzposition zwischen der schwedischen Krone und dem polnischen Zloty. Allerdings erwies sich eine Long-Position im japanischen Yen als hilfreich, vor allem im Dezember.

Im Hinblick auf die Portfolioveränderungen verringerte der Fondsmanager zunächst sein Engagement in europäischen Staatsanleihen, indem er sich von Futures auf zweijährige Bundesanleihen und 10-jährige französische Staatsanleihen trennte. Der Fonds verlagerte sich in der Renditekurve nach oben, indem er in der EU als auch spezifisch in Spanien 10-jährige Emissionen verkaufte und 30-jährige Titel kaufte. Die Short-Futures-Position in britischen Gilts wurde beibehalten. Das Engagement in inflationsindexierten Anleihen wurde während des gesamten Berichtszeitraums vor dem Hintergrund hoher Realrenditen und schließlich nachlassender Inflationserwartungen erhöht. Bei den Lokalwährungsanleihen von Schwellenländern investierte der Fondsmanager in indonesische und mexikanische Staatsanleihen sowie in Neuemissionen von Hartwährungsanleihen aus Saudi-Arabien.

Der Umfang der Long-Position im US-Dollar wurde zunächst aufgestockt. In einigen Schwellenländerwährungen wie dem koreanischen Won und dem chilenischen Peso wurden hingegen Short-Positionen eröffnet. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums wurde zum ersten Mal seit vielen Quartalen eine geringfügige Long-Position im Euro eröffnet, und die Long-Position in US-Dollar wurde in eine Short-Position umgewandelt.

Die aktuelle Positionierung des Fonds konzentriert sich auf die Anpassung der Duration von Staatsanleihen, um von den sich ändernden Erwartungen in Bezug auf Inflation und Leitzinsen zu profitieren. Der Fondsmanager rechnet in diesem Jahr mit stärkeren Kapitalschwankungen, da die Inflation zwar zurückgeht, aber auf hohen Niveaus verharren dürfte, es sei denn, es kommt zu einer schweren Rezession. Wenn die Inflation nicht auf ihren Zielwert zurückkehrt, könnten die Zentralbanken die Zinssätze über den vom Markt erwarteten Höchststand hinaus anheben.

Da die Zentralbanken voraussichtlich kurz vor dem Ende ihres Straffungszyklus stehen, wird der Fondsmanager nach Möglichkeiten suchen, die Duration zu erhöhen. Zu beachten ist dabei allerdings, dass die Anleger im Januar mit einem großen Angebot an Staatsanleihen konfrontiert sein werden, was die Performance wohl belasten wird.

Newton Investment Management Limited** Januar 2023

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -12,68 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit -14,22 % im Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index TR USD-Hedged und -14,87 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Bond Global Corporates (alle Angaben in US-Dollar). Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber sowohl seinen Referenzwert als auch den Sektordurchschnitt.

Der russische Einmarsch in der Ukraine versetzte den globalen Märkten einen Schock und verschlimmerte die Bedenken über die Inflation und die Abschwächung des globalen Wirtschaftswachstums. Eine Kombination aus steigenden Staatsanleiherenditen und sich ausweitenden Kreditspreads hatte 2022 für Kreditanleger einen perfekten Sturm zur Folge.

In den ersten drei Monaten des Jahres belasteten die Renditekurvenpositionierung, die Länderauswahl und die Schwellenländerpositionierung des Fonds die Wertentwicklung. Die Zinspositionierung steigerte die Rendite dagegen, was auf das untergewichtete Durationsengagement zurückzuführen war, als die Renditen anzogen. Ertragssteigernd war die Wertpapierauswahl, insbesondere wegen Zugewinnen bei Versicherungs- und Einzelhandelsimmobilienunternehmen. Das mangelnde Engagement des Fonds in Unternehmensanleihen mit russischem Kontext war ebenfalls hilfreich.

Im zweiten Quartal war die Durationsposition schädlich. Auch die Länderauswahl belastete letztlich die Performance. Das Sektorengagement wirkte zunächst vorteilhaft, belastete aber dann im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums, während die Wertpapierauswahl erst eine positive, dann eine neutrale Wirkung zeigte und am Ende des Zeitraums Wertabzüge brachte.

Im dritten Quartal übertraf der Fonds den Referenzwert dank einer überdurchschnittlichen Performance von Kreditanlagen, Zinsen und Währungen. Die Sektorstrategie wirkte sich positiv aus, denn europäische Immobilien konnten die in den Vormonaten eingefahrenen Verluste zum Teil wettmachen. Das Engagement des Fonds in Schwellenländern und hypothekarisch besicherten Wertpapieren wurde durch die anhaltend hohe Volatilität bei Zinssätzen belastet.

Im Schlussquartal 2022 erholten sich risikoreichere Vermögenswerte, da aufgrund schwächerer Wirtschaftsdaten und einer überraschend niedrigen Inflation eine Änderung in der Geldpolitik eingepreist wurde, was den Kreditmärkten Auftrieb verlieh. In diesem Umfeld war die Zinspositionierung des Fonds hauptverantwortlich für die relative Outperformance. Die Strategie des Fonds bei Unternehmensanleihen und sein Währungsengagement erwiesen sich als abträglich.

Gegen Ende des Jahres verstärkte der Fondsmanager die Untergewichtung in der Duration, nachdem die Europäische Zentralbank die Zinssätze angehoben hatte. Kurz vor Jahresende wurde die Gewichtung in der Duration dann wieder erhöht. Bei den Unternehmensanleihen wurde das Fondsrisiko im Dezember auf eine leichte Untergewichtung gegenüber dem Referenzindex verringert. Der Fondsmanager veräußerte außerdem auf den Euro lautende Unternehmensanleihen, die sich besser entwickelt hatten als US-Emissionen, und verringerte das Volatilitätsrisiko durch den Verkauf von Credit Default Swaps.

Im kommenden Jahr rechnet der Fondsmanager mit einer Verlangsamung des globalen Wachstums und einer niedrigeren Gesamtinflation. Der Fonds ist auf einen Zinshöhepunkt im

Jahr 2023 ausgerichtet. Allerdings dürften die darauf folgenden Zinssenkungen allmählicher vorstattengehen, als von den Marktteilnehmern derzeit erwartet.

Wie das Jahr 2022 zeigte, können unerwartete Ereignisse zu Turbulenzen in der Wirtschaft und an den Märkten führen. Der Fondsmanager behält die geopolitische Lage genau im Blick, darunter die Spannungen zwischen China und Taiwan und der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -6,50 %, verglichen mit 3,48 % für den SOFR (30 Tage aufgezinnt) +2 % (jeweils in US-Dollar). Der Fonds lieferte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die Bestände des Fonds in Hochzinsanleihen verbuchten im Verlauf des Jahres die schwächsten Renditen. Instrumente zur Währungsabsicherung und Derivate wirkten sich positiv aus.

Im Bereich der Hochzinsanleihen brachten die Bestände im iShares Asian High Yield Bond Fund und im BNY Mellon Global High Yield Bond Fund die größten Wertabzüge. Allerdings erzielten Einzelpositionen wie die chinesische Immobilien-Holding KWG auch Wertzuwächse. Ebenfalls schwach tendierten die Fondsbestände in Staatsanleihen der Industrieländer, da es unter diesen zu einem Abverkauf kam. Am schädlichsten war das Engagement in kurzlaufenden US-Treasuries. Bestände in langlaufenden US-amerikanischen und australischen Staatsanleihen sowie 10-jährige dänische Anleihen belasteten die Performance ebenfalls. Allerdings wurde ein großer Teil dieser Verluste bei Staatsanleihen durch Short-Positionen in Futures auf Staatsanleihen ausgeglichen, die sich wertsteigernd auswirkten.

Die Verluste aus Unternehmensanleihen mit Investment Grade fielen eher verhalten aus, was einer niedrigen Gewichtung und einer Ausrichtung auf eine kürzere Duration zuzuschreiben war. Zudem waren die Verluste in Anlagen der Schwellenländer geringer als die am breiteren Markt. Das Währungsengagement steigerte per saldo die Wertentwicklung. Die Long-Positionen des Fonds im US-Dollar und im chilenischen Peso sowie eine Short-Position im Euro erwiesen sich als vorteilhaft.

Teil der Veränderungen auf Portfolioebene war, dass der Fondsmanager zu Beginn des Jahres zur Duration wieder eine defensivere Haltung einnahm, da klar wurde, dass die Zentralbanken, allen voran die US-Notenbank, die Zinsen rasant erhöhen würden. Es wurden Short-Positionen in britischen Gilts, fünfjährigen US-Staatsanleihen und deutschen Bundesanleihen eröffnet. Brasilianische und südafrikanische Anleihen wurden taktisch zugekauft in der Erwartung, dass sie von einem sprunghaften Anstieg der Rohstoffpreise profitieren würden. Im weiteren Jahresverlauf wurden langlaufende US-amerikanische und europäische Staatsanleihen sowie US-TIPS hinzugefügt. Bei Lokalwährungsanleihen der Schwellenländer kam es zu Käufen in Peru, Mexiko und

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND Forts.

Saudi-Arabien. Außerdem wurde das Engagement des Fonds in Brasilien erhöht. Die Gewichtung von Hochzinsanleihen wurde verringert, da sich der Ausblick für das Wirtschaftswachstum und die Liquidität verschlechterte.

Im späteren Jahresverlauf wurde die Gesamtduration des Fonds erhöht. Dies erfolgte in erster Linie durch den Verkauf der Bestände in Put-Optionen auf US-Staatsanleihen und eine erhöhte Duration in Unternehmens- und Schwelkenländeranleihen mit Investment Grade. In den letzten Wochen des Berichtszeitraums wurde die Duration erneut verringert.

Bei Währungen erhöhte der Fondsmanager die Long-Position im US-Dollar und ging Short-Positionen in Währungen wie dem koreanischen Won und der tschechischen Krone ein. Im weiteren Jahresverlauf wurden jedoch eine Long-Position im Euro sowie eine Short-Position im US-Dollar eingeführt.

Die aktuelle Positionierung des Fonds konzentriert sich auf die Anpassung der Duration von Staatsanleihen, um von den sich ändernden Erwartungen in Bezug auf Inflation und Leitzinsen zu profitieren. Ansehnliche Renditen erwiesen sich als hilfreich: Sie können Unterstützung bieten, um Kapitalschwankungen auszugleichen. Letztere werden für 2023 erwartet, da die Inflation zwar zurückgeht, aber auf einem hohen Niveau verharren dürfte (sofern es nicht zu einer schweren Rezession kommt). Wenn die Inflation nicht auf ihren Zielwert zurückkehrt, könnten die Zentralbanken die Zinssätze über den vom Markt erwarteten Höchststand hinaus anheben.

Newton Investment Management Limited Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -12,20 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -10,56 % für den ICE Bank of America Merrill Lynch Developed Markets High Yield Constrained TR Index (USD Hedged), jeweils in US-Dollar.

Zu Beginn des Jahres 2022 befand sich der Markt für Hochzinsanleihen in guter Verfassung und profitierte von der starken Performance 2021 und technischen Marktfaktoren. Infolge der restriktiven Haltung der US-Notenbank und anhaltender Inflationsbedenken erlebten Hochzinsanleihen eines der schwierigsten Jahre seit 2008, wenngleich die Anlageklasse im Verhältnis besser abschnitt als die meisten festverzinslichen Kategorien. Die Spreads von Hochzinsanleihen weiteten sich ab Jahresbeginn deutlich. Die Wertentwicklung fiel über das gesamte Qualitätsspektrum hinweg negativ aus, wobei das niedriger eingestufte Segment am abträglichsten war. Die stark unterstützende Fiskal- und Geldpolitik im Zuge des Hochfahrens der Wirtschaft nach der Pandemie hat in den letzten Quartalen die Unternehmensgewinne deutlich beflügelt und sorgte für robustere Bilanzen und ein besseres Liquiditätsumfeld. Für 2022 lag die Ausfallquote bei rund 1,5 %. Im Großen und Ganzen bleiben die Unternehmensbilanzen ungeachtet der Konjunkturabschwächung solide. Die meisten Emittenten von Hochzinsanleihen verfügen also über ausreichend Liquidität, um ihren Geschäftsbetrieb aufrechtzuerhalten und ihren Kapitalbedarf zu decken. Dennoch geht der Fondsmanager für 2023 von erneut steigenden Ausfallquoten aus, die sich dem längerfristigen Durchschnitt annähern dürften.

Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück. Dies war zum Teil auf eine schwächere Titelauswahl im Gesundheitswesen und Finanzsektor in den USA und Europa zurückzuführen. Eine robuste Sektorauswahl in den Sektoren Pharmazeutika und Einzelhandel konnte zumindest teilweise Abhilfe schaffen. Die geringfügige Fondsallokation in variabel verzinslichen Vermögenswerten trug ebenfalls zur Wertentwicklung bei.

Mit Beginn des Jahres 2023 verhartet der Fondsschwerpunkt angesichts des Potenzials für vermehrte wirtschaftliche Volatilität unvermindert auf Titeln von höherer Qualität. Der Fondsmanager ist der Meinung, dass die Renditeaufschläge für Hochzinsanleihen in nächster Zeit angesichts schwächerer Wirtschaftsdaten und einer weiterhin restriktiven Geldpolitik der Fed etwas steigen könnten. Allerdings könnten sich ihrer Einschätzung zufolge die Spreads in der zweiten Jahreshälfte angesichts der Kommentare und des Ausblicks der Fed wieder verengen.

In diesem Kontext dürfte das operative Umfeld für bestimmte zyklische Sektoren nach Überzeugung des Fondsmanagers schwieriger werden, unter anderem für Unternehmen aus den Sektoren Chemie, Metalle und Bergbau und Baustoffe. Ungeachtet dessen dürften sich laut Fondsmanager die Energiemärkte aufgrund der Versorgungsentpässe und der potenziellen Wiederöffnung der chinesischen Wirtschaft infolge der geänderten Covid-Politik im Land weiter gut behaupten. Bereiche, die von diskretionären und werbungsbezogenen Ausgaben abhängen, darunter Einzelhandel, Konsumgüter und Rundfunk und Fernsehen, könnten nach Ansicht des Fondsmanagers ebenfalls schwächere Gewinne verzeichnen. Gleichzeitig ist man im Fonds nach wie vor bereit, Kapitalrisiken in Sektoren einzugehen, die auf defensivere Endmärkte ausgerichtet sind, darunter Verpackungen für Lebensmittel und Getränke, Versicherungen und das Gesundheitswesen. Der Fonds beurteilt Sektoren weiter skeptisch, die laufend Zugang zu den mittlerweile teuren Kapitalmärkten benötigen, um hohe Investitionsausgaben zu finanzieren, etwa zum Ausbau von Kabelnetzen und Drahtleitungen.

Im Hinblick auf die Fondspositionierung hat der Fondsmanager die Bestände in Emittenten mit geringerer Qualität abgebaut, das zyklische Engagement verringert und attraktive Gelegenheiten bei Titeln von höherer Qualität identifiziert. Emittenten mit einem BB-Rating machen das größte Bonitätssegment im Fonds aus, während „Single Bs“ weiterhin gut vertreten und Titel mit CCC-Rating untergewichtet sind. Die Duration im Fonds ist etwas länger als insgesamt im Referenzwert, was vor allem auf das Engagement in Anleihen mit BB-Rating mit tendenziell längerer Duration zurückzuführen ist. Insgesamt ist der Fondsmanager der Ansicht, dass die Titelauswahl für die Wertentwicklung im Jahr 2023 den Ausschlag geben wird.

Alcentra NY, LLC Januar 2023

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -4,41 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der SOFR (90 Tage aufgezinst), ein Plus von 1,17 % (jeweils in US-Dollar). Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

In der ersten Jahreshälfte entwickelte sich der Fonds unterdurchschnittlich, weil

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

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

es bei Staatsanleihen zu einer Verkaufswelle kam und sich die Kreditspreads weiteten. Globale Hochzinsanleihen verzeichneten einen besonders schwierigen Zeitraum. Qualitativ höherwertige Anleihen erzielten nach wie vor eine relative Outperformance. Anleihen von geringerer Qualität wurden dagegen durch Wachstumsbedenken und steigende Zinssätze beeinträchtigt.

Mit Beginn des dritten Quartals schnitt der Fonds dank seiner kürzeren Gesamtduration (etwa 1,7 Jahre gegenüber 3,9 Jahren am Markt) und einer soliden Titelauswahl besser ab als der breitere Markt für globale Hochzinsanleihen. Die relative Outperformance hielt bis in das vierte Quartal an. Zurückzuführen war sie auf die im Vergleich kürzere Gesamtduration (ca. 2,12 Jahre gegenüber 3,72 Jahren am Markt) und Endfälligkeit (3,04 Jahre gegenüber 5,12 Jahren am Markt) sowie auf die anhaltend positive Titelauswahl.

Bei den Portfolioaktivitäten konzentrierte sich der Fondsmanager zu Beginn des Jahres darauf, in einem unsicheren Marktumfeld die Barmittel aufzustocken. In Anbetracht der vorherrschenden Unsicherheit am Markt, die durch die nachlassende Marktliquidität noch verschärft wurde, hielt der Fonds eine beträchtliche Liquiditätsposition vor. Im dritten Quartal nutzte der Fondsmanager dann einen Teil dieser Barmittel, um neue attraktive Anlagegelegenheiten wahrzunehmen, insbesondere bei grünen Anleihen. Zudem verkaufte der Fonds sechsmontatige Credit Default Swaps (CDS) von Casino und Jaguar und reduzierte den Bestand in House of HR und TDC.

Im Schlussquartal nutzte der Fonds die Marktschwäche, um neue attraktive Anlagegelegenheiten zu nutzen. Gleichzeitig wurden allzu großen Positionen gestutzt, die durch erhebliche Mittelabflüsse von verbindlichkeitsorientierten Anlegern entstanden waren, die Einschusspflichten nachkommen mussten. Im Dezember kam es jedoch zu Nettomittelzuflüssen in den Fonds. Der Fondsmanager nutzte die Hälfte der freien Mittel, um sie in Titel zu reinvestieren, die ein besonders gutes Wertpotenzial boten.

Der Fonds verringerte sein Engagement in Credit Default Swaps und Darlehen erheblich – auf 0 % bzw. 1,9 % am Jahresende. Unterdessen hielt der Fonds an seiner Präferenz für auf Euro lautende Hochzinsanleihen fest, bei einem geringeren Engagement in Hochzinsemissionen, die auf Pfund Sterling oder US-Dollar lauten, oder solchen aus Schwellenländern. Zum Ende des Berichtszeitraums hatte sich die Anzahl der Fondsbestände auf 77 verringert. Das durchschnittliche Kreditrating im Fonds war von B auf B+ gestiegen und die durchschnittliche Duration hatte sich von 1,74 Jahren auf 2,12 Jahre verlängert.

Der Fondsmanager geht davon aus, dass die US-Fed 2023 mit der Straffung ihrer Geldpolitik aufhören wird, was Hochzinsanleihen und Anleihen mit Investment-Grade-Rating auf Erholungskurs schicken sollte. Sie ist vor allem der Überzeugung, dass Hochzinsanleihen mit kürzeren Laufzeiten aus Europa und den USA 2023 robuste Renditen erzielen dürften und nichtzyklische Sektoren wie Telekommunikation und das Gesundheitswesen überdurchschnittlich abschneiden werden. Zugleich könnten höhere Zinssätze, ein beschränkter Refinanzierungsbedarf und sonstige verfügbare liquide Mittel zu verhaltenen Neuemissionen führen, was der Performance von Hochzinsanleihen ebenfalls entgegenkommen würde. Angesichts der schlechten Konjunkturaussichten weltweit, der Energiekrise in Europa und möglicher Inflationsüberraschungen schließt der Fondsmanager allerdings nicht aus, dass es in der ersten Hälfte des Jahres 2023 erneut zu Volatilität kommen wird.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2023

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -7,29 % nach Abzug von Gebühren. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR +2 % eine Rendite von 2,08 % (jeweils in Euro). Der Fonds lieferte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die schwachen relativen Renditen des Fonds waren größtenteils auf hochverzinsliche Unternehmensanleihen und die Währungsabsicherung zurückzuführen. Die Fondsbestände in Staatsanleihen der Industrie- und Schwellenländer sowie Investment-Grade-Unternehmensanleihen wirkten ebenfalls abträglich, wenn auch in geringerem Maße, während derivative Instrumente Mehrwert brachten.

Im Hochzinssegment zeigten die Immobilienwerte des Fonds wie Heimstaden Bostad und Samhallsbyggnadsbolaget Schwäche, obwohl im Schlussquartal des Jahres bei Hochzinsanleihen eine gewisse Erholung zu verzeichnen war. Positionen in langlaufenden Staatsanleihen der Industrieländer, vor allem in den USA und Australien, und 10-jährigen Staatsanleihen aus Dänemark beeinträchtigten die Renditen im Fonds. Bei den Staatsanleihen der Schwellenländer erwies sich das Engagement in kolumbianischen Lokalwährungsanleihen als ertragsmindernd. Investment-Grade-Unternehmensanleihen litten ferner unter ihrer starken Korrelation mit Staatsanleihen. In Bezug auf das Währungsengagement entwickelte sich die Long-Position des Fonds im chilenischen Peso gut. Eine Long-Position in der norwegischen Krone und Short-Positionen im südafrikanischen Rand, in der tschechischen Krone, dem polnischen Zloty und dem koreanischen Won steigerten den Ertrag ebenfalls.

Zu den Veränderungen im Portfolio zählte eine Verringerung des Engagements in hochverzinslichen Unternehmensanleihen. Im ersten Halbjahr wurden unter anderem europäische Unternehmen, die anfällig waren für höhere Energiekosten, verschiedene ergänzende Tier-1-Anleihen wie UniCredit und Lloyds und Unternehmen aus dem Bereich zyklische Konsumgüter wie Asda und Philips Domestic Appliances abgestoßen. Im weiteren Jahresverlauf waren von den Verkäufen die Lebensmitteleinzelhändler Iceland und Ocado sowie die Anleihen von IHS Netherlands betroffen, da das Engagement in Hochzinsanleihen weiter abgebaut wurde. Das Engagement in Staatsanleihen der Schwellenländer wurde erhöht.

In der zweiten Hälfte des Berichtsjahres stockte der Fondsmanager allmählich das Engagement in Staatsanleihen der Industrieländer auf. So wurden langlaufende US-amerikanische und europäische Staatsanleihen und US-TIPS hinzugefügt. Der Fondsmanager engagierte sich verstärkt in Unternehmensanleihen mit Investment Grade und beteiligte sich an Neuemissionen, die attraktive Prämien aufwiesen, darunter Dollar General, Hiscox und Orsted. Weitere Positionen wurden in Saint-Gobain und AT&T eingegangen. Bei Lokalwährungsanleihen aus Schwellenländern kam es zu Investitionen in Peru und Mexiko. Anstelle von Call-Optionen auf US-Treasuries wurden Put-Optionen erworben. Die Gesamtduration des Fonds wurde im Schlussquartal des Jahres zunächst erhöht, in den letzten Wochen des Jahres jedoch wieder verringert.

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND Forts.

Die aktuelle Positionierung des Fonds konzentriert sich auf die Anpassung der Duration von Staatsanleihen, um von den sich ändernden Erwartungen in Bezug auf die Inflation und Zinssätze zu profitieren. Die Fondsbestände bieten häufig eine ansehnliche Verzinsung, die einen Teil der Kapitalschwankungen kompensieren können. Für 2023 rechnet der Fondsmanager mit solchen Kapitalschwankungen, da die Inflation zwar zurückgehen, aber auf hohem Niveau verharren dürfte, sofern es nicht zu einer schweren Rezession kommt. Wenn die Inflation nicht auf ihren Zielwert zurückkehrt, könnten die Zentralbanken die Zinssätze über den vom Markt erwarteten Höchststand hinaus anheben.

Newton Investment Management Limited
Januar 2023

Regionale & Spezialanleihen

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -14,10 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -13,40 % für den Bloomberg US High Yield Fallen Angel 3% Cap TR und -12,57 % für den Lipper Bond Global High Yield USD Average, alle Angaben in US-Dollar. Dementsprechend verbuchte der Fonds eine negative Rendite und blieb sowohl hinter seinem Referenzwert als auch hinter dem Sektordurchschnitt zurück.

Das Jahr war kontinuierlich von Sorgen um eine rekordhohe Inflation, steigende Zinsen, die wachsende Rezessionsgefahr und geopolitische Turbulenzen geprägt wie insbesondere die Lieferkettenproblemen in China und der Krieg zwischen Russland und der Ukraine. Diese negativen Faktoren lasteten schwer auf der Marktstimmung, vor allem in der ersten Jahreshälfte.

Auf Sektorebene bildeten Kommunikationstitel und zyklische Aktien die Schlusslichter. Die Zinspositionierung des Fonds entsprach in etwa der des Referenzwerts. Dies erwies sich für beide als negativ, da die Zinssätze weltweit als Reaktion auf die drohende Inflation rapide anstiegen. In den USA stieg die Rendite fünfjähriger US-Treasuries im Berichtsjahr von 1,26 % auf 4,00 %, nachdem die US-Notenbank die Leitzinsen viermal in Folge um 75 Basispunkte (Bp.) angehoben hatte.

Energie und energiebezogene Sektoren generierten für den Fonds positive Renditen, da die Rohstoffpreise aufgrund der eingeschränkten Öl- und Gaslieferungen aus Russland in die Höhe schnellten. Die Sektoren Versicherungen und Investitionsgüter entwickelten sich ebenfalls sehr erfreulich. Nach Kreditratings erzielten Anleihen mit BB-Rating gegenüber denen mit B und CCC eine starke Outperformance.

Am Fonds wurden im Berichtszeitraum keine nennenswerten Veränderungen vorgenommen. Die Hauptaktivität entfiel auf die Wiederanlage von liquiden Mitteln aus Kupons.

Auch künftig werden es die Märkte mit einem unsicheren Umfeld zu tun haben. Obgleich die Inflation nach wie vor hoch ist, lässt sie allmählich nach. Der Fondsmanager geht daher davon aus, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 verlangsamen wird. Weitere Kursverluste an den Märkten für Hochzinsanleihen dürften nach einem derart schwierigen Jahr begrenzt bleiben. Die Unternehmen innerhalb des Sektors weisen eine verhältnismäßig geringe Verschuldung und starke Liquiditätspolster auf, mit denen sie ihren Schuldendienst bestreiten können. Zudem muss ein Großteil der ausgegebenen Schuldtitel vorerst nicht refinanziert werden. Aufgrund ihrer hohen Liquidität und ihrer stetigen, vertraglich festgelegten Erträge erachtet der Fondsmanager Hochzinsanleihen im Gegensatz zu den illiquiden Privatmärkten und volatilen öffentlichen Aktienmärkten als attraktiv.

Insight North America LLC
Januar 2023

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc) des Fonds erzielte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -11,48 % nach Abzug von Gebühren, gegenüber einer Rendite von -11,19 % für den Bloomberg Barclays US Corporate High Yield TR, jeweils in US-Dollar. Entsprechend verzeichnete der Fonds eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Das Jahr war kontinuierlich von Sorgen um eine rekordhohe Inflation, steigende Zinsen, die wachsende Rezessionsgefahr und geopolitische Turbulenzen geprägt wie insbesondere die Lieferkettenproblemen in China und der Krieg zwischen Russland und der Ukraine. Diese negativen Faktoren lasteten schwer auf der Marktstimmung, vor allem in der ersten Jahreshälfte.

Auf Sektorebene bildeten Kommunikationstitel, nichtzyklische Aktien und Finanzwerte die Schlusslichter. Die Zinspositionierung des Fonds entsprach in etwa der des Referenzwerts. Dies erwies sich für beide als negativ, da die Zinssätze weltweit als Reaktion auf die drohende Inflation rapide anstiegen. In den USA stieg die Rendite fünfjähriger US-Treasuries im Berichtsjahr von 1,26 % auf 4,00 %, nachdem die US-Notenbank die Leitzinsen viermal in Folge um 75 Basispunkte (Bp.) angehoben hatte.

Energie und energiebezogene Sektoren generierten für den Fonds positive Renditen, da die Rohstoffpreise aufgrund der eingeschränkten Öl- und Gaslieferungen aus Russland in die Höhe schnellten. Nach Kreditratings erzielten Anleihen mit BB-Rating gegenüber Titeln mit B und CCC eine Outperformance.

Am Fonds wurden im Berichtszeitraum keine nennenswerten Veränderungen vorgenommen. Die Hauptaktivität entfiel auf die Wiederanlage von liquiden Mitteln aus Kupons.

Auch künftig werden es die Märkte mit einem unsicheren Umfeld zu tun haben. Obgleich die Inflation nach wie vor hoch ist, lässt sie allmählich nach. Der Fondsmanager geht daher davon aus, dass sich das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 verlangsamen wird. Weitere Kursverluste an den Märkten für Hochzinsanleihen dürften nach einem derart schwierigen Jahr begrenzt bleiben. Die Unternehmen innerhalb des Sektors weisen eine verhältnismäßig geringe Verschuldung und starke Liquiditätspolster auf, mit denen sie ihren Schuldendienst bestreiten können. Zudem muss ein Großteil der ausgegebenen Schuldtitel vorerst nicht refinanziert werden. Aufgrund ihrer hohen Liquidität und ihrer stetigen, vertraglich festgelegten Erträge erachtet der Fondsmanager Hochzinsanleihen im Gegensatz zu den illiquiden Privatmärkten und volatilen öffentlichen Aktienmärkten als attraktiv.

Insight North America LLC
Januar 2023

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -15,87 %, verglichen mit -12,26 % für den JP Morgan Corporate EMBI Broad Diversified USD Index TR und -15,17 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Bond Emerging Markets Global Corporates (alle Angaben in US-Dollar).

Der Fonds erzielte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert und dem Sektordurchschnitt zurück.

Das vergangene Jahr war für die Marktteilnehmer schwierig: In Europa kehrte der Krieg zurück, die Inflation in weiten Teilen der Welt erreichte seit mehreren Jahrzehnten nicht mehr verzeichnete Höchststände, die Zentralbanken erhöhten wiederholt und anhaltend ihre Leitzinsen, die Rezessionsorgen nahmen zu und der US-Dollar wertete auf ein 20-Jahres-Hoch auf.

Das Fondsenagement in Hochzinsanleihen belastete die Performance deutlich. Auf regionaler Ebene waren hochverzinsliche Anleihen in Lateinamerika (vor allem in Brasilien und Mexiko) und Asien (China und Macao) besonders schwach. Auf Sektorebene belasteten die Finanzwerte die Renditen erheblich. Nachdem die Inflations- und Zinserwartungen stiegen, schnitten Anleihen mit Laufzeiten von 3 bis 10 Jahren in der Regel schlechter ab als solche mit kürzeren Laufzeiten von 0-3 Jahren.

Das Währungsengagement des Fonds und die Bestände in Staatsanleihen unterstützten die Renditen im Berichtszeitraum. Im Vergleich zum Referenzwert schnitten die Investment-Grade-Anleihen des Fonds besser ab, insbesondere das regionale Engagement in Asien sowie in Mittel- und Osteuropa. Auf Länderebene waren auch die Fondsbestände in Hochzins- und Investment-Grade-Anleihen aus Russland für die relative Wertentwicklung von Vorteil. Die Portfolioabsicherungsstrategie des Fondsmanagers schlug positiv zu Buche.

Nach Kreditratings präsentierten sich Hochzinsanleihen und Titel mit Investment Grade im Berichtsjahr gleichermaßen schwach. Unter Hochzinsanleihen konzentrierte sich der negative Performancebeitrag vor allem auf Anleihen mit den Noten BB und B. Bei Investment-Grade-Anleihen war die negative Performance in erster Linie der Positionierung in Instrumenten mit BBB-Rating zuzuschreiben.

Im Hinblick auf die Portfolioaktivität löste der Fondsmanager die seit langem bestehende Untergewichtung Asiens auf, da diese Region von der Wiederöffnung der chinesischen Wirtschaft profitieren sollte. Der Fonds erhöhte außerdem seine Übergewichtung in Lateinamerika. Der Fondsmanager schätzt die relativen Bewertungen in der Region als attraktiv ein. Afrika und Mittel- sowie Osteuropa sind nach wie vor leicht übergewichtet, der Nahe Osten aufgrund überzogener Bewertungen bleibt dagegen untergewichtet.

Mit Blick auf die Zukunft haben sich einige der größten Hindernisse für die Schwellenländer im Jahr 2022, darunter Chinas strenge Null-Covid-Politik und ein starker US-Dollar, Anfang 2023 in Rückenwind verwandelt.

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND Forts.

Darüber hinaus ist die Inflation in den USA mittlerweile definitiv wieder rückläufig, was Anlass zur Hoffnung gibt, dass die Federal Reserve das Tempo ihrer Zinserhöhungen verringern wird.

Für die Unternehmen in den Schwellenländern wirkten sich die unerwartet frühe Wiederöffnung der chinesischen Wirtschaft und energischere handfeste Unterstützungsmaßnahmen für den chinesischen Immobilien- und Technologiesektor am positivsten aus. Obschon sich die Stimmung am Markt verbessert hat, besteht laut Fondsmanager nach wie vor eine klare Diskrepanz zwischen den Bewertungen und dem stärkeren Wirtschaftsumfeld. Folglich schätzt der Fondsmanager den Ausblick für Unternehmensanleihen der Schwellenländer positiv ein.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2023

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -17,54 % nach Abzug von Gebühren, während der JPMorgan EMBI Global Index -16,45 % verbuchte. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Auf Länderebene wurde die Performance des Fonds vor allem durch die Übergewichtung von Mexiko und Ghana und die Untergewichtung der Türkei beeinträchtigt. Eine Übergewichtete Position in Russland und untergewichtete Positionen in Belarus und Sri Lanka erwiesen sich als günstiger. Ebenfalls positiv waren die Durations- und die Spread-Positionierung.

Zu Beginn des Jahres verringerte der Fondsmanager sein Engagement in Russland und der Ukraine und baute zugleich die Positionen in ausgewählten Ländern moderat aus, unter anderem in Argentinien und Panama. In der Folge wurde das Risiko in Europa durch Beteiligungen an Neuemissionen in Bulgarien und Rumänien aufgestockt, die offenbar ein gutes Wertpotenzial boten. Der Fondsmanager trennte sich nach einer starken Outperformance von den Fondsbeteiligungen an quasi-staatlichen Unternehmen in China (Sinopec und State Grid Corporation of China) und Chile (Codelco). Mit Alibaba wurde ein weiteres chinesisches Unternehmen in den Fonds aufgenommen. Zu Beginn des vierten Quartals stockte der Fonds das aktive Risiko deutlich auf, das größtenteils auf die Spreads von Investment-Grade-Anleihen entfiel.

Gegen Ende des Jahres konzentrierte sich die Portfolioaktivität angesichts der verengten Spreads in der Anlageklasse auf eine Verringerung des Risikos. Das Risiko bezogen auf Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating wurde verringert. Im Zuge starker Rallys beschloss der Fondsmanager, Gewinne aus den Positionen mitzunehmen, die in den letzten Monaten in das Portfolio aufgenommen worden waren. Dies betraf im Einzelnen auf den Euro lautende Positionen in Estland und Litauen sowie Bulgarien und Positionen in Polen, auf den Philippinen, in Mexiko, der Elfenbeinküste und der Dominikanischen Republik. Mit den Erlösen wurden die Fondsbeteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating erhöht, bei denen gutes Wertpotenzial identifiziert wurde.

Zudem trennte sich der Fondsmanager von Gazprom, nachdem sich die Preise für russische Vermögenswerte von einem sehr schlechten Niveau zu Beginn des Jahres erholt hatten, und wegen der anhaltenden Risiken im Zusammenhang mit dem Krieg in der Ukraine. Schließlich wurde eine Position in Ägypten verkauft, um eine aktive Untergewichtung herbeizuführen, nachdem sich die Spreads deutlich erhöht hatten und weiterhin Probleme bestehen, wie die Spanne zwischen dem offiziellen ägyptischen Wechselkurs und dem parallelen Kurs belegt. Letztere lässt auf Schwierigkeiten bei der Außenbilanz und Mittelabflüsse schließen.

Der Fonds ist in Schwellenländeranleihen durch Engagements in Hochzinspapiere weiterhin Übergewichtet, nachdem die Bestände in Investment-Grade-Titeln im Dezember reduziert wurden. Long-Positionen in ausgewählten Ländern Afrikas und Lateinamerikas wurden durch untergewichtete Positionen in Asien und bestimmten Regionen in Mittel- und Osteuropa finanziert, in denen die Bewertungskennzahlen wesentlich anspruchsvoller erscheinen. Aus Sektorperspektive war der Fonds in quasi-staatlichen Schuldtiteln und Unternehmensanleihen weiterhin über- und in Staatsanleihen auf Durationsbasis untergewichteter. Der Fondsmanager strebt eine insgesamt neutrale Durationsposition an, da die Erwartungen in Bezug auf den möglichen Höchststand der US-Zinssätze nun vernünftiger sind und die Rhetorik der Zentralbanken weltweit ausgewogener anmutet, zumal die Inflation ihren Höhepunkt erreicht haben dürfte.

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2023

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verbuchte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -9,56 % nach Abzug von Gebühren, während der JP Morgan GBI-EM Global Diversified TR Index eine Rendite von -11,69 % verbuchte, beide in US-Dollar. Der Fonds lieferte eine negative Rendite, entwickelte sich aber besser als der Referenzwert.

Die Outperformance des Fonds war sowohl auf lokale Anleihe- als auch Währungsengagements zurückzuführen. Die Währungspositionierung profitierte von einer Untergewichtung im ägyptischen Pfund und in der indonesischen Rupiah sowie einer Übergewichtung im russischen Rubel und im koreanischen Won. Dies wurde teilweise durch die Übergewichtung des kolumbianischen Peso und des chilenischen Peso zunichte gemacht. Bei Lokalwährungsanleihen profitierte der Fonds insbesondere von einer Untergewichtung Polens und einer Übergewichtung Russlands, was teilweise durch eine Übergewichtung Kolumbiens und eine Untergewichtung der Türkei ausgemerzt wurde.

Ab Ende 2021 verringerte der Fonds sein aktives Risiko leicht. Bei den Währungen wurde die Long-Position im kolumbianischen Peso verringert und die Untergewichtung im peruanischen Sol und im rumänischen Leu erhöht. Ferner wurde eine Relative-Value-Position mit Long-Engagement im südafrikanischen Rand im Verhältnis zum mexikanischen Peso hinzugefügt. Dieser Entscheidung lagen sowohl bewertungsbezogene als auch zyklische Faktoren zugrunde. Mit Beginn des dritten Quartals erhöhte der Fonds allmählich aktive Positionen in Anleihen, indem er sich stärker in Lokalwährungsanleihen Südafrikas und Mexikos engagierte.

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND Forts.

Darüber hinaus löste der Fonds einige Relative-Value-Trades auf, die eine Long-Position in der indischen Rupie auf „neutral“ verringerten, stützte eine Short-Position im chinesischen Renminbi um die Hälfte und fügte eine übergewichtete Position im chilenischen Peso hinzu. Ferner nahm der Fondsmanager eine Position in koreanischen Anleihen auf. In Malaysia wurde nach den Parlamentswahlen die Duration am langen Ende der Kurve erhöht.

Gegen Ende des Berichtszeitraums hielt der Fonds in einer Reihe von Ländern übergewichtete Positionen. Hierzu zählten Brasilien aufgrund hoher Realrenditen und einer sinkenden Inflation, Mexiko aufgrund hoher Realrenditen (ex-ante) und attraktiver Spreads gegenüber US-Staatsanleihen, Kolumbien wegen des Ausblicks auf weniger politische Risiken im neuen Jahr, Ungarn infolge des potenziellen Katalysators in Bezug auf unterstützende Finanzmittel der EU und Südafrika wegen einer nachlassenden Inflation, positiver Realrenditen und einer steilen Renditekurve. Der Fondsmanager setzte tendenziell verstärkt auf lokale Zinssätze und Währungsrisiken in günstiger bewerteten Bereichen, da er davon ausging, dass die Inflation in ausgewählten Schwellenländern, darunter Brasilien, allmählich nachlässt. Darüber hinaus erachtete sie einige Schwellenländer wie Brasilien und Mexiko als attraktiv. Südafrika und Kolumbien erschienen ebenfalls ansprechend. Mit Blick auf die Zukunft wird der Fondsmanager bestrebt sein, sein Engagement in Zinsinstrumenten weiter zu erhöhen, indem er ausgewählte Untergewichtungen (z. B. Malaysia) reduziert.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -13,48 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit -13,15 % 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). Der Fonds lieferte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Die negative Rendite war durch eine Übergewichtung in der Ukraine, eine Untergewichtung in der Türkei und eine Übergewichtung in Mexiko bedingt. Die Positionierung des Fonds in Hartwährungsanleihen und die diesbezügliche Durationsposition wirkten sich positiv aus. Bei den Währungen brachten vor allem die Übergewichtung des russischen Rubel und eine Untergewichtung der türkischen Lira, der indonesischen Rupiah, des neuen Taiwan-Dollar und des rumänischen Leu Gewinne, die jedoch teilweise durch Verluste aus übergewichteten Positionen im ungarischen Forint und im chilenischen Peso zunichtegemacht wurde. Den stärksten positiven Beitrag auf Länderebene leisteten die Übergewichtung Russlands, die Untergewichtung Pakistans und der Kassenbestand.

Der Fonds verringerte das aktive Risiko im Bereich der lokalen Zinssätze geringfügig. Bei Schwellenländerwährungen wurden die Long-Positionen im kolumbianischen Peso verringert und die Untergewichtung im peruanischen Sol und im rumänischen Leu erhöht. Ferner wurde eine Relative-Value-Position mit Long-Engagement im südafrikanischen Rand im Verhältnis zum mexikanischen Peso hinzugefügt. Dieser Entscheidung lagen sowohl bewertungsbezogene als auch zyklische Faktoren zugrunde. Im dritten Quartal vergrößerte der Fonds die Positionen in südafrikanischen und mexikanischen Lokalwährungsanleihen. Darüber hinaus löste der Fonds einige Relative-Value-Trades auf, mit denen eine Long-Position in der indischen Rupie auf „neutral“ verringert wurde, minimierte den Umfang einer Short-Position im chinesischen Renminbi auf die Hälfte und fügte eine übergewichtete Position im chilenischen Peso hinzu. Ferner nahm der Fonds eine Position in koreanischen Anleihen auf. In Malaysia wurde die Duration am langen Ende der Kurve erhöht. Zum Jahresende wies der Fonds strukturelle Übergewichtungen in Brasilien, Mexiko, Kolumbien, Ungarn und Südafrika auf.

Bei den Hartwährungsanleihen reduzierte der Fondsmanager zu Beginn des Jahres sein Engagement in Russland und der Ukraine. Länder wie Argentinien und Panama stockte er stattdessen leicht auf. Hinzugefügt wurden Neuemissionen aus Bulgarien und Rumänien. Der Fondsmanager trennte sich nach einer starken Outperformance von den Fondsbeteiligungen an quasi-staatlichen Unternehmen in China (Sinopec und State Grid Corporation of China) und Chile (Codelco). Neu eröffnet wurde eine Position in Alibaba.

Das Risiko bezogen auf Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating wurde gegen Jahresende verringert. Im Einzelnen wurden Gewinne bei auf den Euro lautenden Positionen in Estland, Litauen und Bulgarien, Positionen in Polen, auf den Philippinen, in Mexiko und der Elfenbeinküste sowie Positionen in der Dominikanischen Republik mitgenommen. Mit den Erlösen wurden die Fondsbeteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating erhöht, bei denen gutes Wertpotenzial identifiziert wurde. Zudem trennte sich der Fondsmanager von Gazprom, nachdem sich die Preise für russische Vermögenswerte von einem sehr schlechten Niveau zu Beginn des Jahres erholt hatten, und wegen der anhaltenden Risiken im Zusammenhang mit dem Krieg in der Ukraine. Und schließlich wurde eine Position in Ägypten verkauft.

Der Fonds gewichtet Schwellenländeranleihen weiterhin über, in erster Linie durch Engagements in Hochzinsanleihen. Aus Sektorperspektive war der Fonds in quasi-staatlichen Schuldtiteln und Unternehmensanleihen weiterhin über- und in Staatsanleihen auf Durationsbasis insgesamt untergewichtet.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc) des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -16,03 %, verglichen mit -13,93 % 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) und -12,05 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global-Bond Emerging Markets Global LC.

Der Fonds erzielte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert und dem Sektordurchschnitt zurück.

Für Anleger in Schwellenländeranleihen war das Jahr schwierig. Der Krieg in der Ukraine, die rasante Inflation, die steigenden Zinsen, der starke US-Dollar, das nachlassende Wirtschaftswachstum und die restriktive Null-Covid-Politik Chinas belasteten allesamt die Renditen. Die Marktvolatilität war erhöht, da sich die Anleger schwertaten, den erheblich veränderten wirtschaftlichen und geopolitischen Bedingungen Rechnung zu tragen.

Auf Länderebene wurde die Performance vor allem durch die Fondspositionen in der Ukraine und in China beeinträchtigt. Besonders volatil waren nach dem russischen Einmarsch ukrainische Anlagewerte. Die chinesische Wirtschaft litt dagegen unter den restriktiven Maßnahmen, mit denen eine Ausbreitung des Infektionsgeschehens durch Covid-19 verhindert werden sollten. Die Positionen des Fonds in Unternehmensanleihen minderten die Rendite ebenfalls.

Nach einem schwierigen Start schnitt die Fondsposition in Lokalwährungsanleihen in der zweiten Jahreshälfte allmählich besser ab. Das übergewichtete Engagement in Russland erwies sich im Berichtszeitraum als gewinnbringend. Darüber hinaus profitierte das Währungsengagement des Fonds von einer Übergewichtung des Rubel, der im Verlauf des Jahres aufwertete.

Der Fondsmanager des Fonds startete mit relativ positiven Einschätzungen zu hochverzinslichen Staatsanleihen und lokalen Schwellenländerzinssätzen ins Jahr. Die Zinsen in Industrieländern beurteilte er indes skeptischer. Gegen Ende des Jahres verringerte der Fondsmanager sein Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen, blieb in der Anlageklasse aber durch Engagement in Hochzinsanleihen übergewichtet. Aufgrund der hohen Realrenditen und der nachlassenden Inflation hielt der Fonds eine strukturell übergewichtete Position in Brasilien. Die Präferenz des Fondsmanagers galt „Quasi-Staatsanleihen“ oder Unternehmensanleihen in Ländern wie Marokko und Mexiko. Im Währungssegment behielt der Fonds übergewichtete Positionen im thailändischen Baht, im südkoreanischen Won und im südafrikanischen Rand bei.

Mit Blick auf 2023 schätzt der Fondsmanager die Aussichten für Anleihen der Schwellenländer konstruktiver ein. Da sich die globale Inflation allmählich abzuschwächen scheint, könnten die Zentralbanken damit beginnen, das Tempo ihrer Zinserhöhungen zu drosseln, oder ihre Straffungsinitiativen sogar vorerst aussetzen. Dies würde für festverzinsliche Anlagen ein günstigeres Umfeld schaffen. Zudem

könnte die Wiederöffnung der chinesischen Wirtschaft nach dem Ausstieg aus der Null-Covid-Strategie der Regierung das globale Wachstum ankurbeln.

Abgesehen von diesem makroökonomischen Rückenwind nehmen sich die Bewertungen von hochverzinslichen Staatsanleihen im Vergleich zu ihren Investment-Grade-Pendants nach Ansicht des Fondsmanagers attraktiv aus. Daher könnte die Anlageklasse 2023 von starken Renditen profitieren.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -16,95 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index eine Rendite von -17,17 %. Der Fonds erzielte nach Abzug von Gebühren eine negative Rendite, übertraf aber seinen Referenzwert.

Das Jahr 2022 war für die Anleger schwierig, da sowohl Aktien als auch Anleihen in einem Umfeld steigender Zinssätze und einer galoppierenden Inflation ins Straucheln gerieten. Die Marktvolatilität war während des gesamten Berichtszeitraums erhöht.

Angesichts steigender Anleiherenditen infolge von höheren Zinssätzen wurden Staats- und Unternehmensanleihen im ersten Halbjahr abgestoßen. Die Anleger trennten sich von risikoreicheren Anlagen, was an den Märkten für Hochzinsanleihen zu einer relativen Underperformance führte. In der zweiten Jahreshälfte blieb das Marktumfeld volatil, denn die Inflations Sorgen nahmen weiter zu. Im Oktober und November erholten sich die Anleihemärkte teilweise. Diese Entwicklung war jedoch nicht von Dauer, da die Anleiherenditen im Dezember wieder deutlich anstiegen.

Die Wertpapierauswahl lieferte den größten positiven Performancebeitrag. Finanztitel wie Allianz, Credit Suisse und Raiffeisen Bank stachen im Berichtszeitraum durch ihre positive Wertentwicklung hervor. Ein weiterer wesentlicher Performance-Treiber war im Berichtsjahr die Duration (ein Maß für die Zinssensitivität). Ein Großteil dieser Performance konzentrierte sich auf das dritte Quartal, als der Fonds eine Short-Position in fünfjährigen Bundesanleihen hielt, die sich als renditeträchtig erwies.

Die übergewichtete Position des Fonds im Kreditrisiko war für die Wertentwicklung im größten Teil des Jahres von Nachteil, weil sich die Kreditspreads weiteten. Allerdings wurden einige dieser Verluste im Schlussquartal wieder hereingeholt, als sich das Kreditumfeld verbesserte. Letztlich war die Kreditstrategie des Fonds für die relative Outperformance hauptverantwortlich.

In der ersten Jahreshälfte erhöhte der Fondsmanager die kurze Durationsposition sowie die Allokation in hochverzinslichen Unternehmensanleihen. Das Engagement in den Schwellenländern wurde ebenfalls leicht aufgestockt. Im dritten Quartal behielt der Fonds seine kurze Durationsposition sowie seine

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND Forts.

übergewichtete Kreditrisikoposition bei. Zu diesem Zweck wurde unter anderem eine Neuemission der Raiffeisen Bank zugekauft. Im Schlussquartal löste der Fonds Long-Positionen in belgischen und deutschen Staatsanleihen auf und verringerte nach einer starken Rallye bei europäischen Investment-Grade-Anleihen das Kreditrisiko. Ferner blieb der Fonds in Banken und Versorgern übergewichtet, während er den Subsektor Nahrungsmittel und Getränke sowie zyklische Konsumgütertitel untergewichtete.

Mit Blick auf die Zukunft beurteilt der Fondsmanager die Kreditmärkte aufgrund attraktiver Bewertungen aus taktischer Sicht positiv, obwohl für das kommende Jahr mit weiter nachlassendem globalem Wachstum gerechnet wird. Der Fondsmanager hat den Fonds für ein Ende der Zinserhöhungen 2023 positioniert, räumt aber ein, dass die darauf folgenden Zinssenkungen langsamer erfolgen könnten als von den Marktteilnehmern offenbar aktuell eingepreist. Nach den Entwicklungen des Jahres 2022 bleibt der Fondsmanager skeptisch, was die Wirtschafts- und Marktrisiken einschließlich des anhaltenden Kriegs in der Ukraine betrifft.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -14,56 %, verglichen mit -14,17 % für den Markt iBoxx Euro Corporates Index TR und -13,59 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global Bond EUR Corporates (alle Angaben in Euro).

Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb sowohl hinter seinem Referenzwert als auch hinter dem Sektordurchschnitt zurück.

Der wichtigste Faktor für das Marktgeschehen war 2022 die Straffung der Geldpolitik durch die Zentralbanken infolge der zunehmenden Inflation. Die Unsicherheit nahm zu, als das Marktvertrauen durch wiederholte Volatilitätsschübe untergraben wurde.

In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums sind die Anleiherenditen stark gestiegen, wobei sowohl Staats- als auch Unternehmensanleihen auf die Inflationssorgen negativ reagierten. Besonders schwach zeigten sich die Märkte für Hochzinsanleihen, da die Anleger im Vergleich risikoreichere Anlagen abstießen. In der zweiten Jahreshälfte hielt die Volatilität infolge der anhaltenden Straffung der Geldpolitik an. Die Anleihemärkte erlebten im Oktober und November eine Rallye, allerdings kehrte sich diese im Dezember infolge weiterer Zinserhöhungen der Zentralbanken in den Industrieländern wieder um.

Die Titelauswahl lieferte den größten positiven Performancebeitrag im Berichtszeitraum. Während der ersten Jahreshälfte trieben vor allem Energiewerte wie Gazprom und EDF neben den Immobilienwerten Balder Group und Aroundtown die Wertentwicklung an. Die Titelauswahl war auch im dritten Quartal vorteilhaft. Insbesondere die Raiffeisen Bank wirkte sich im September positiv aus.

Der Fondsmanager eröffnete zu Beginn des Berichtszeitraums eine Long-Position in Bezug auf das Kreditrisiko. Er ging davon aus, dass ein über dem Trend liegendes Wachstum und solide Fundamentaldaten zu einer Verengung der Spreads führen würden. Im Juli und während des vierten Quartals profitierte der Fonds von dieser Positionierung. Letztlich belastete die Übergewichtung im Kreditrisiko aber die jährliche Gesamtperformance, da sich die Spreads vor allem in der ersten Jahreshälfte weiteten. Ertragsmindernd wirkte auch die Währungsposition des Fonds, insbesondere im Juli.

Bei der Anlagetätigkeit verfolgte der Fonds im Berichtszeitraum einen aktiven, aber selektiven Ansatz mit Aktivitäten in verschiedenen Sektoren an den Primär- und Sekundärmärkten. In der ersten Jahreshälfte fügte der Fonds einige Positionen hinzu, darunter Allianz, Bank of America und Banco Sabadell. Außerdem stützte der Fondsmanager die Bestände in Medtronic, FedEx und Barclays. In der zweiten Jahreshälfte verringerte der Fondsmanager die Fondsduration leicht, blieb aber im Kreditrisiko übergewichtet positioniert und engagierte sich an den Primär- und Sekundärmärkten verstärkt in Finanztiteln. Zum Jahresende gewichtete der Fonds vorrangige Bank- und Versorgungstitel über und Automobil- sowie zyklische Konsumgütertitel unter.

Der Fonds ist für das kommende Jahr auf eine allgemeine Abschwächung des globalen Wachstums ausgerichtet. Allerdings beurteilt der Fondsmanager die Kreditmärkte aufgrund allem Anschein nach attraktiver Bewertungen aus taktischer Sicht positiv. Die Gesamtinflation dürfte zwar zurückgehen, doch ist unsicher, wie stark. Der Fondsmanager geht davon aus, dass die Zinssätze im Jahr 2023 ihren Höchststand erreichen werden, glaubt aber, dass eine anschließende Zinssenkung langsamer vorstattengehen wird, als derzeit offenbar vom Markt eingepreist. Wie das Jahr 2022 gezeigt hat, können unerwartete Ereignisse zu Turbulenzen in der Wirtschaft und an den Märkten führen. Folglich wird der Fondsmanager die Situation in der Ukraine sowie die Spannungen zwischen China und Taiwan weiterhin genau im Auge behalten.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD C des Fonds verzeichnete im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -15,99 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -13,41 % für seinen individuellen Referenzwert, der sich zu 50 % aus steuerpflichtigen und 50 % aus steuerbefreiten US-Kommunalanleihen zusammensetzt. Der Fonds verbuchte eine negative Rendite und blieb hinter seinem Referenzwert zurück.

Das Jahr 2022 war für die Anleger schwierig, da die Zinssätze weltweit als Reaktion auf die sprunghaft steigende Inflation angehoben wurden. Festverzinsliche Wertpapiere, darunter US-Kommunalanleihen, die auf bundesstaatlicher und kommunaler Ebene von Behörden begeben werden, zeigten Schwäche, denn die Marktteilnehmer mussten die erhöhte Marktvolatilität und die Weitung der Kreditspreads verkraften. Unterdessen waren die Neuemissionen bei Kommunalanleihen im Berichtszeitraum gering.

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

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

Während des Berichtsjahres war die Durations- und Zinspositionierung des Fonds für die Wertentwicklung von Nachteil, da die Zentralbanken im Kampf gegen die Inflation die Zinsen erhöhten. Die übergewichtete Position des Fonds in steuerpflichtigen Kommunalanleihen sorgte weiterhin für Erträge, minderte die relative Rendite insgesamt aber wegen der längeren Duration dieser Schuldtitel. Darüber hinaus belastete die Durationspositionierung des Fonds in Kommunalanleihen die relative Wertentwicklung, insbesondere durch Titel mit mittleren Laufzeiten (3-10 Jahre).

Hauptverantwortlich für die positive relative Performance war über weite Strecken des Jahres die Titelauswahl. Die Positionierung des Fonds auf der Renditekurve in mittelfristigen steuerbefreiten Kommunalanleihen belastete im dritten Quartal, erwies sich aber im Schlussquartal des Jahres als vorteilhaft. Die Sektorallokation beflügelte die Wertentwicklung im ersten, zweiten und vierten Quartal, sorgte im dritten Quartal allerdings für Gegenwind.

Im Hinblick auf die Positionierung belief sich das Engagement des Fonds in steuerbefreiten Wertpapieren zum Jahresende auf rund 27,1%. Der Rest des Fondsvermögens war in steuerpflichtigen Kommunalanleihen, gemeinnützigen Unternehmensemittenten und Barmitteln investiert. Das Risiko konzentrierte sich in erster Linie auf die Fondspositionierung bezüglich der Zinsen und der Renditekurve sowie auf ein übergewichtetes Engagement in steuerpflichtigen Instrumenten.

Der Fonds bevorzugte weiterhin Revenue Bonds, und zum Jahresende hielt er zu fast 80,5 % diese Titel, gegenüber 68,6 % im Referenzwert. Unter anderem in den Subsektoren Krankenhäuser, Transport und Flughäfen war der Fonds übergewichtet. Der Fondsmanager ist der Auffassung, dass diese Sektoren auch weiterhin von der starken Binnenkonjunktur in den USA profitieren werden, da gut aufgestellte Emittenten vor der Pandemie über eine hohe Liquidität verfügten.

Zum Jahresende machten die größten fünf Positionen in staatlichen Titeln rund 50 % des Fonds aus. Sie bestanden aus Anleiheemittenten innerhalb von Kalifornien, New York, Florida, Texas und Illinois. Der Fonds hatte eine etwas längere Duration als der Referenzwert. Die durchschnittliche Kreditqualität des Portfolios betrug unterdessen A+, verglichen mit dem gewichteten durchschnittlichen Kreditrating des Referenzwerts von AA-. Die Kosten der Währungsabsicherung im Fonds sind gestiegen, denn die geldpolitische Straffung durch die US-Notenbank sorgte für ein höheres Zinsgefälle zwischen dem US-Dollar und anderen Währungen.

Der Fondsmanager glaubt, dass steuerpflichtige Kommunalanleihen für internationale Anleger auch im kommenden Jahr attraktiv bleiben, wenn sich die Renditeabstände im Laufe der Zeit verengen. Die hervorragende Kreditqualität der Anlageklasse bedeutet, dass Kommunalanleihen gut positioniert sind, um dem Druck einer Konjunkturabschwächung standzuhalten.

Insight North America LLC
Januar 2023

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro W (Acc) des Fonds generierte im zwölfmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -13,54 % nach Abzug von Gebühren, verglichen mit einer Rendite von -13,65 % für den Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporates Index TR und -13,59 % für den Sektordurchschnitt des Lipper Global - Bond EUR Corporates (alle Angaben in Euro). Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber seinen Referenzwert und den Sektordurchschnitt.

Im historischen Vergleich zeigten die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere 2022 Schwäche, da die Anleihen weltweit erstmals seit 70 Jahren in Bärenmarkt-Territorium zurückfielen. Im Zentrum der Anlegerbedenken stand die Inflationsentwicklung, nachdem maßgebliche Zentralbanken als Reaktion auf steigende Preise die Zinsen erhöhten. In der Folge tendierten die Renditen auf Staatsanleihen und die Spreads von Unternehmensanleihen volatil.

Die Titelauswahl lieferte den größten Beitrag zur relativen Outperformance. Zu den Spitzenreitern gehörten Long-Positionen in Verizon (Telekommunikation) und Fidelidade (Versicherungen). Neuemissionen von Versorgern, darunter Western Power, Amprion und Vier Gas, schnitten ebenfalls gut ab. In der ersten Jahreshälfte wirkten sich eine übergewichtete Position in Finanzwerten sowie eine untergewichtete Position im Tabaksektor positiv aus. Die kurze Duration und die Positionierung auf der Renditekurve waren der Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzwert ebenfalls zuträglich, weil die Anleiherenditen im dritten Quartal stiegen. Im vierten Quartal leistete das übergewichtete Kreditrisiko im Fonds einen positiven Beitrag zur relativen Performance, als sich die Kreditspreads verengten.

Eine übergewichtete Position im Telekommunikationssektor und eine untergewichtete Position in Automobiltiteln schmälerten die relative Performance hingegen. Die Schwäche in diesem Sektor hielt auch im dritten Quartal an, vor allem im Juli, als die übergewichtete Fondsposition in Versorgern und nachrangigen Versicherungstiteln sowie die Untergewichtung im Bereich Lebensmittel und Getränke zu negativen Renditen führten. Obschon die Wertpapierauswahl im Jahresverlauf den größten Positivbeitrag zur Rendite leistete, schmälerte sie die Performance im vierten Quartal, vor allem im November aufgrund von Positionen in Credit Suisse und Fidelidade.

In der ersten Hälfte des Berichtsjahres beteiligte sich der Fondsmanager an einigen Neuemissionen, darunter Virgin Money, Euronext, Barclays, SBB, Eni und Coca-Cola, um nur einige Beispiele zu nennen. Ferner erwarb der Fondsmanager grüne Anleihen des Versorgers Enxsis sowie von Sabadell, Bank of Ireland und UniCredit aus dem Finanzsektor und ebenso Nachhaltigkeitsanleihen von FedEx (mit Zielen in Bezug auf Fahrzeugelektrifizierung, nachhaltigen Treibstoff und natürliche Kohlenstoffspeicherung). Im dritten Quartal verkaufte der Fonds Anleihen, die als überbewertet erachtet wurden, um neue Positionen auf dem Primär- und Sekundärmarkt einzugehen, etwa in Emissionen von SSE (britischer Energieversorger) und RBI (österreichische Bank). Gegen Ende des Jahres nahm der Fonds infolge der besseren Anlegerstimmung mehrere Neuemissionen aus nichtzyklischen Sektoren und dem Finanzsektor in das Portfolio auf.

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND Forts.

Per Ende Dezember 2022 waren 25,4 % des Fonds in Positive Impact Bonds investiert (gegenüber einem Anteil von 17,8 % im Referenzwert). Allgemein beträgt der gewichtete Durchschnitts-Score für Umwelt, Soziales und Corporate Governance (ESG) 1,8 gegenüber einem Score von 1,9 für den Referenzwert. Je niedriger der Score innerhalb einer Spanne von 1 bis 5, desto besser die ESG-Performance. Außerdem beträgt die CO₂-Intensität des Fonds 53,3 % des Index-Score (die CO₂-Intensität misst, wie viel Kohlendioxid Emittenten im Verhältnis zum Umsatz erzeugen).

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

RESPONSIBLE HORIZONS EURO IMPACT BOND FUND

Seit Fondsauflegung am 10. Januar 2022 erzielte die Anteilsklasse Euro W (Acc) eine Rendite von -13,79% nach Abzug von Gebühren, verglichen mit -14,40% für den Bloomberg Euro Green Bond Index: Corporate. Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber seinen Referenzwert.

2022 war für festverzinsliche Wertpapiere ein historisch schwaches Jahr, da die Anleihen weltweit erstmals seit 70 Jahren in Bärenmarkt-Territorium zurückfielen. Im Zentrum der Anlegerbedenken stand die Inflationsentwicklung, da maßgebliche Zentralbanken als Reaktion auf steigende Verbraucherpreise die Zinsen erhöhten. Folglich verzeichneten die Renditen auf Staatsanleihen und die Spreads von Unternehmensanleihen im Berichtsjahr eine außergewöhnlich hohe Volatilität. Obschon das Jahr zumeist von einer kontinuierlichen Ausweitung der Spreads geprägt war, kam es im vierten Quartal aufgrund rückläufiger Energiepreise und der Hoffnung, das Tempo der Zinserhöhungen könnte nachlassen, zu einer markanten Wende.

Die übergewichteten Positionen des Fonds in Versorgung und im Gesundheitswesen leisteten einen positiven Beitrag, denn die Anleger wussten die defensiven Qualitäten dieser Sektoren sehr zu schätzen. Die Fondsanlagen im Telekommunikationssektor steigerten die Performance ebenfalls, da die Anleger in einem derart unsicheren wirtschaftlichen Umfeld die Widerstandsfähigkeit dieses Sektors bevorzugten. Der Fonds wies ferner eine niedrige relative Gewichtung in Immobilienwerten auf, was sich als klug erwies, denn der Sektor litt unter den steigenden Zinssätzen und einzeltitelspezifischen Berichten zu Bedenken über die Unternehmensführung.

Die Positionierung des Fonds in Bezug auf das Kreditrisiko leistete den größten Negativbeitrag zur Performance. Ein übergewichtetes Engagement erwies sich als schädlich, da sich die Kreditspreads als Reaktion auf die sprunghaft ansteigende Inflation und das zunehmende Rezessionsrisiko weiteten.

Banken und Versorger waren im vergangenen Jahr die Hauptemittenten „grüner Anleihen“ (Anleihen, die zur Kapitalbeschaffung für Klima- und Umweltprojekte begeben werden). Die hohe Verfügbarkeit von qualitativ hochwertigen Gelegenheiten für wirkungsorientierte Investitionen führte dazu, dass der Fonds ein erhebliches Engagement in beiden Bereichen aufbaute. Zum Jahresende war das italienische Versorgungsunternehmen Enel die größte Portfolioposition. Darüber hinaus eröffnete der Fonds Positionen in großen Banken, darunter HSBC, Credit Agricole, Commerzbank und Credit Suisse.

Dabei ist das Angebot von grünen Anleihen im Immobiliensektor deutlich zurückgegangen, Immobilien stellten den drittgrößten Sektor innerhalb des Portfolios. sodass sich in diesem Bereich mittlerweile nur mehr schwer Gelegenheiten ausfindig machen lassen.

Per Ende Dezember 2022 waren 93,1 % des Fonds in Positive Impact Bonds und deren Emittenten angelegt. Für eine breite Wirkung investiert der Fonds in verschiedene Arten von Instrumenten: So wurden 76,9 % des Fonds in grünen Anleihen, 7,9 % in Sozialanleihen und schließlich 1,8 % in Nachhaltigkeitsanleihen angelegt (bei denen es sich auch um Use of Proceeds Bonds im Rahmen ökologischer und sozialer Projekte handelt, d.h. Anleihen mit Zweckbindung der Emissionserlöse). Die Gesamtallokation des Fonds in Impact-Anleihen belief sich somit auf 86,6 %. Abgesehen davon zielt der Fonds auch auf Investitionen in Emittenten mit positiver Wirkung ab. Hierbei handelt es sich um Unternehmen mit Geschäftsaktivitäten, die erheblich (zu mehr als 50 % der Umsätze) auf eine positive Wirkung ausgerichtet sind. Die Fondsallokation in diesem Segment belief sich auf 6,5 %.

Der Fondsmanager schätzt den Ausblick für Impact-Anleihen nach wie vor positiv ein, auch wenn im letzten Jahr erstmals ein Rückgang des Gesamtangebots dieser Art von Anlagewerten zu verzeichnen war. Zurückzuführen war dies größtenteils auf das generell geringere Emissionsgeschehen bei Unternehmensanleihen und weniger auf eine mangelnde Bereitschaft der Unternehmen, grüne Anleihen zu begeben, oder auf fehlendes Kaufinteresse der Anleger. Der Fondsmanager entdeckt weiterhin neue Sektoren und Emittenten auf dem Markt, etwa im Automobilsektor, um mit den Erlösen die Elektrifizierung voranzutreiben, und bei Verpackungsunternehmen, die das Wachstum der Kreislaufwirtschaft unterstützen. Nach Einschätzung des Fondsmanagers dürften die stetig zunehmende Nachfrage der Anleger und ein entgegenkommendes regulatorisches Umfeld den Markt auch künftig unterstützen.

Insight Investment Management (Global) Limited Januar 2023

Alle Daten von Lipper, Stand: 31. Dezember 2022. 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.

** Siehe Erläuterung 20 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 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 30.778.339			
(31. Dezember 2021: 38.545.235)			
26.502.550	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund A	30.778.339	9,18
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		30.778.339	9,18
Anleihen			
Australien - 23.389.985			
(31. Dezember 2021: 15.540.661)			
500.000	AFG 2021-2 Trust '2021-2 B' FRN 4.310% 10-Mar-2053	310.577	0,09
2.458.000	Commonwealth Bank of Australia 'REGS' FRN 3.610% 12-Sep-2034	1.911.422	0,57
1.632.733	Firstmac Mortgage Funding Trust No. 4 Series 2-2020 '2020-2 A2' FRN 4.910% 16-Jan-2052	1.039.617	0,31
472.693	Flexi ABS Trust 2021-2 '2021-2 C' FRN 4.510% 12-Aug-2027	290.639	0,09
159.722	Interstar Millennium Series 2006-1 Trust '2006-1 A' FRN 3.435% 27-Mar-2038	94.790	0,03
133.859	Interstar Millennium Series 2006-4H Trust '2006-4H A2' FRN 3.507% 07-Nov-2039	76.971	0,02
451.275	Latitude Australia Personal Loans Series 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 4.462% 17-Apr-2030	281.625	0,08
582.000	Liberty Series 2021-1 SME '2021-1SME C' FRN 4.910% 10-Nov-2053	368.943	0,11
2.794.023	Liberty Series 2022-1 '2022-1 A1' FRN 3.960% 10-Dec-2053	1.757.075	0,52
2.000.000	Mortgage House RMBS Series 2022-2 '2022-2 A2' FRN 5.021% 14-Dec-2053	1.273.693	0,38
3.215.000	National Australia Bank Ltd 'REGS' FRN 3.933% 02-Aug-2034	2.548.455	0,76
700.000	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 5.068% 22-Jan-2053	440.024	0,13
2.670.000	Pepper I-Prime 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 4.410% 15-Jul-2053	1.651.793	0,49
2.500.000	Pepper Residential Securities Trust No 34 FRN 4.760% 12-Dec-2063	1.594.822	0,48
1.000.000	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 4.810% 15-Jan-2063	619.356	0,18
353.689	Pepper Residential Securities Trust No. 31 FRN 4.223% 23-Apr-2063	221.588	0,07
1.254.618	Pepper Residential Securities Trust No32 FRN 4.923% 23-Jul-2063	791.678	0,24
1.130.000	Resimac Bastille Trust Series 2021-2NC '2021-2NCX C' FRN 4.706% 03-Feb-2053	688.939	0,21
708.000	Ruby Bond Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 4.510% 12-Mar-2053	437.001	0,13
1.635.000	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 5.010% 15-Jun-2052	1.023.440	0,31
770.000	Think Tank Residential Series 2021-2 Trust '2021-2 C' FRN 4.760% 10-Mar-2054	472.392	0,14
2.700.000	Think Tank Residential Series 2022-2 '2022-2 A2' FRN 5.410% 10-Jun-2054	1.715.331	0,51
810.000	Triton Bond Trust 2022-1 in respect of Series 1 '2022-1 C' FRN 4.760% 11-Sep-2053	485.293	0,15
3.000.000	Triton Bond Trust 2022-3 in respect of Series 1 '2022-3 A2' FRN 4.910% 10-Apr-2054	1.908.510	0,57
1.721.000	Westpac Banking Corp FRN 4.110% 24-Jul-2034	1.386.011	0,41
Österreich - 5.105.379			
(31. Dezember 2021: 5.850.765)			
100.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0.050% 01-Sep-2027	80.279	0,02
2.000.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 5.750% 27-Jan-2028	2.052.910	0,61
1.800.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	1.479.690	0,44
1.500.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	1.492.500	0,45
Belgien - 1.105.572			
(31. Dezember 2021: 694.143)			
600.000	Ethias SA 5.000% 14-Jan-2026	583.728	0,17
600.000	KBC Group NV FRN (Perpetual) 4.250% 24-Oct-2171	521.844	0,16

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Brasilien - 4.256.539			
(31. Dezember 2021: 4.483.106)			
20.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	3.396.727	1,01
5.400.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	859.812	0,26
Chile - 112.248			
(31. Dezember 2021: 1.582.969)			
150.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	112.248	0,03
China - 665.638			
(31. Dezember 2021: 15.989.082)			
900.000	China Government Bond 3.020% 27-May-2031	122.730	0,04
3.900.000	China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030	542.908	0,16
Kolumbien - 1.557.012			
(31. Dezember 2021: 1.954.448)			
450.000	Colombia Government International Bond 3.875% 25-Apr-2027	374.702	0,11
880.500.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	127.296	0,04
3.324.600.000	Colombian TES 7.250% 18-Oct-2034	423.565	0,13
2.100.000.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	307.240	0,09
2.233.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	324.209	0,10
Zypern - 207.715			
(31. Dezember 2021: 1.107.760)			
240.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	207.715	0,06
Ecuador - 162.493			
(31. Dezember 2021: -)			
268.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	162.493	0,05
Frankreich - 9.017.822			
(31. Dezember 2021: 16.636.121)			
1.800.000	BNP Paribas SA FRN (Perpetual) 6.875% 06-Jun-2171	1.784.295	0,53
2.600.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Jun-2171	2.033.226	0,61
900.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031	781.834	0,23
100.000	La Banque Postale SA FRN 5.500% 05-Mar-2034	98.375	0,03
1.300.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	1.171.398	0,35
250.000	Parts Europe SA 'REGS' FRN 5.456% 20-Jul-2027	242.769	0,07
685.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Perpetual) 4.750% 26-Nov-2171	546.896	0,16
2.300.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	2.359.029	0,71
Deutschland - 113.031.554			
(31. Dezember 2021: 42.455.945)			
17.000.000	Bundesobligation 0.000% 14-Apr-2023-	16.900.805	5,04
5.826.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2023	5.822.854	1,74
15.000.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2023	14.968.950	4,47
21.370.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Mar-2023	21.291.145	6,35
17.500.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-May-2023	17.368.400	5,18
17.000.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Jun-2023	16.836.800	5,02
15.000.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	14.730.450	4,40
2.500.000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 4.000% 31-Jan-2028	2.172.375	0,65
1.500.000	Vonovia Finance BV 2.250% 07-Apr-2030	1.232.948	0,37
2.100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029	1.544.301	0,46
200.000	Wintershall Dea Finance BV 1.332% 25-Sep-2028	162.526	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Ghana - 72.391			
(31. Dezember 2021: 298.838)			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 0.000% 11-Feb-2027	72.391	0,02
Ungarn - 713.401			
(31. Dezember 2021: -)			
236.800.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	397.298	0,12
238.500.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	316.103	0,09
Indonesien - 483.078			
(31. Dezember 2021: 305.984)			
7.200.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	483.078	0,14
Irland - 12.301.125			
(31. Dezember 2021: 12.160.963)			
483.358	Atom Mortgage Securities DAC FRN 4.326% 22-Jul-2031	490.250	0,15
913.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6.750% 01-Mar-2033	909.777	0,27
319.124	Berg Finance 2021 DAC '2021-1 B' FRN 2.952% 22-Apr-2033	299.249	0,09
56.930	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 4.894% 24-Feb-2058	54.092	0,01
800.000	Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC FRN 3.191% 18-Oct-2030	789.597	0,23
620.221	Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC FRN 3.195% 17-Aug-2033	557.999	0,17
137.972	Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 3.395% 17-Aug-2031	125.831	0,04
1.427.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	1.366.766	0,41
650.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	529.935	0,16
553.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 5.250% 30-Jun-2025	531.494	0,16
291.558	Portman Square 2021-NPL1 DAC '2021-NPL1X A' FRN 3.577% 25-Oct-2061	289.342	0,09
558.953	Rathlin Residential 2021-1 DAC '2021-1X A' FRN 3.038% 27-Sep-2075	508.878	0,15
163.932	Retiro Mortgage Securities DAC FRN 3.578% 30-Jul-2075	163.320	0,05
2.820.000	Shamrock Residential 2021-1 DAC '2021-1 B' FRN 3.294% 24-Dec-2059	2.780.540	0,83
131.038	Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 4.901% 17-May-2031	135.470	0,04
422.753	Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 3.881% 22-Dec-2030	398.854	0,12
796.428	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 5.001% 17-Aug-2031	821.219	0,24
1.400.000	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 4.176% 22-Jul-2029	1.548.512	0,46
Italien - 1.302.888			
(31. Dezember 2021: 15.746.026)			
400.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025	389.200	0,12
901.000	Enel Finance International NV '144A' 7.750% 14-Oct-2052	913.688	0,27
Japan - 4.939.153			
(31. Dezember 2021: 23.853.958)			
870.000.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051	4.939.153	1,47
Luxemburg - 165.947			
(31. Dezember 2021: 254.805)			
247.328	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	165.947	0,05
Mexiko - 4.936.691			
(31. Dezember 2021: 4.200.151)			
40.000.000	Mexican Bonos 5.000% 06-Mar-2025	1.740.114	0,52
58.069.400	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	2.526.240	0,75
8.500.000	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	385.580	0,12
400.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	284.757	0,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Niederlande - 8.503.785			
(31. Dezember 2021: 4.610.321)			
1.104.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	1.113.787	0,33
3.615.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	3.070.943	0,92
931.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	878.398	0,26
3.135.000	LeasePlan Corp NV FRN (Perpetual) 7.375% 29-Nov-2171	3.113.055	0,93
451.747	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	327.602	0,10
Neuseeland - 11.547.416			
(31. Dezember 2021: 1.032.229)			
12.160.000	New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	6.655.691	1,99
8.418.000	New Zealand Government Bond 4.250% 15-May-2034	4.891.725	1,46
Panama - 200.763			
(31. Dezember 2021: -)			
300.000	Panama Government International Bond 4.500% 19-Jan-2063	200.763	0,06
Republik Korea - 7.387.300			
(31. Dezember 2021: -)			
11.000.000.000	Korea Treasury Bond 3.125% 10-Sep-2052	7.387.300	2,20
Republik Serbien - 141.674			
(31. Dezember 2021: 229.222)			
250.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	141.674	0,04
Rumänien - 955.876			
(31. Dezember 2021: 528.753)			
2.500.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	470.197	0,14
340.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.125% 07-Mar-2028	284.134	0,09
200.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	201.545	0,06
Russland - 189.783			
(31. Dezember 2021: 2.171.295)			
45.400.000	Russian Federal Bond - OFZ 0.000% 07-Oct-2026	189.783	0,06
Südafrika - 2.567.414			
(31. Dezember 2021: 1.372.932)			
9.000.000	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	443.046	0,13
34.800.000	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	1.618.285	0,49
3.462.597	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	202.349	0,06
374.000	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	303.734	0,09
Spanien - 4.472.390			
(31. Dezember 2021: 22.103.330)			
2.600.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	2.185.560	0,65
2.600.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	2.286.830	0,68
Schweiz - 4.462.573			
(31. Dezember 2021: 928.939)			
1.984.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 6.537% 12-Aug-2033	1.639.257	0,49
2.645.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 18-Dec-2171	1.958.010	0,58
400.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 6.375% 21-Feb-2171	269.973	0,08
725.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Jun-2171	595.333	0,18
Ukraine - 134.777			
(31. Dezember 2021: 854.601)			
650.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2029	134.777	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigtes Königreich - 17.811.687				
(31. Dezember 2021: 50.725.984)		17.811.687	5,31	
520.652	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 3.784% 17-Mar-2039	533.068	0,16	
424.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 4.494% 25-Jul-2058	471.558	0,14	
1.101.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 8.407% 14-Nov-2032	1.281.855	0,38	
635.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 6.375% 15-Mar-2171	655.174	0,20	
1.836.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	1.424.442	0,43	
2.200.000	Chesnara Plc 4.750% 04-Aug-2032	1.810.308	0,54	
1.040.000	Co-Operative Bank Finance Plc/The FRN 6.000% 06-Apr-2027	1.048.015	0,31	
508.041	Eurosail 2006-1 Plc '2006-1X B1A' FRN 2.240% 10-Jun-2044	501.631	0,15	
3.079.000	Greene King Finance Plc FRN 5.602% 15-Mar-2036	2.641.638	0,79	
1.120.720	Landmark Mortgage Securities No 1 Plc FRN 2.662% 17-Jun-2038	1.038.035	0,31	
1	Ludgate Funding Plc '2006-1X BB' FRN 2.274% 01-Dec-2060	-	-	
909.893	Marston's Issuer Plc FRN 4.304% 15-Oct-2027	914.721	0,27	
523.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 4.973% 15-Jul-2029	568.860	0,17	
500.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-3 '2021-3X C' FRN 5.073% 15-Nov-2029	544.634	0,16	
499.000	Newday Partnership Funding 2020-1 Plc '2020-1X B' FRN 5.179% 15-Nov-2028	561.926	0,17	
446.336	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS2X B1C' FRN 2.820% 12-Jun-2044	375.446	0,11	
462.435	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS3X M1C' FRN 2.230% 12-Jun-2044	429.164	0,13	
159.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 5.695% 23-Jan-2029	173.003	0,05	
386.000	Stratton Mortgage Funding 2021-3 Plc '2021-3 D' FRN 4.987% 12-Dec-2043	413.263	0,12	
1.183.470	Together Asset Backed Securitisation 2021-CRE1 Plc '2021-CRE1 A' FRN 4.800% 20-Jan-2055	1.323.192	0,39	
1.316.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	1.101.754	0,33	
Vereinigte Staaten von Amerika - 5.618.012				
(31. Dezember 2021: 60.424.210)		5.618.012	1,68	
1.500.000	Celanese US Holdings LLC 0.625% 10-Sep-2028	1.092.263	0,33	
1.100.000	Celanese US Holdings LLC 6.379% 15-Jul-2032	990.896	0,30	
2.650.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	2.621.247	0,78	
415.000	PartnerRe Finance B LLC FRN 4.500% 01-Oct-2050	337.657	0,10	
625.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	575.949	0,17	
Gesamtanlagen in Anleihen		247.520.081	73,85	
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)				
Frankreich - 1.634.626				
(31. Dezember 2021: 1.955.449)		1.634.626	0,49	
700.000	Emeria S.A.S. FRN Term Loan 0.000% 27-Mar-2028	677.376	0,20	
1.000.000	Odyssey Investment BidCo Circet Europe Term Loan 4.693% 09-Jul-2028	957.250	0,29	
Luxemburg - 1.365.345				
(31. Dezember 2021: -)		1.365.345	0,41	
1.500.000	Herens Holdco Sarl EUR Term Loan B 5.193% 02-Jul-2028	1.365.345	0,41	
Niederlande - 4.777.175				
(31. Dezember 2021: 3.999.130)		4.777.175	1,42	
1.000.000	Kouti B.V. Titan Holdings Term Loan 5.129% 30-Jun-2028	936.665	0,28	
1.000.000	Kraton Polymers Holdings B.V. Term Loan 5.312% 15-Mar-2029	957.500	0,28	
1.000.000	PEARLS (Netherlands) Bidco B.V. - Caldic BV EUR Term Loan 5.105% 04-Feb-2029	951.500	0,28	
1.000.000	Pegasus Bidco B.V. Refresco EUR Term Loan 6.012% 05-May-2029	968.070	0,29	
1.000.000	UPC Broadband Holding B.V. Term Loan 3.363% 31-Jan-2029	963.440	0,29	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts.				
Schweden - 951.250				
(31. Dezember 2021: 1.000.875)		951.250	0,28	
1.000.000	Verisure Holding AB Term Loan 3.753% 09-Jul-2026	951.250	0,28	
Vereinigtes Königreich - 7.107.242				
(31. Dezember 2021: 8.117.495)		7.107.242	2,12	
1.000.000	CD&R Firefly Bidco Limited Term Loan 6.542% 23-Jun-2025	1.038.659	0,31	
1.000.000	Constellation Automotive Group Limited Term Loan 5.940% 28-Jul-2028	785.261	0,23	
1.000.000	Eagle Bidco Limited Term Loan 7.710% 31-Jan-2029	1.024.254	0,31	
1.000.000	IVC Acquisition Ltd Term Loan 7.546% 13-Feb-2026	1.022.957	0,30	
1.146.800	Platform Bidco Ltd Term Loan 5.851% 29-Mar-2023	996.713	0,30	
282.719	Project Panther Term Loan 6.796% 29-Oct-2021	3.985	0,00	
1.177.517	TC Funding I Limited Term Loan 6.678% 26-Sep-2023	1.309.825	0,39	
1.000.000	Zephyr Bidco Limited Term Loan 7.709% 06-Jun-2025	925.588	0,28	
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.916.818				
(31. Dezember 2021: 3.379.326)		2.916.818	0,87	
990.000	Solera Polaris Newco LLC Term Loan 8.177% 02-Jun-2028	986.566	0,29	
1.858.750	Virgin Media SFA Finance Ltd Term Loan 6.211% 10-Nov-2027	1.930.252	0,58	
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		18.752.456	5,59	
Total Return Swaps				
Niederlande - 21.086				
9.600.000	TRS EUR EURIBOR 20-Jun-2023	21.086	0,01	
Vereinigte Staaten von Amerika - 700.031				
19.200.000	TRS 1 Day USD SOFR 20-Jun-2023	115.099	0,03	
34.900.000	TRS iBoxx USD Liquid Investment Grade Index Series 1 Version 1 20-Jun-2023	584.932	0,17	
Total Return Swaps insgesamt		721.117	0,21	
Credit Default Swaps - 1.585.390				
(31. Dezember 2021: 6.851.302)				
1.850.000	CDS Apache Corporation 1.000% 20-Dec-2027	69.742	0,02	
3.775.000	CDS British America Tobacco Plc 1.000% 20-Dec-2027	23.107	0,01	
1.875.000	CDS British Telecommunications Plc 1.000% 20-Dec-2027	44.466	0,01	
(625.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 39 5.000% 20-Dec-2027	3.801	0,00	
(52.800.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	397.233	0,12	
(41.200.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	309.962	0,09	
1.850.000	CDS Devon Energy Corporation 1.000% 20-Dec-2027	25.613	0,01	
(1.850.000)	CDS Ford Motor Company 5.000% 20-Dec-2027	91.120	0,03	
3.775.000	CDS Imperial Brands Plc 1.000% 20-Dec-2027	16.418	0,01	
690.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	51.161	0,02	
220.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	16.312	0,00	
760.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	56.351	0,02	
205.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	15.200	0,00	
(39.325.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	159.297	0,05	
40.550.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	3.455	0,00	
1.300.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2027	80.957	0,02	
425.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2027	26.467	0,01	
(3.700.000)	CDS Morgan Stanley 1.000% 20-Dec-2027	3.601	0,00	
225.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	16.708	0,01	
750.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	55.695	0,02	
200.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	14.852	0,00	
700.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	51.982	0,02	
1.850.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2027	16.388	0,00	
(1.975.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2027	12.743	0,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps Forts.			
(1.975.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2027	22.759	0,01
Credit Default Swaps insgesamt		1.585.390	0,48
Zinsswaps - 307.210			
(31. Dezember 2021: 896.802)			
11.800.000	IRS Receive 1 T USD Index Pay 104.301231 01-Jul-2052	307.210	0,09
Zinsswaps insgesamt		307.210	0,09
Swaptions - 203.611			
(31. Dezember 2021: 143.013)			
52.400.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.800	112.238	0,03
47.200.000	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.925	91.373	0,03
Swaptions insgesamt		203.611	0,06

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 8.645.531				
(31. Dezember 2021: 3.776.347)				
(951)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(110.296.980)	2.609.579	0,78
(284)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(31.072.440)	2.396.699	0,72
(1)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(133.530)	8.259	0,00
(69)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.465.420)	1.811.510	0,54
(189)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(19.933.830)	234.080	0,07
(4)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(421.880)	4.954	0,00
(52)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(53.773.360)	769.949	0,23
(11)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.158.443)	5.173	0,00
(456)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(46.134.123)	599.575	0,18
(2)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(224.779)	16.450	0,00
(23)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.584.961)	189.303	0,06
Offene Terminkontrakte insgesamt			8.645.531	2,58
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.245.520 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 6.248.056)			4.245.520	1,27
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			312.759.255	93,31

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps - (5.123.041)			
(31. Dezember 2021: (9.301.741))			
3.750.000	CDS Anglo American Plc 1.000% 20-Dec-2027	(523.698)	(0,16)
1.900.000	CDS ArcelorMittal S.A. 5.000% 20-Dec-2027	(216.510)	(0,06)
3.675.000	CDS Barrick Gold Corporation 1.000% 20-Dec-2027	(55.128)	(0,02)
3.075.000	CDS Bayerische Motoren Werke AG 1.000% 20-Dec-2027	(30.581)	(0,01)
3.700.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2027	(19.012)	(0,01)
1.850.000	CDS Canadian National Resources Limited 1.000% 20-Dec-2027	(11.032)	(0,00)
3.750.000	CDS Carrefour SA 1.000% 20-Dec-2027	(1.585)	(0,00)
224.050.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(1.685.606)	(0,50)
3.700.000	CDS Cisco Systems Inc 1.000% 20-Dec-2027	(101.374)	(0,03)
(3.800.000)	CDS Credit Suisse Group AG 1.000 20-Dec-2027	(433.677)	(0,13)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps Forts.			
(3.675.000)	CDS Dow Chemical Company 1.000% 20-Dec-2027	(37.542)	(0,01)
3.750.000	CDS Glencore International AG 1.000% 20-Dec-2027	(530.537)	(0,16)
14.450.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(135.297)	(0,04)
(6.250.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(209.273)	(0,06)
3.750.000	CDS Koninklijke Ahold Delhaize N.V. 1.000% 20-Dec-2027	(97.211)	(0,03)
(3.800.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2027	(329.391)	(0,10)
2.700.000	CDS Mercedes-Benz Group AG 1.000% 20-Dec-2027	(15.461)	(0,01)
(3.900.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2027	(314.055)	(0,09)
3.750.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2027	(35.304)	(0,01)
3.750.000	CDS Repsol S.A. 1.000% 20-Dec-2027	(29.117)	(0,01)
(3.800.000)	CDS Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.000% 20-Dec-2027	(213.064)	(0,06)
1.850.000	CDS Valero Energy Corporation 1.000% 20-Dec-2027	(357)	(0,00)
(3.675.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2027	(18.514)	(0,01)
3.750.000	CDS Vodafone Group Plc 1.000% 20-Dec-2027	(5.956)	(0,00)
(3.725.000)	CDS Volkswagen AG 1.000% 20-Dec-2027	(73.759)	(0,02)
Credit Default Swaps insgesamt		(5.123.041)	(1,53)
Zinsswaps - (5.418.137)			
(31. Dezember 2021: -)			
7.170.000	IRS Receive 1 T USD Index Pay 125.660173 03-May-2052	(335.512)	(0,10)
61.800.000	IRS Receive 1.468% Pay 6 Month EUR EURIBOR 05-May-2027	(4.263.809)	(1,27)
6.450.000	IRS Receive 105.748501 Pay 1 T EUR Index 02-Sep-2052	(472.179)	(0,14)
3.000.000	IRS Receive 106.255269 Pay 1 T EUR Index 06-Jul-2052	(251.356)	(0,08)
5.100.000	IRS Receive 122.389003 Pay 1 T EUR Index 03-May-2052	(95.281)	(0,03)
Zinsswaps insgesamt		(5.418.137)	(1,62)
Swaptions - (695.235)			
(31. Dezember 2021: (4.605.316))			
(104.800.000)	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.900	(74.018)	(0,02)
(41.600.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 37 Put 16-Feb-2023 3.000	(4.163)	(0,00)
(51.000.000)	CDX North America Investment Grade Index Series 38 Put 20-Apr-2023 3.000	(11.762)	(0,00)
(41.600.000)	iTraxx Europe Crossover Index Series 36 Put 16-Feb-2023 3.000	(298)	(0,00)
(51.000.000)	iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Put 20-Apr-2023 3.000	(2.755)	(0,00)
(48.500.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 15-Feb-2023 0.900	(116.676)	(0,04)
(49.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 18-Jan-2023 0.850	(33.495)	(0,01)
(48.500.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 15-Feb-2023 0.900	(194.821)	(0,06)
(49.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.850	(189.347)	(0,06)
(94.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 1.025	(67.900)	(0,02)
Swaptions insgesamt		(695.235)	(0,21)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (3.639.286)				
(31. Dezember 2021: (1.976.470))				
13	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.507.740	(22.102)	(0,01)
371	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	49.539.630	(2.956.802)	(0,88)
35	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	3.685.955	(41.429)	(0,01)
238	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	26.381.114	(291.464)	(0,09)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
2	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	221.690	(1.356)	(0,00)
6	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.153.380	(3.737)	(0,00)
92	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	10.814.399	(300.098)	(0,09)
6	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	757.622	(22.298)	(0,01)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(3.639.286)	(1,09)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (10.505.261) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (5.644.555))			(10.505.261)	(3,14)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(25.380.960)	(7,59)
Nettoumlaufvermögen			47.802.021	14,28
Summe Nettovermögen			335.180.316	100,00

^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.
 – Ein Teil der Beteiligung wird von Citigroup Global Markets Limited als Sicherheit im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Terminkontrakten gehalten.
 Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Barclays Bank PLC, Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.
 Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.
 Der Kontrahent für Zinsswaps ist Goldman Sachs.
 Die Kontrahenten für Swaptions sind JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.
 Die Kontrahenten für Total Return Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Goldman Sachs und JPMorgan Chase Bank.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	76,23
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5,14
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,37
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,93
Sonstiges Umlaufvermögen	14,33
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum	Kontrahent			
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund							
Euro	US-Dollar	881.323	922.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley	17.934	
Euro	US-Dollar	198.076	197.000	6. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	13.599	
Euro	US-Dollar	6.176.411	6.162.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley	406.123	
Euro	US-Dollar	551.668	550.000	6. Jan. 23	Natwest Markets Plc	36.631	
Euro	US-Dollar	2.825.083	2.790.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley	212.441	
Euro	US-Dollar	4.222.351	4.170.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley	317.434	
Euro	US-Dollar	34.817	36.000	6. Jan. 23	RBC Capital Markets	1.105	
Euro	US-Dollar	855.013	909.000	6. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	3.797	
Euro	US-Dollar	47.005	50.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley	183	
Euro	US-Dollar	303.579	318.000	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	5.794	
Kanadischer Dollar	Euro	416.000	287.874	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	98	
Euro	Kanadischer Dollar	262.284	364.000	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	10.308	
Euro	Kanadischer Dollar	322.158	449.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	11.342	
Euro	Kanadischer Dollar	869.231	1.194.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	42.695	
Euro	Kanadischer Dollar	218.677	310.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	4.083	
Euro	Kanadischer Dollar	327.660	445.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	19.613	
Euro	Kanadischer Dollar	220.020	317.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	579	
Euro	Schwedische Krone	1.158.430	12.527.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	27.739	
Euro	Schwedische Krone	642.532	6.965.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	13.869	
Japanischer Yen	Euro	14.650.000	100.340	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	3.859	
Japanischer Yen	Euro	18.386.000	127.697	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	3.074	
Japanischer Yen	Euro	79.493.000	558.811	10. Jan. 23	UBS AG	6.585	
Brasilianischer Real	US-Dollar	103.000	19.005	11. Jan. 23	Barclays Bank PLC	439	
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	1.198.794.000	240.392	11. Jan. 23	BNP Paribas	5.955	
Euro	US-Dollar	80.575	83.000	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	2.880	
Japanischer Yen	US-Dollar	23.575.009	167.557	11. Jan. 23	Morgan Stanley	10.841	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	859.160	525.260	11. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	18.872	
Norwegische Krone	US-Dollar	713.628	69.629	11. Jan. 23	Goldman Sachs	2.748	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	1.972.000	113.321	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	2.856	
Pfund Sterling	US-Dollar	354.161	419.270	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	6.741	
Schwedische Krone	US-Dollar	7.567.203	710.106	11. Jan. 23	Goldman Sachs	18.287	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	246.130	330.767	11. Jan. 23	Morgan Stanley	1.445	
US-Dollar	Indische Rupie	151.890	12.457.000	11. Jan. 23	UBS AG	1.233	
Euro	US-Dollar	348.371	367.000	12. Jan. 23	Lloyds Bank plc	4.851	
Euro	US-Dollar	499.827	495.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley	36.497	
Euro	US-Dollar	6.823.903	6.758.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley	498.274	
Euro	US-Dollar	346.308	369.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley	916	
Euro	US-Dollar	139.100	143.000	12. Jan. 23	RBC Capital Markets	5.249	
Tschechische Krone	Euro	29.710.914	1.223.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	5.066	
Tschechische Krone	US-Dollar	58.080.720	2.543.176	18. Jan. 23	Goldman Sachs	21.276	
Euro	Schweizer Franken	1.274.000	1.252.393	18. Jan. 23	Morgan Stanley	1.705	
Euro	US-Dollar	4.609.574	4.922.991	18. Jan. 23	Morgan Stanley	3.571	
Euro	US-Dollar	1.052.088	1.119.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	5.139	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	3.279.232.000	211.046	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	444	
Japanischer Yen	US-Dollar	488.230.191	3.631.253	18. Jan. 23	Morgan Stanley	76.796	
Koreanischer Won	US-Dollar	1.773.568.000	1.373.794	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	32.545	
Polnischer Zloty	US-Dollar	357.096	80.699	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	536	
Pfund Sterling	US-Dollar	453.630	546.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	236	
Schweizer Franken	Euro	1.272.734	1.289.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	3.959	
Schweizer Franken	Euro	1.258.213	1.274.000	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	4.207	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	455.000	613.955	18. Jan. 23	Morgan Stanley	931	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	121.925	588.000.000	18. Jan. 23	BNP Paribas	989	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	723.895	1.112.346	18. Jan. 23	Morgan Stanley	16.530	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	2.722.000	4.264.004	18. Jan. 23	Morgan Stanley	13.837	
US-Dollar	Norwegische Krone	240.959	2.349.299	18. Jan. 23	Morgan Stanley	1.871	
US-Dollar	Pfund Sterling	7.563.399	6.079.398	18. Jan. 23	Morgan Stanley	225.745	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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	Taiwan-Dollar	794.063	24.207.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	3.491
US-Dollar	Taiwan-Dollar	2.621.801	80.214.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	2.716
Euro	Australischer Dollar	166.566	259.000	19. Jan. 23	Lloyds Bank plc	1.697
Euro	Australischer Dollar	7.458.794	11.567.000	19. Jan. 23	Morgan Stanley	95.687
Euro	Pfund Sterling	492.291	432.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	5.530
Euro	Pfund Sterling	743.709	650.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	11.313
Euro	Pfund Sterling	743.511	650.000	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	11.115
Euro	Pfund Sterling	743.642	650.000	20. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	11.246
Euro	Pfund Sterling	732.014	640.000	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	10.886
Euro	Pfund Sterling	184.450	161.000	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	3.041
Euro	Pfund Sterling	17.998.431	15.752.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	249.656
Euro	Pfund Sterling	307.508	265.000	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	8.916
Euro	Pfund Sterling	409.553	353.000	20. Jan. 23	HSBC Bank plc	11.806
Euro	Pfund Sterling	1.492.814	1.304.000	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	23.515
Euro	Pfund Sterling	268.513	235.000	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	3.723
Euro	Pfund Sterling	1.260.522	1.105.000	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	15.448
Euro	Pfund Sterling	366.069	321.000	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	4.378
Euro	Pfund Sterling	237.750	205.000	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	6.764
Euro	US-Dollar	311.135	314.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	17.504
Euro	US-Dollar	1.983.448	2.068.000	25. Jan. 23	RBC Capital Markets	49.594
Euro	US-Dollar	1.166.754	1.222.000	25. Jan. 23	RBC Capital Markets	24.022
Euro	US-Dollar	771.925	794.000	25. Jan. 23	HSBC Bank plc	29.430
Euro	US-Dollar	88.393	93.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	1.426
Euro	US-Dollar	567.578	574.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	30.812
Euro	US-Dollar	6.398.300	6.733.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	102.054
Euro	US-Dollar	425.766	448.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	6.827
Euro	US-Dollar	538.968	540.000	25. Jan. 23	Morgan Stanley	33.997
Euro	Australischer Dollar	7.603.414	11.901.000	1. Feb. 23	Morgan Stanley	30.632
Euro	US-Dollar	8.634.673	8.471.000	2. Feb. 23	Morgan Stanley	717.799
Euro	US-Dollar	561.666	559.000	2. Feb. 23	Morgan Stanley	39.232
Euro	US-Dollar	265.320	275.000	8. Feb. 23	Morgan Stanley	8.420
Euro	US-Dollar	480.267	499.000	8. Feb. 23	Morgan Stanley	14.091
Euro	US-Dollar	363.437	364.000	8. Feb. 23	Morgan Stanley	23.381
Euro	US-Dollar	1.672.502	1.741.000	8. Feb. 23	HSBC Bank plc	46.024
Euro	US-Dollar	65.397	70.000	8. Feb. 23	Morgan Stanley	2
Euro	US-Dollar	6.894.486	6.969.000	8. Feb. 23	UBS AG	183.904
Euro	US-Dollar	1.095.004	1.134.000	8. Feb. 23	HSBC Bank plc	35.599
Euro	US-Dollar	4.841.690	5.170.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	23.057
Euro	US-Dollar	4.841.472	5.170.000	15. Mrz. 23	UBS AG	22.839
Euro	US-Dollar	4.842.924	5.170.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	24.291
Euro	US-Dollar	4.842.765	5.170.000	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	24.132
Koreanischer Won	US-Dollar	1.399.540.891	1.075.742	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	39.157
Polnischer Zloty	US-Dollar	1.934.000	431.160	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	6.407
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	182.000	10.573	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	103
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	841.784	4.131.814.163	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	1.042
US-Dollar	Türkische Lira	404.459	7.890.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	4.632
EUR						4.213.970
US-Dollar	Euro	879.000	840.395	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(17.272)
US-Dollar	Euro	967.000	924.512	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(18.983)
US-Dollar	Euro	303.000	293.079	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(9.341)
US-Dollar	Euro	690.000	690.729	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(44.592)
US-Dollar	Euro	175.000	174.676	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(10.801)
US-Dollar	Euro	281.000	278.171	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(15.034)
US-Dollar	Euro	362.000	364.540	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(25.552)
US-Dollar	Euro	3.744.000	3.628.153	6. Jan. 23	Morgan Stanley	(122.156)
Kanadischer Dollar	Euro	1.082.000	750.587	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(1.582)
Kanadischer Dollar	Euro	2.449.000	1.806.188	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(110.890)
Euro	Kanadischer Dollar	110.618	161.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(833)
Euro	Kanadischer Dollar	260.877	377.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(98)
Euro	Japanischer Yen	72.916	10.512.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(1.851)
Euro	Japanischer Yen	87.662	12.657.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(2.362)
Euro	Japanischer Yen	58.233	8.344.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(1.114)
Euro	Japanischer Yen	86.034	12.497.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(2.851)
Euro	Japanischer Yen	259.178	36.943.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.580)
Euro	Japanischer Yen	9.006.026	1.313.983.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(339.720)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
Euro	Neuseeländischer Dollar	6.569.444	11.119.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(38.476)
Euro	Neuseeländischer Dollar	4.958.405	8.345.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(952)
US-Dollar	Koreanischer Won	6.769.503	9.330.000.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(583.806)
US-Dollar	Australischer Dollar	24.229	36.553	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(593)
US-Dollar	Chilenischer Peso	140.328	133.466.000	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	(14.208)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	129.444	2.040.553.000	11. Jan. 23	BNP Paribas	(1.800)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	79.706	1.562.000	11. Jan. 23	Goldman Sachs	(8)
US-Dollar	Schweizer Franken	458.073	435.585	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(13.572)
Euro	US-Dollar	342.399	366.000	12. Jan. 23	Lloyds Bank plc	(185)
Australischer Dollar	US-Dollar	469.690	323.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.207)
Australischer Dollar	US-Dollar	10.633.469	7.335.154	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(93.790)
Chilenischer Peso	US-Dollar	125.000.000	146.105	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(525)
Euro	Tschechische Krone	2.377.000	57.804.100	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(12.265)
Indische Rupie	US-Dollar	105.197.000	1.273.726	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(2.047)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	4.282.549	2.722.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(14.701)
Schwedische Krone	US-Dollar	19.097.377	1.879.456	18. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(34.866)
Schweizer Franken	US-Dollar	1.755.382	1.908.137	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(1.997)
Taiwan-Dollar	US-Dollar	40.107.000	1.313.261	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(3.567)
Taiwan-Dollar	US-Dollar	40.107.000	1.311.543	18. Jan. 23	Goldman Sachs	(1.960)
Taiwan-Dollar	Australischer Dollar	24.207.000	798.042	18. Jan. 23	Goldman Sachs	(7.214)
US-Dollar	Australischer Dollar	519.000	766.376	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(2.278)
US-Dollar	Australischer Dollar	403.000	599.813	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(4.778)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	417.000	568.412	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.113)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	788.148	1.066.754	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(647)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	649.000	4.517.527	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(5.153)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	152.181	1.055.172	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(649)
US-Dollar	Indische Rupie	1.028.582	85.110.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(150)
US-Dollar	Japanischer Yen	419.000	55.851.099	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(5.435)
US-Dollar	Koreanischer Won	528.676	689.129.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(17.435)
US-Dollar	Koreanischer Won	546.203	702.144.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(10.707)
US-Dollar	Koreanischer Won	108.314	139.936.000	18. Jan. 23	Goldman Sachs	(2.642)
US-Dollar	Koreanischer Won	1.355.524	1.773.568.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(49.638)
Euro	Australischer Dollar	9.189.741	14.573.000	19. Jan. 23	Morgan Stanley	(86.869)
Pfund Sterling	Euro	371.000	428.487	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(10.458)
Pfund Sterling	Euro	1.278.000	1.459.262	20. Jan. 23	Lloyds Bank plc	(19.259)
Pfund Sterling	Euro	251.000	286.524	20. Jan. 23	Toronto Dominion Bank	(3.707)
Pfund Sterling	Euro	128.000	145.407	20. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	(1.181)
Pfund Sterling	Euro	221.000	249.606	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(591)
Pfund Sterling	Euro	545.000	632.726	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(18.640)
Pfund Sterling	Euro	373.000	424.324	20. Jan. 23	UBS AG	(4.041)
Pfund Sterling	Euro	81.000	93.543	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(2.275)
Pfund Sterling	Euro	428.000	485.717	20. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(3.462)
Pfund Sterling	Euro	839.000	969.377	20. Jan. 23	RBC Capital Markets	(24.023)
US-Dollar	Euro	1.478.000	1.386.632	25. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(4.507)
US-Dollar	Euro	603.000	588.535	25. Jan. 23	Lloyds Bank plc	(4.650)
US-Dollar	Euro	1.905.000	1.801.478	25. Jan. 23	Morgan Stanley	(20.051)
US-Dollar	Euro	243.000	229.409	25. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(2.172)
Euro	Australischer Dollar	315.464	497.000	1. Feb. 23	Morgan Stanley	(785)
US-Dollar	Euro	556.000	520.526	8. Feb. 23	Bank of America Merrill Lynch	(1.099)
US-Dollar	Euro	64.000	60.026	8. Feb. 23	UBS AG	(236)
Brasilianischer Real	US-Dollar	410.000	779.946	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(1.050)
US-Dollar	Brasilianischer Real	120.658	660.000	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(2.803)
US-Dollar	Brasilianischer Real	4.472.430	24.534.407	1. Mrz. 23	Morgan Stanley	(116.190)
Thailändischer Baht	US-Dollar	37.420.747	1.089.567	15. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	(1.477)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	738.347	5.120.030	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	(6.217)
US-Dollar	Tschechische Krone	434.530	10.036.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(7.035)
US-Dollar	Euro	471.000	440.424	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(1.435)
US-Dollar	Euro	665.000	620.625	15. Mrz. 23	Lloyds Bank plc	(820)
US-Dollar	Euro	737.000	690.086	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.174)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Indonesische Rupiah	515.472	8.073.841.375	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(6.586)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	5.223.560	105.021.000	15. Mrz. 23	Toronto Dominion Bank	(70.010)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	422.053	1.629.336	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.268)
US-Dollar	Philippinischer Peso	1.074.394	60.010.309	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(1.226)
US-Dollar	Rumänischer Leu	1.590.626	7.460.000	15. Mrz. 23	UBS AG	(11.191)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.985.940	35.045.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(66.247)
US-Dollar	Ungarischer Forint	750.921	304.621.000	16. Mrz. 23	Morgan Stanley	(41.661)
						EUR (2.209.372)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse CHFT (Hedged)

Schweizer Franken	Euro	72	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	Euro	65	65	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
						EUR -
						CHF -
Schweizer Franken	Euro	12.419	12.652	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(38)
						EUR (38)
						CHF (37)

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

Euro	Pfund Sterling	566.016	500.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.459
Euro	Pfund Sterling	575.353	501.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10.282
Euro	Pfund Sterling	580.140	500.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16.582
						EUR 29.323
						GBP 26.004
Pfund Sterling	Euro	500.000	566.393	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.584)
Pfund Sterling	Euro	45.201	51.172	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(225)
Pfund Sterling	Euro	51.280	58.822	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.023)
Pfund Sterling	Euro	9.126.674	10.633.225	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(346.417)
						EUR (350.249)
						GBP (310.610)

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

Euro	Pfund Sterling	31.151	27.499	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	142
Euro	Pfund Sterling	101.880	90.128	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	255
Euro	Pfund Sterling	85.367	75.549	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	215
Euro	Pfund Sterling	5.099	4.489	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	39
Euro	Pfund Sterling	44.210	39.011	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	241
Euro	Pfund Sterling	42.913	37.652	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	475
Euro	Pfund Sterling	3.912	3.409	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	70
Euro	Pfund Sterling	11.599	10.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	328
Euro	Pfund Sterling	1.255	1.077	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	41

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	Pfund Sterling	6.177	5.323	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	177
						EUR 1.983
						GBP 1.759

Pfund Sterling	Euro	75.549	85.400	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(214)
Pfund Sterling	Euro	90.128	101.840	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(256)
Pfund Sterling	Euro	27.499	31.130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(135)
Pfund Sterling	Euro	420.357	475.887	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.096)
Pfund Sterling	Euro	8.125	9.260	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(103)
Pfund Sterling	Euro	455.810	522.846	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.096)
Pfund Sterling	Euro	36.070	41.840	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.184)
Pfund Sterling	Euro	55.909	64.870	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.854)
Pfund Sterling	Euro	201.498	233.776	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.665)
Pfund Sterling	Euro	76.597.281	89.241.282	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.907.367)
						EUR (2.928.970)
						GBP (2.597.487)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	11.569	10.150	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	128
Pfund Sterling	Euro	28	32	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
						EUR 128
						GBP 114
Pfund Sterling	Euro	60	68	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	10.062	11.723	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(382)
						EUR (383)
						GBP (340)

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

Pfund Sterling	Euro	734.472	831.496	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.662)
Pfund Sterling	Euro	778.186	892.634	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15.529)
Pfund Sterling	Euro	127.994.508	149.122.707	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.858.227)
						EUR (4.877.418)
						GBP (4.325.421)

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

Euro	US-Dollar	25.125	26.775	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	64
						EUR 64
						USD 68
US-Dollar	Euro	4.618	4.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	8.679	8.139	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Euro	5.154	4.850	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

US-Dollar	Euro	841.765	795.968	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8.116)	
						EUR	(8.180)
						USD	(8.733)

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

US-Dollar	Euro	74.667	70.225	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(340)	
US-Dollar	Euro	76.321	71.819	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(386)	
US-Dollar	Euro	13.465.957	12.733.324	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(129.828)	
						EUR	(130.554)
						USD	(139.386)

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

Euro	US-Dollar	9.562	10.161	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	52	
US-Dollar	Euro	31	29	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Euro	62	58	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
						EUR	52
						USD	56
US-Dollar	Euro	10.068	9.520	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(97)	
						EUR	(97)
						USD	(104)

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 1.921.853			
(31. Dezember 2021: 3.237.321)			
3.995.536	Sherborne Investors Guernsey C Ltd	1.921.853	1,38
Vereinigtes Königreich - 12.958.011			
(31. Dezember 2021: 12.319.172)			
12.958.011	Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	12.958.011	9,27
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		14.879.864	10,65
Anleihen			
Vereinigtes Königreich - 27.956.268			
(31. Dezember 2021: 4.997.275)			
2.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Jan-2023	1.999.350	1,43
17.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jan-2023	16.986.315	12,15
6.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jan-2023	5.991.630	4,29
3.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Mar-2023	2.978.973	2,13
Gesamtanlagen in Anleihen		27.956.268	20,00
Einlagezertifikate			
Belgien - 2.985.096			
(31. Dezember 2021: 3.999.167)			
3.000.000	KBC Bank NV 0.000% 23-Feb-2023 CD	2.985.096	2,13
Frankreich - 2.970.608			
(31. Dezember 2021: -)			
3.000.000	Societe Generale 0.000% 31-Mar-2023 CD	2.970.608	2,12
Japan - 14.942.603			
(31. Dezember 2021: -)			
3.000.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp 0.000% 14-Feb-2023 CD	2.987.476	2,14
4.000.000	Mizuho Bank Ltd 0.000% 04-Jan-2023 CD	3.998.475	2,86
4.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.000% 31-Jan-2023 CD	3.987.522	2,85
4.000.000	Sumitomo Trust and Banking Corp 0.000% 15-Mar-2023 CD	3.969.130	2,84
Niederlande - 7.878.972			
(31. Dezember 2021: -)			
1.000.000	ABN AMRO Bank NV 0.000% 06-Jan-2023 CD	999.466	0,72
3.000.000	ABN AMRO Bank NV 0.000% 07-Mar-2023 CD	2.980.840	2,13
4.000.000	Rabobank Nederland NV 0.000% 01-Aug-2023 CD	3.898.666	2,79
Singapur - 3.997.712			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 0.000% 06-Jan-2023 CD	3.997.712	2,86
Spanien - 3.982.277			
(31. Dezember 2021: -)			
1.000.000	Banco Santander SA 0.000% 16-Feb-2023 CD	995.842	0,71
3.000.000	Banco Santander SA 0.000% 20-Feb-2023 CD	2.986.435	2,14
Vereinigte Arabische Emirate - 3.001.501			
(31. Dezember 2021: 4.499.494)			
3.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 3.490% 07-Feb-2023 CD	3.001.501	2,15
Vereinigtes Königreich - 7.984.544			
(31. Dezember 2021: 4.998.303)			
4.000.000	Lloyds Bank Plc 0.000% 08-Feb-2023 CD	3.986.871	2,85
4.000.000	Nationwide Building Society 0.000% 06-Jan-2023 CD	3.997.673	2,86

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Einlagezertifikate Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.985.092			
(31. Dezember 2021: 4.997.084)			
2.000.000	Bank of America 0.000% 13-Mar-2023 CD	1.985.092	1,42
Gesamtanlagen in Einlagezertifikaten		49.728.405	35,57
Commercial Paper			
Australien - 3.998.146			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd 0.000% 04-Jan-2023 CP	3.998.146	2,86
Dänemark - 2.987.389			
(31. Dezember 2021: -)			
3.000.000	Jyske Bank AS 0.000% 14-Feb-2023 CP	2.987.389	2,14
Frankreich - 6.977.481			
(31. Dezember 2021: 11.995.984)			
4.000.000	Agence Centrale des Organismes Securite Sociale 0.000% 21-Feb-2023 CP	3.980.261	2,85
3.000.000	BPCE SA 0.000% 09-Jan-2023 CP	2.997.220	2,14
Niederlande - 5.980.847			
(31. Dezember 2021: -)			
3.000.000	PACCAR Financial Europe BV 0.000% 23-Jan-2023 CP	2.993.691	2,14
3.000.000	Toyota Motor Finance 0.000% 14-Feb-2023 CP	2.987.156	2,14
Norwegen - 3.933.116			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	DNB Bank ASA 0.000% 31-May-2023 CP	3.933.116	2,81
Gesamtanlagen in Commercial Paper		23.876.979	17,08
Aktien			
Guernsey - 23.683			
(31. Dezember 2021: 23.683)			
18.387.629	Sherborne Investors Guernsey B Ltd	23.683	0,02
Spanien - 2.073.750			
(31. Dezember 2021: 3.184.653)			
292.512	Grifols SA ADR	2.073.750	1,48
Schweiz - 689.200			
(31. Dezember 2021: 2.260.209)			
2.616	Roche Holding AG	689.200	0,49
Vereinigtes Königreich - 779.325			
(31. Dezember 2021: 3.110.162)			
1.179.491	Hostmore Plc	161.000	0,12
465.116	Stelrad Group Plc	586.046	0,42
416.497	Unbound Group Plc	32.279	0,02
Vereinigte Staaten von Amerika - 776.865			
(31. Dezember 2021: 281.610)			
670.000	Diversified Energy Co Plc	776.865	0,56
Gesamtanlagen in Aktien		4.342.823	3,11
Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)			
Kanada - 6.001.428			
(31. Dezember 2021: 6.057.510)			
3.000.000	Bank of Montreal FRN 3.831 % 09-Jan-2023	3.000.378	2,14
3.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 'EMTN' FRN 3.926% 20-Jan-2023	3.001.050	2,15
Deutschland - 2.530.325			
(31. Dezember 2021: 2.556.387)			
2.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' FRN 4.397 % 14-Jun-2024	2.530.325	1,81
Gesamtanlagen in variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)		8.531.753	6,10

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
Aktienindex-Swaps			
Europa - 438.853			
(2.500)	EURO STOXX® Banks Index 20-Oct-2023	797	0,00
(610)	EURO STOXX® Personal & Household Goods Index 06-Nov-2023	12.686	0,01
(286)	EURO STOXX® Utilities Index 06-Nov-2023	1.356	0,00
(5.700)	JPMorgan ECYC Index 06-Nov-2023	22.652	0,02
(33.250)	JPMorgan EUR Industrials Index 06-Nov-2023	25.122	0,02
(3.745)	STOXX® Europe 600 Automobiles & Parts Index 17-Jan-2023	109.167	0,08
(1.000)	STOXX® Europe 600 Construction & Materials Index 06-Nov-2023	15.351	0,01
(2.433)	STOXX® Europe 600 Consumer Products and Services Index 17-Jan-2023	12.320	0,01
(8.325)	STOXX® Europe 600 Index 06-Nov-2023	92.182	0,07
(6.630)	STOXX® Europe 600 Industrial Goods & Services Index 17-Jan-2023	118.068	0,08
(5.500)	STOXX® Europe 600 Insurance Index 06-Nov-2023	8.933	0,01
(1.000)	STOXX® Europe 600 Media Index 06-Nov-2023	13.106	0,01
(1.834)	STOXX® Europe 600 Oil & Gas Index 20-Oct-2023	7.113	0,00
Vereinigtes Königreich - 242.943			
(3.750)	Barclays EUPAPE Index 17-Jan-2023	9.450	0,01
(2.500)	Barclays IIRMI Index 17-Jan-2023	8.300	0,01
(17.042)	Barclays IIWATR Index 17-Jan-2023	36.250	0,02
(272)	FTSE 250 Index 17-Jan-2023	143.104	0,10
(300)	FTSE 350 General Retailers Index 06-Nov-2023	5.441	0,00
(4.000)	JPMorgan HOME Index 06-Nov-2023	6.275	0,00
(4.000)	JPMorgan UKBP Index 06-Nov-2023	7.239	0,01
(29.000)	JPMorgan UKFM Index 06-Nov-2023	26.884	0,02
Vereinigte Staaten von Amerika - 17.691			
(3.000)	JPMorgan CAPR Index 06-Nov-2023	17.691	0,01
Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps 699.487 0,50			
Aktien-Swaps			
Australien - 13.700			
4.000	Flutter Entertainment Plc 20-Oct-2023	13.700	0,01
Österreich - 65.298			
60.000	Erste Group Bank AG 20-Oct-2023	65.298	0,05
Belgien - 808.448			
11.276	D'leteren Group SA 27-Jun-2023	365.320	0,26
36.000	KBC Group 20-Oct-2023	336.709	0,24
50.000	Recticel 06-Nov-2023	106.419	0,08
China - 127.427			
13.033	Prosus NV 20-Oct-2023	127.427	0,09
Dänemark - 321.578			
517	Carlsberg A/S 20-Oct-2023	35.909	0,03
140.000	Danske Bank A/S 20-Oct-2023	214.215	0,15
15.000	Topdanmark 27-Jun-2023	5.958	0,00
70.000	Tryg A/S 20-Oct-2023	65.496	0,05
Finnland - 88.005			
(56.306)	Nokian Renkaat Oyj 20-Oct-23	88.005	0,06
Frankreich - 723.396			
22.500	Amundi SA 17-Jan-2023	7.253	0,01
(55.000)	AXA SA 20-Oct-2023	20.046	0,01
9.190	EssilorLuxottica SA 20-Oct-2023	95.150	0,07
(3.787)	Gaztransport & Technigaz SA 17-Jan-2023	25.020	0,02
(49.995)	Kleipierre REIT 17-Jan-2023	22.612	0,02
63.161	Michelin 20-Oct-2023	166.498	0,12
4.412	Sanofi S.A. 06-Nov-2023	2.150	0,00
44.505	SPIE SA 06-Nov-2023	38.679	0,03
16.627	TotalEnergies SE 27-Jun-2023	158.066	0,11
9.676	Trigano MDC SAS 06-Nov-2023	187.922	0,13
Deutschland - 939.969			
(35.118)	BASF SE NPV 17-Jan-2023	148.399	0,11
58.144	Bayer AG 27-Jun-2023	32.551	0,02
27.373	Covestro AG 06-Nov-2023	31.800	0,02
76.727	Daimler Truck Holding AG 20-Oct-2023	192.447	0,14
9.000	Deutsche Boerse AG 06-Nov-2023	28.534	0,02
44.380	Mercedes-Benz Group AG 20-Oct-2023	169.237	0,12
8.500	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG 06-Nov-2023	221.073	0,16
(8.000)	Nemetschek AG 20-Oct-2023	7.627	0,01
33.872	RWE AG 17-Jan-2023	81.855	0,06

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %
Aktien-Swaps Forts.			
(3.500)	SAP SE 20-Oct-2023	6.325	0,00
26.154	Takkt AG 20-Oct-2023	20.121	0,01
Ghana - 35.573			
(440.161)	Tullow Oil Plc 20-Oct-2023	35.573	0,02
Irland - 41.467			
(5.654)	Kerry Group Plc 27-Jun-2023	41.467	0,03
Italien - 361.938			
379.600	Anima Holding SpA 06-Nov-2023	168.320	0,12
(83.000)	Assicurazioni Generali SpA 17-Jan-2023	20.570	0,01
650.000	Banco BPM SpA 08-Nov-2023	85.098	0,06
105.000	Brembo SpA 20-Oct-2023	78.218	0,06
85.000	Iveco Group N.V. 20-Oct-2023	9.732	0,01
Niederlande - 669.091			
315.000	Aegon N.V. 20-Oct-2023	54.692	0,04
2.193	ASM International Ltd 27-Jun-2023	40.749	0,03
33.000	ASR Nederland N.V. 20-Oct-2023	38.083	0,03
35.027	Exor N.V. 27-Jun-2023	112.758	0,08
(6.764)	Heineken N.V. 20-Oct-2023	15.416	0,01
202.768	ING Groep NV 06-Nov-2023	89.910	0,06
14.184	Randstad NV 06-Nov-2023	78.869	0,06
102.893	Salvatore Ferragamo SpA 27-Jun-2023	238.614	0,17
Norwegen - 216.792			
165.000	DNB Bank ASA 06-Nov-2023	157.378	0,11
(53.146)	Nordic Semiconductor ASA 17-Jan-2023	59.414	0,04
Portugal - 106.675			
294.105	Energias de Portugal S.A. 20-Oct-2023	106.675	0,08
Spanien - 575.980			
400.000	Bankinter SA 20-Oct-2023	122.472	0,09
(30.145)	Enagas SA 06-Nov-2023	23.758	0,01
168.170	Merlin Properties Socimi SA 20-Oct-2023	121.920	0,09
133.456	Repsol SA 17-Jan-2023	122.199	0,09
591.303	Sacyr SA 20-Oct-2023	185.631	0,13
Schweden - 150.237			
68.087	AAK AG 27-Jun-2023	136.521	0,10
(13.523)	AB SKF 20-Oct-2023	6.604	0,00
40.000	Nordea Bank Abp 20-Oct-23	7.107	0,01
(13.918)	Nordnet Bank AB 20-Oct-2023	5	0,00
Schweiz - 478.073			
15.612	Compagnie Financiere Richemont SA 06-Nov-2023	236.488	0,17
(291)	Givaudan AG 06-Nov-2023	13.040	0,01
31.000	Julius Baer Group 20-Oct-2023	9.762	0,01
(4.500)	Swiss Life Holding AG 20-Oct-2023	73.668	0,05
(60.000)	UBS Group AG 20-Oct-2023	13.177	0,01
5.100	Zurich Insurance Group Ltd 20-Oct-2023	131.938	0,09
Vereinigtes Königreich - 1.713.590			
(550.000)	Abrdn Plc 17-Jan-2023	63.681	0,05
100.000	Admiral Group Plc 17-Jan-2023	70.667	0,05
(12.533)	Anglo American Plc 17-Jan-2023	10.434	0,01
200.000	Ashtead Group Plc 17-Jan-2023	38.201	0,03
328.000	Barratt Developments Plc 20-Oct-2023	151.171	0,11
252.000	BP Plc 20-Oct-2023	71.005	0,05
20.000	British American Tobacco Plc 06-Nov-2023	2.203	0,00
36.000	Burberry Group Plc 17-Jan-2023	1.440	0,00
75.000	Compass Group 17-Jan-2023	27.304	0,02
(250.000)	Currys Plc 06-Nov-2023	50.761	0,04
(34.783)	Diageo Plc 20-Oct-2023	9.826	0,01
(5.000)	Ferguson Plc 06-Nov-2023	3.772	0,00
235.000	Glencore Plc 20-Oct-2023	153.580	0,11
150.000	Hiscox Ltd 17-Jan-2023	186.150	0,13
500.000	HSBC Holdings Plc 17-Jan-2023	80.861	0,06
70.000	Imperial Brands Plc 17-Jan-2023	20.435	0,01
75.000	Informa Plc 06-Nov-2023	20.348	0,01
(100.000)	J.D. Wetherspoon 06-Nov-2023	23.971	0,02
500.000	JD Sports Fashion Plc 17-Jan-2023	36.250	0,03
140.000	Lancashire Holdings Ltd 20-Oct-2023	179.945	0,13
3.300.000	Lloyds Banking Group Plc 06-Nov-2023	6.098	0,00
(5.000)	London Stock Exchange Group Plc 17-Jan-2023	15.812	0,01
100.000	Man Group Plc 20-Oct-2023	1.442	0,00
680.000	Natwest Group Plc 17-Jan-2023	112.200	0,08
(68.730)	Persimmon Plc 20-Oct-2023	29.726	0,02
40.000	Prudential Plc 17-Jan-2023	2.346	0,00
48.091	Relx Plc 17-Jan-2023	7.627	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %	Summe
Aktien-Swaps Forts.				
(376.835)	Restaurant Group Plc 17-Jan-2023	24.155	0,02	
179.550	Rotork Plc 17-Jan-2023	21.003	0,01	
29.880	Shell Plc 27-Jun-2023	38.092	0,03	
800.000	SIG Plc 20-Oct-2023	3.600	0,00	
108.807	Smiths Group Plc 17-Jan-2023	8.452	0,01	
122.350	SSE Plc 17-Jan-2023	61.611	0,04	
(60.000)	Standard Chartered Plc 17-Jan-2023	1.689	0,00	
51.101	Unilever Plc 20-Oct-2023	151.387	0,11	
67.552	Whitbread Plc 17-Jan-2023	26.345	0,02	
Vereinigte Staaten von Amerika - 207.477		207.477	0,15	
(3.800)	Tesla Inc 06-Nov-2023	207.477	0,15	

Gesamtanlagen in Aktien-Swaps 7.644.714 5,47

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %	Summe
Offene Terminkontrakte - 229.901					
(31. Dezember 2021: -)					
(12)	CAC 40 10 Euro Index Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(693.959)	19.307	0,01	
(141)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(4.775.371)	174.272	0,12	
(48)	FTSE MIB Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(5.084.704)	36.322	0,03	
Offene Terminkontrakte insgesamt			229.901	0,16	

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.901.979
(siehe unten) (31. Dezember 2021: 129.730) 3.901.979 2,79

**Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum
beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 141.792.173 101,43**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %	Summe
----------	--------------	----------------------------------	-------------------------	-------

Aktienindex-Swaps

Europa - (592.682)				
(31. Dezember 2021: (709.367))				
(33.664)	EURO STOXX® Banks Index 20-Oct-2023	(54.332)	(0,04)	
(605)	EURO STOXX® Personal & Household Goods Index 06-Nov-2023	(30.088)	(0,02)	
(5.370)	EURO STOXX® Utilities Index 06-Nov-2023	(58.417)	(0,04)	
(55.013)	JPMorgan EUR Industrials Index 06-Nov-2023	(53.934)	(0,04)	
(85.587)	JPMorgan EUR Low Volatility Index 06-Nov-2023	(12.144)	(0,01)	
(14.500)	JPMorgan ITBK Index 06-Nov-2023	(78.056)	(0,06)	
37.000	JPMorgan MSHO Index 06-Nov-2023	(149.711)	(0,11)	
(10.000)	JPMorgan REIN Index 06-Nov-2023	(20.918)	(0,01)	
(12.321)	JPMorgan RESM Index 06-Nov-2023	(28.300)	(0,02)	
(1.290)	STOXX® Europe 600 Construction & Materials Index 06-Nov-2023	(12.939)	(0,01)	
(5.500)	STOXX® Europe 600 Insurance Index 06-Nov-2023	(21.217)	(0,01)	
(1.900)	STOXX® Europe 600 Media Index 06-Nov-2023	(16.917)	(0,01)	
(2.294)	STOXX® Europe 600 Oil & Gas Index 20-Oct-2023	(55.709)	(0,04)	
Deutschland - (50.641)				
(31. Dezember 2021: -)				
(115)	DAX Index 06-Nov-2023	(50.641)	(0,04)	
Vereinigtes Königreich - (343.642)				
(31. Dezember 2021: (452.699))				
(3.500)	Barclays ILELEC Index 17-Jan-2023	(56.125)	(0,04)	
(2.500)	Barclays IIRMI Index 17-Jan-2023	(610)	(0,00)	
(129)	FTSE 350 Index 20-Oct-2023	(147.837)	(0,11)	
(11.436)	JPMorgan HOME Index 06-Nov-2023	(10.978)	(0,01)	
(4.000)	JPMorgan UK Banks Index 06-Nov-2023	(48.560)	(0,03)	
(9.000)	JPMorgan UKBP Index 06-Nov-2023	(17.241)	(0,01)	
(12.111)	JPMorgan UKCO Index 06-Nov-2023	(35.970)	(0,03)	
(24.000)	JPMorgan UKFM Index 06-Nov-2023	(26.321)	(0,02)	
Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps			(986.965)	(0,71)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Nettover- mögen %	Summe
Aktien-Swaps				
Australien - (16.081)				
(31. Dezember 2021: (124.623))				
3.000	Flutter Entertainment Plc 20-Oct-2023	(16.081)	(0,01)	
Belgien - (78.784)				
(31. Dezember 2021: (133.923))				
(5.288)	Sofina NPV 20-Oct-2023	(78.784)	(0,05)	
Dänemark - (56.030)				
(31. Dezember 2021: (18.400))				
17.705	Carlsberg A/S 20-Oct-2023	(49.829)	(0,04)	
10.000	Topdanmark 27-Jun-2023	(6.201)	(0,00)	
Finnland - (22.960)				
(31. Dezember 2021: -)				
(50.000)	Sampo Group 20-Oct-2023	(22.960)	(0,02)	
Frankreich - (293.704)				
(31. Dezember 2021: (186.434))				
40.000	Adevinta ASA 20-Oct-2023	(35.209)	(0,02)	
13.500	Amundi SA 17-Jan-2023	(9.375)	(0,01)	
(28.000)	BNP Paribas 20-Oct-2023	(14.797)	(0,01)	
(1.500)	Kering 20-Oct-2023	(22.953)	(0,02)	
9.591	Sanofi S.A. 06-Nov-2023	(13.471)	(0,01)	
(60.000)	Societe Generale S.A. 20-Oct-2023	(57.047)	(0,04)	
21.465	Worldline SA 20-Oct-2023	(140.852)	(0,11)	
Deutschland - (460.269)				
(31. Dezember 2021: (308.705))				
(12.120)	Bayerische Motoren Werke AG 20-Oct-2023	(61.212)	(0,04)	
7.000	Deutsche Boerse AG 06-Nov-2023	(34.896)	(0,03)	
(28.671)	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 20-Oct-2023	(75.285)	(0,05)	
(14.000)	Hannover Rueck SE 27-Jun-2023	(204.786)	(0,15)	
(3.150)	Nemetschek AG 20-Oct-2023	(4.998)	(0,00)	
5.359	RWE AG 17-Jan-2023	(2.128)	(0,00)	
(4.000)	SAP SE 20-Oct-2023	(22.366)	(0,02)	
(5.935)	Traton AG 27-Jun-2023	(10.247)	(0,01)	
(20.000)	Zalando SE NPV 17-Jan-2023	(44.351)	(0,03)	
Irland - (35.373)				
(31. Dezember 2021: (14.102))				
41.766	CRH Plc 17-Jan-2023	(35.373)	(0,02)	
Italien - (684.390)				
(31. Dezember 2021: (37.933))				
(72.076)	Azimut Holding 20-Oct-2023	(350.770)	(0,25)	
(23.250)	Interpump Group SpA 20-Oct-2023	(124.537)	(0,09)	
(800.000)	Intesa Sanpaolo SpA 06-Nov-2023	(57.824)	(0,04)	
(14.800)	Moncler SpA 20-Oct-2023	(59.696)	(0,04)	
(20.861)	Snam Rete Gas S.A. 20-Oct-2023	(6.743)	(0,01)	
(11.440)	Traton AG 27-Jun-2023	(18.385)	(0,01)	
(160.000)	UniCredit SpA 20-Oct-2023	(68.435)	(0,05)	
Niederlande - (561.409)				
(31. Dezember 2021: (72.129))				
(65.430)	ABN AMRO Bank N.V. 20-Oct-2023	(94.330)	(0,07)	
(17.250)	Arcadis N.V. 20-Oct-2023	(48.163)	(0,04)	
2.451	ASM International Ltd 27-Jun-2023	(48.091)	(0,03)	
(2.180)	ASML Holding N.V. 27-Jun-2023	(113.630)	(0,08)	
(24.859)	Corbioin NV 06-Nov-2023	(103.173)	(0,07)	
31.786	STMicroelectronics N.V. 27-Jun-2023	(63.649)	(0,05)	
15.035	Worldline SA 20-Oct-2023	(90.373)	(0,06)	
Spanien - (545.877)				
(31. Dezember 2021: (168.039))				
27.500	Amadeus IT Group SA 20-Oct-2023	(40.833)	(0,03)	
(720.000)	Caixabank S.A 20-Oct-2023	(179.784)	(0,13)	
(181.522)	Grifols SA 06-Nov-2023	(320.830)	(0,23)	
(47.572)	Red Electrica Corporacion SA 06-Nov-2023	(4.430)	(0,00)	
Schweden - (167.370)				
(31. Dezember 2021: (200.701))				
(15.000)	Epiroc AB 20-Oct-2023	(25.099)	(0,02)	
(46.304)	Nordnet Bank AB 20-Oct-2023	(17.025)	(0,01)	
(25.000)	Sandvik AB 06-Nov-2023	(25.266)	(0,02)	
(220.000)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 20-Oct-2023	(33.494)	(0,02)	
(85.000)	Swedbank AB 20-Oct-2023	(47.502)	(0,04)	
(65.890)	Volvo AB 06-Nov-2023	(18.984)	(0,01)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %	
Aktien-Swaps Forts.				
Schweiz - (466.759)				
(31. Dezember 2021: (100.102))				
500.000	Credit Suisse Group AG 06-Nov-2023	(112.963)	(0,08)	
9.000	Julius Baer Group 20-Oct-2023	(4.295)	(0,00)	
(33.173)	LafargeHolcim 27-Jun-2023	(204.977)	(0,15)	
(4.571)	Novartis AG 20-Oct-2023	(29.116)	(0,02)	
(4.000)	The Swatch Group AG 20-Oct-2023	(111.279)	(0,08)	
(65.000)	UBS Group AG 20-Oct-2023	(1.418)	(0,00)	
600	Zurich Insurance Group Ltd 20-Oct-2023	(2.711)	(0,00)	
Vereinigtes Königreich - (823.302)				
(31. Dezember 2021: (811.315))				
(80.000)	3i Group Plc 20-Oct-2023	(36.878)	(0,03)	
(200.000)	Abrdn Plc 17-Jan-2023	(11.968)	(0,01)	
430.000	Ashtead Group Plc 17-Jan-2023	(102.238)	(0,07)	
165.000	Auto Trader Group Plc 17-Jan-2023	(90.750)	(0,07)	
(480.000)	Barclays Plc 06-Nov-2023	(6.331)	(0,00)	
26.500	Berkeley Group Holdings Plc 17-Jan-2023	(2.915)	(0,00)	
113.000	BP Plc 20-Oct-2023	(14.372)	(0,01)	
8.000	British American Tobacco Plc 06-Nov-2023	(6.880)	(0,01)	
34.000	Burberry Group Plc 17-Jan-2023	(17.299)	(0,01)	
25.000	Computacenter Plc 17-Jan-2023	(36.000)	(0,03)	
(28.750)	Diageo Plc 20-Oct-2023	(12.505)	(0,01)	
23.000	Experian Plc 17-Jan-2023	(27.134)	(0,02)	
40.000	Informa Plc 06-Nov-2023	(53)	(0,00)	
70.000	Intermediate Capital Group 17-Jan-2023	(60.378)	(0,04)	
400.000	Man Group Plc 20-Oct-2023	(17.866)	(0,01)	
200.745	National Grid Plc 17-Jan-2023	(33.526)	(0,02)	
500.000	Ninety One Plc 17-Jan-2023	(164.250)	(0,12)	
20.000	Rathbones Group Plc 17-Jan-2023	(1.000)	(0,00)	
(11.700)	Reckitt Benckiser Group Plc 17-Jan-2023	(9.945)	(0,01)	
65.000	Relx Plc 17-Jan-2023	(17.685)	(0,01)	
5.168	Rotork Plc 17-Jan-2023	(14)	(0,00)	
4.561	Shell Plc 27-Jun-2023	(194)	(0,00)	
62.072	Smurfit Kappa Group Plc 17-Jan-2023	(86.280)	(0,06)	
47.000	Tate & Lyle Plc 17-Jan-2023	(3.107)	(0,00)	
60.000	Weir Group 17-Jan-2023	(54.000)	(0,04)	
10.000	Whitbread Plc 17-Jan-2023	(9.734)	(0,01)	
Vereinigte Staaten von Amerika - (163.515)				
(31. Dezember 2021: (122.366))				
(105.000)	Navient Corp 06-Nov-2023	(163.095)	(0,12)	
(632)	Tesla Inc 06-Nov-2023	(420)	(0,00)	
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		(4.375.823)	(3,13)	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Summe Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (48.982)				
(31. Dezember 2021: (291.805))				
(92)	FTSE 100 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(6.867.800)	(7.716)	(0,00)
(11)	IBEX 35 Index Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(803.039)	(1.554)	(0,00)
3	NASDAQ 100 E-Mini Long Futures Contracts Exp Mar-2023	549.850	(39.712)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(48.982)	(0,03)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (151.729) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (2.261.617))			(151.729)	(0,11)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(5.563.499)	(3,98)
Nettoumlaufvermögen			3.557.830	2,55
Summe Nettovermögen			139.786.504	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	37,39
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	49,40
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,15
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	8,22
Sonstiges Umlaufvermögen	4,84
Gesamtvermögen	100,00

Die Kontrahenten für Aktienindex-Swaps sind ank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC und JPMorgan Chase Bank.

Die Kontrahenten für Aktien-Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.

Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							
Dänische Krone	Pfund Sterling	800.000	94.550	11. Jan. 23	Morgan Stanley	895	
Euro	Pfund Sterling	650.000	580.124	11. Jan. 23	Morgan Stanley	16.518	
Euro	Pfund Sterling	575.000	498.959	11. Jan. 23	Morgan Stanley	11.148	
Euro	Pfund Sterling	400.000	350.084	11. Jan. 23	RBC Capital Markets	4.773	
Euro	Pfund Sterling	1.250.000	1.093.006	11. Jan. 23	Morgan Stanley	15.921	
Euro	Pfund Sterling	1.850.000	1.597.888	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	43.525	
Euro	Pfund Sterling	80.000	70.807	11. Jan. 23	Morgan Stanley	164	
Pfund Sterling	US-Dollar	156.095	175.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	10.788	
						GBP	103.712

Pfund Sterling	Dänische Krone	162.620	1.400.000	11. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(4.408)	
Pfund Sterling	Euro	704.956	800.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(4.757)	
Pfund Sterling	Euro	302.753	350.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(7.747)	
Pfund Sterling	Euro	432.124	500.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(11.447)	
Pfund Sterling	Euro	174.871	200.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(2.557)	
Pfund Sterling	Euro	872.912	1.000.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(14.230)	
Pfund Sterling	Euro	435.653	500.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(7.918)	
Pfund Sterling	Euro	306.800	350.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.700)	
Pfund Sterling	Euro	956.220	1.100.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(19.636)	
Pfund Sterling	Euro	4.216.469	4.800.000	11. Jan. 23	RBC Capital Markets	(41.814)	
Pfund Sterling	Schweizer Franken	244.871	280.000	11. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(7.398)	
Pfund Sterling	Schweizer Franken	194.943	220.000	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.268)	
Schweizer Franken	Pfund Sterling	350.000	318.487	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.151)	
US-Dollar	Pfund Sterling	200.000	167.370	11. Jan. 23	RBC Capital Markets	(1.281)	
						GBP	(133.312)

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

Schweizer Franken	Pfund Sterling	306.373	267.819	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.260	
						GBP	8.260
						CHF	9.175

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

Euro	Pfund Sterling	8.077	7.136	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30	
Euro	Pfund Sterling	1.421.502	1.220.232	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	40.954	
						GBP	40.984
						EUR	46.214
Pfund Sterling	Euro	9.401	10.680	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(74)	
Pfund Sterling	Euro	17.061	19.446	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(192)	
						GBP	(266)
						EUR	(300)

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

Euro	Pfund Sterling	331.065	292.336	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.261
Euro	Pfund Sterling	23.907	21.150	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	53
Euro	Pfund Sterling	10.000	8.850	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22
Euro	Pfund Sterling	211.644	186.986	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	789
Euro	Pfund Sterling	1.427	1.252	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Euro	Pfund Sterling	7.873	6.899	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	86
Euro	Pfund Sterling	2.917	2.542	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	46
Euro	Pfund Sterling	57	49	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	Pfund Sterling	4.790	4.112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	138

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR R (Hedged) Forts.							
Euro	Pfund Sterling	38.818.342	33.322.079	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.118.378	
						GBP	1.120.788
						EUR	1.263.820

Pfund Sterling	Euro	8.846	10.000	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)	
Pfund Sterling	Euro	21.158	23.907	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)	
Pfund Sterling	Euro	292.410	331.065	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.318)	
Pfund Sterling	Euro	2.361	2.682	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)	
Pfund Sterling	Euro	52.356	59.342	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(293)	
Pfund Sterling	Euro	33.771	38.492	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(380)	
Pfund Sterling	Euro	13.144	15.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(165)	
Pfund Sterling	Euro	26.760	30.711	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(488)	
Pfund Sterling	Euro	41.604	47.637	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(661)	
Pfund Sterling	Euro	137.973	159.737	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.749)	
Pfund Sterling	Euro	179	207	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
Pfund Sterling	Euro	33.802	39.220	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(995)	
						GBP	(8.148)
						EUR	(9.188)

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

Euro	Pfund Sterling	17.872	15.811	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	40	
Euro	Pfund Sterling	11.461	10.125	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	43	
Euro	Pfund Sterling	2.089.352	1.793.522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60.195	
						GBP	60.278
						EUR	67.970
Pfund Sterling	Euro	15.817	17.872	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(40)	
						GBP	(40)
						EUR	(45)

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

Euro	Pfund Sterling	12.405	10.954	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	47
Euro	Pfund Sterling	14.488	12.817	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	32
Euro	Pfund Sterling	84.355	72.702	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.139
Euro	Pfund Sterling	4.957	4.255	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	143
Euro	Pfund Sterling	2.300	1.983	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58
Euro	Pfund Sterling	1.836	1.586	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	43
Euro	Pfund Sterling	6.065	5.297	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	84
Euro	Pfund Sterling	2.030	1.769	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	32
Euro	Pfund Sterling	1.125	986	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12
Euro	Pfund Sterling	554	486	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6
Euro	Pfund Sterling	21.627	19.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	107
Euro	Pfund Sterling	10.091	8.883	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	70
Euro	Pfund Sterling	124.159	109.694	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	463
Euro	Pfund Sterling	7.537	6.657	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR T (Hedged) Forts.							
Euro	Pfund Sterling	11.877	10.511	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27	
Euro	Pfund Sterling	12.476	10.754	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	315	
Euro	Pfund Sterling	21.817.122	18.728.050	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	628.563	
						GBP	632.171
						EUR	712.847
Pfund Sterling	Euro	6.655	7.537	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(29)	
Pfund Sterling	Euro	10.507	11.877	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)	
Pfund Sterling	Euro	12.822	14.488	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32)	
Pfund Sterling	Euro	10.957	12.405	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(49)	
Pfund Sterling	Euro	2.258	2.559	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)	
Pfund Sterling	Euro	13.810	15.740	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(155)	
Pfund Sterling	Euro	60.067	68.550	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(752)	
Pfund Sterling	Euro	18.933	21.728	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(345)	
Pfund Sterling	Euro	346.048	396.228	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.494)	
Pfund Sterling	Euro	4.331	5.014	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(118)	
Pfund Sterling	Euro	26.707	30.979	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(778)	
Pfund Sterling	Euro	2.227	2.595	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(75)	
Pfund Sterling	Euro	5.082	5.896	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(150)	
Pfund Sterling	Euro	11.661	13.528	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(342)	
						GBP	(8.358)
						EUR	(9.425)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Hedged)							
Euro	Pfund Sterling	2.628	2.321	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10	
Euro	Pfund Sterling	2.400	2.123	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	Pfund Sterling	5.000	4.425	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11	
Euro	Pfund Sterling	374.752	331.092	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.397	
Euro	Pfund Sterling	2.488	2.180	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27	
Euro	Pfund Sterling	19.950	17.232	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	468	
Euro	Pfund Sterling	9.973	8.561	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	287	
Euro	Pfund Sterling	9.995	8.615	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	253	
Euro	Pfund Sterling	64.404.656	55.285.644	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.855.534	
Pfund Sterling	Euro	12	13	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
						GBP	1.857.992
						EUR	2.095.103
Pfund Sterling	Euro	4.423	5.000	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)	
Pfund Sterling	Euro	2.124	2.400	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
Pfund Sterling	Euro	2.321	2.628	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(10)	
Pfund Sterling	Euro	1.935	2.198	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)	
Pfund Sterling	Euro	25.641	29.225	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(288)	
Pfund Sterling	Euro	30.727	35.067	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(385)	
Pfund Sterling	Euro	3.934	4.515	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(72)	
Pfund Sterling	Euro	285	327	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Hedged) Forts.							
Pfund Sterling	Euro	2.428	2.811	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(66)	
Pfund Sterling	Euro	779	904	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)	
Pfund Sterling	Euro	7.445	8.673	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(250)	
Pfund Sterling	Euro	16.032	18.602	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(472)	
						GBP	(1.602)
						EUR	(1.806)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR U (Inc) (Hedged)							
Euro	Pfund Sterling	18	16	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
						GBP	1
						EUR	1
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD R (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	18.163	13.402	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20	
US-Dollar	Pfund Sterling	3.084.204	2.504.105	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57.006	
						GBP	57.026
						USD	68.654
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD T (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	670.746	544.587	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12.398	
						GBP	12.398
						USD	14.926
US-Dollar	Pfund Sterling	4.335	3.602	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
						GBP	(2)
						USD	(2)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse USD U (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	452.794	367.629	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.369	
						GBP	8.369
						USD	10.075
US-Dollar	Pfund Sterling	2.954	2.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
						GBP	(1)
						USD	(1)

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 9.456.426			
(31. Dezember 2021: 6.876.198)			
97.177	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	9.456.426	8,36
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		9.456.426	8,36
Anleihen			
Österreich - 10.490.445			
(31. Dezember 2021: 4.102.501)			
10.500.000	Austria Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	10.490.445	9,27
Frankreich - 23.917.040			
(31. Dezember 2021: 48.777.118)			
17.500.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2023	17.499.650	15,47
10.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 11-Jan-2023	9.999	0,01
300.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2023	299.889	0,26
2.000.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 25-Jan-2023	1.998.940	1,77
700.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 01-Feb-2023	699.377	0,62
100.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 08-Feb-2023	99.870	0,09
15.000	Safran SA 0.875% 15-May-2027	2.029.785	1,79
42.000	Veolia Environnement SA (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2025	1.279.530	1,13
Niederlande - 8.509.800			
(31. Dezember 2021: 2.433.215)			
1.000.000	Netherlands Government Bond '144A' 3.750% 15-Jan-2023	999.300	0,88
7.500.000	Netherlands Government Bond '144A' 7.500% 15-Jan-2023	7.510.500	6,64
Supranational - 18.697.659			
(31. Dezember 2021: -)			
3.000.000	European Stability Mechanism Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Jan-2023	2.999.700	2,65
15.700.000	European Union Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2023	15.697.959	13,88
Gesamtanlagen in Anleihen		61.614.944	54,46
Einlagenzertifikate			
Belgien - 3.991.168			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.000% 07-Feb-2023 CD	3.991.168	3,53
Frankreich - 3.991.474			
(31. Dezember 2021: -)			
1.000.000	Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.000% 06-Feb-2023 CD	997.868	0,88
3.000.000	Credit Agricole Corporate & Investment Bank 0.000% 06-Feb-2023 CD	2.993.606	2,65
Vereinigtes Königreich - 999.610			
(31. Dezember 2021: -)			
1.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0.000% 06-Jan-2023 CD	999.610	0,88
Gesamtanlagen in Einlagenzertifikaten		8.982.252	7,94
Commercial Paper			
Kanada - 3.474.550			
(31. Dezember 2021: -)			
3.500.000	Toronto-Dominion Bank 0.000% 02-May-2023 CP	3.474.550	3,07
Finnland - 3.982.140			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Finland T-Bill 0.000% 13-Mar-2023 CP	3.982.140	3,52

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Commercial Paper Forts.			
Frankreich - 3.992.942			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	BPCE SA 0.000% 01-Feb-2023 CP	3.992.942	3,53
Luxemburg - 3.997.826			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Nestle Finance International Ltd 0.000% 09-Jan-2023 CP	3.997.826	3,53
Niederlande - 7.979.591			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Nederlandse Waterschapsbank 0.000% 10-Jan-2023 CP	3.998.767	3,53
4.000.000	Rabobank International 0.000% 23-Mar-2023 CP	3.980.824	3,52
Norwegen - 3.992.993			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Kommunalbanken AS 0.000% 31-Jan-2023 CP	3.992.993	3,53
Spanien - 3.998.478			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Banco Santander SA 0.000% 06-Jan-2023 CP	3.998.478	3,53
Vereinigte Staaten von Amerika - 3.999.056			
(31. Dezember 2021: -)			
4.000.000	Colgate-Palmolive Company 0.000% 05-Jan-2023 CP	3.999.056	3,54
Gesamtanlagen in Commercial Paper		35.417.576	31,30
Vorzugsanleihen			
Vereinigte Staaten von Amerika - 775.405			
(31. Dezember 2021: -)			
16.500	Chart Industries Inc - Preferred Stock 6.750% 15-Dec-2025	775.405	0,68
Gesamtanlagen in Vorzugsanleihen		775.405	0,68
Aktien-Swaps			
China - 46.919			
(138.000)	Longfor Group Holdings Ltd '144A' 19-Jun-2023	46.919	0,04
Frankreich - 172.369			
(3.540)	Pernod Ricard SA 19-Jun-2023	10.829	0,01
(10.800)	Sanofi 19-Jun-2023	119.646	0,11
(35.094)	Ubisoft Entertainment SA 19-Jun-2023	2.041	0,00
(15.598)	Veolia Environnement SA 19-Jun-2023	39.853	0,03
Japan - 99.307			
(29.500)	DMG Mori Co Ltd 19-Jun-2023	35.755	0,03
(19.800)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd 19-Jun-2023	63.552	0,06
Niederlande - 75.593			
(25.800)	JDE Peet's NV 19-Jun-2023	75.593	0,07
Schweiz - 511.381			
(23.400)	Sika AG 19-Jun-2023	511.381	0,45
Vereinigte Staaten von Amerika - 5.201.607			
(5.100)	Axon Enterprise Inc 20-Jun-2023	34.269	0,03
(3.000)	Blackline Inc 20-Jun-2023	1.648	0,00
(1.146)	Booking Holdings Inc 20-Jun-2023	283.103	0,25
(5.400)	Chart Industries Inc 20-Jun-2023	13.568	0,01
(10.200)	Chefs' Warehouse Inc/The 20-Jun-2023	39.990	0,03
(10.500)	CyberArk Software Ltd 20-Jun-2023	100.703	0,09
(3.960)	Etsy Inc 20-Jun-2023	68.133	0,06
(108.000)	Ford Motor Co 20-Jun-2023	221.683	0,20
(28.200)	FTI Consulting Inc 20-Jun-2023	255.132	0,23
(12.840)	Halozyne Therapeutics Inc 20-Jun-2023	2.939	0,00
(15.000)	InterDigital Inc 20-Jun-2023	192.429	0,17
(22.860)	Lantheus Holdings Inc 20-Jun-2023	76.463	0,07
(11.700)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 20-Jun-2023	97.044	0,09
(24.600)	Lumentum Holdings Inc 20-Jun-2023	135.005	0,12
(6.800)	Marriott Vacations Worldwide Corp 20-Jun-2023	42.822	0,04
(7.200)	Microsoft Corp 20-Jun-2023	212.386	0,19
(16.800)	Middleby Corp/The 20-Jun-2023	233.672	0,21
(33.000)	MP Materials Corp 20-Jun-2023	434.424	0,38

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktien-Swaps Forts.			
(46.620)	NextGen Healthcare Inc 20-Jun-2023	57.819	0,05
(57.000)	Northern Oil and Gas Inc 20-Jun-2023	125.109	0,11
(46.800)	NRG Energy Inc 20-Jun-2023	55.711	0,49
(59.100)	Palo Alto Networks Inc 20-Jun-2023	1.472.285	1,30
(58.800)	Pebblebrook Hotel Trust (REIT) 20-Jun-2023	217.371	0,19
(10.800)	Silicon Laboratories Inc 20-Jun-2023	61.321	0,05
(30.600)	Southwest Airlines Co 20-Jun-2023	149.372	0,13
(2.400)	Splunk Inc 20-Jun-2023	21.001	0,02
(1.260)	Tyler Technologies Inc 20-Jun-2023	6.969	0,01
(16.800)	Voya Financial Inc 20-Jun-2023	87.236	0,08
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		6.107.176	5,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Total Return Swaps			
Belgien - 36.900			
(30.150)	TRS Groupe Bruxelles Lambert SA 2.125% 19-Jun-2023	36.900	0,03
Frankreich - 21.710			
(77.650)	TRS Ubisoft Entertainment 2.375% 19-Jun-2023	21.710	0,02
Italien - 27.870			
(42.600)	TRS Prysmian SpA 0.000% 19-Jun-2023	27.870	0,02
Japan - 52.577			
(21.750.000)	Takashimaya Company Limited 0.000% 19-Jun-2023	33.099	0,03
(29.515.000)	TRS Nippon Steel Corp 0.000% 19-Jun-2023	19.478	0,02
Luxemburg - 198.607			
12.090	TRS Oliver Capital Sarl 0.000% 19-Jun-2023	198.607	0,18
Singapur - 7.062			
(75.750)	TRS Singapore Airlines Ltd 1.625% 19-Jun-2023	7.062	0,01
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.405.279			
(1.360.605)	TRS Allegheny Technologies 3.500% 20-Jun-2023	149.839	0,13
434.156	TRS Bentley Systems Inc 0.001% 20-Jun-2023	141.955	0,13
(62.063)	TRS Biomarín Pharmaceutical 0.599% 20-Jun-2023	49.304	0,04
173.689	TRS Blackline Inc 0.000% 20-Jun-2023	1.812	0,00
(61.887)	TRS Block Inc 0.500% 15-May-2023	20.772	0,02
(43.636)	TRS Envestnet Inc 2.625% 20-Jun-2023	68.535	0,06
65.700	TRS Halozyme Therapeutics Inc 0.250% 20-Jun-2023	16.185	0,01
46.440	TRS JPMorgan Chase Bank NA 0.000% 19-Jun-2023	99.414	0,09
(69.120)	TRS JPMorgan Chase Bank NA 0.000% 19-Jun-2023	24.634	0,02
(49.080)	TRS JPMorgan Chase Bank NA 0.000% 19-Jun-2023	105.840	0,09
(2.128.721)	TRS KBR Inc 0.025% 20-Jun-2023	507.897	0,45
(88.662)	TRS Parsons Corp 0.003% 20-Jun-2023	155.110	0,14
(149.593)	TRS Post Holdings Inc 2.500% 20-Jun-2023	45.894	0,04
77.679	TRS Vishay Intertechnology Inc 2.250% 20-Jun-2023	18.088	0,02
Total Return Swaps insgesamt		1.750.005	1,55

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 242.348				
(31. Dezember 2021: 3.315)				
(9)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.623.102)	57.298	0,05
(18)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.083.500)	77.203	0,07
(4)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(4.141.624)	76.637	0,07
(2)	NASDAQ 100 E-Mini Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(411.873)	27.505	0,02

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(6)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(629.437)	3.705	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			242.348	0,21
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 54.537 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 945.054)				
			54.537	0,05
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			124.400.669	109,95

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %	
Aktien-Swaps				
Frankreich - (135.123)				
(31. Dezember 2021: –)				
(282)	Euroapi SA 19-Jun-2023	(3.907)	(0,00)	
(1.200)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 19-Jun-2023	(81.440)	(0,07)	
(10.200)	Safran SA 19-Jun-2023	(49.776)	(0,05)	
Deutschland - (45.323)				
(31. Dezember 2021: (376.377))				
(48.000)	GEA Group AG 19-Jun-2023	(6.352)	(0,01)	
(2.072)	MTU Aero Engines AG 28-Feb-2023	(1.213)	(0,00)	
(3.600)	Siemens AG 19-Jun-2023	(37.758)	(0,03)	
Italien - (34.295)				
(31. Dezember 2021: –)				
(24.000)	Prysmian SpA 19-Jun-2023	(34.295)	(0,03)	
Japan - (155.570)				
(31. Dezember 2021: (20.629))				
(50.400)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd 19-Jun-2023	(44.440)	(0,04)	
(81.200)	Nippon Steel Corp 19-Jun-2023	(49.653)	(0,05)	
(19.000)	Nipro Corp 19-Jun-2023	(1.420)	(0,00)	
(60.000)	Takashimaya Co Ltd 19-Jun-2023	(60.057)	(0,05)	
Singapur - (31.954)				
(31. Dezember 2021: –)				
(151.200)	Singapore Airlines Ltd 19-Jun-2023	(31.954)	(0,03)	
Vereinigte Staaten von Amerika - (1.168.963)				
(31. Dezember 2021: (6.310.102))				
(87.000)	ATI Inc 20-Jun-2023	(191.750)	(0,17)	
(26.112)	Bentley Systems Inc - Class B 20-Jun-2023	(66.478)	(0,06)	
(7.200)	BioMarín Pharmaceutical Inc 20-Jun-2023	(81.290)	(0,07)	
(12.900)	Block Inc 20-Jun-2023	(48.123)	(0,04)	
(13.200)	Envestnet Inc 20-Jun-2023	(63.400)	(0,05)	
(91.500)	KBR Inc 20-Jun-2023	(483.221)	(0,43)	
(27.000)	Parsons Corp 20-Jun-2023	(145.825)	(0,13)	
(20.700)	Post Holdings Inc 20-Jun-2023	(40.838)	(0,04)	
(22.200)	Vishay Intertechnology Inc 20-Jun-2023	(48.038)	(0,04)	
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps			(1.571.228)	(1,39)
Total Return Swaps				
Hongkong - (290.592)				
(1.207.600)	TRS Citigroup Global Markets Limited 0.000% 19-Jun-2023	(290.592)	(0,26)	
Japan - (168.882)				
(14.089.000)	TRS Dmg Mori Co Ltd 0.000% 19-Jun-2023	(71.246)	(0,06)	
(23.768.000)	TRS Koei Tecmo Holdings Co Ltd 0.000% 19-Jun-2023	(14.364)	(0,01)	
(48.000.000)	TRS Kyoritsu Maintenance Co Ltd 0.000% 19-Jun-2023	(68.334)	(0,06)	
(2.736.000)	TRS Nipro Corp 0.000% 19-Jun-2023	(14.938)	(0,01)	
Niederlande - (82.096)				
(18.676)	TRS Mondelez International Holdings Netherlands B.V. 0.000% 19-Jun-2023	(82.096)	(0,07)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	
Schweiz - (567.907)				
(2.152.710)	TRS Sika AG 0.002 % 19-Jun-2023	(567.907)	(0,50)	
Vereinigte Staaten von Amerika - (6.141.221)				
(38.700)	TRS Axon Enterprise Inc 0.500% 20-Jun-2023	(42.879)	(0,04)	
(758.160)	TRS Barclays Bank Plc 0.000% 20-Jun-2023	(192.692)	(0,17)	
(1.271.586)	TRS Booking Holdings Inc 0.008% 20-Jun-2023	(243.705)	(0,22)	
(308.731)	TRS CyberArk Software Ltd 0.000% 20-Jun-2023	(123.172)	(0,11)	
(288.228)	TRS Deutsche Bank AG 1.000% 01-May-2023	(249.991)	(0,22)	
(39.735)	TRS Etsy Inc 0.125% 20-Jun-2023	(34.317)	(0,03)	
(137.950)	TRS Ford Motor Company 0.000% 20-Jun-2023	(273.203)	(0,24)	
(2.088.519)	TRS FTI Consulting Inc 2.000% 20-Jun-2023	(331.187)	(0,29)	
(93.642)	TRS Interdigital Inc 3.500% 20-Jun-2023	(199.581)	(0,18)	
(110.456)	TRS Lantheus Holdings Inc 2.625% 20-Jun-2023	(69.836)	(0,06)	
(79.952)	TRS Liberty Media Corp-Liberty Formula One 0.023% 20-Jun-2023	(141.111)	(0,12)	
(271.272)	TRS Lumentum Holdings Inc 0.250% 20-Jun-2023	(132.348)	(0,12)	
(42.381)	TRS Marriott Vacation Worldwide 0.033% 20-Jun-2023	(59.210)	(0,05)	
(830.475)	TRS Middleby Corp 1.000% 20-Jun-2023	(269.956)	(0,24)	
(249.186)	TRS MP Materials Corp 0.003% 20-Jun-2023	(504.634)	(0,45)	
249.000	TRS MTU Aero Engines 0.500% 28-Feb-2023	(4.400)	(0,00)	
(113.952)	TRS NextGen Healthcare 3.750% 20-Jun-2023	(30.370)	(0,03)	
(269.276)	TRS Northern Oil and Gas Inc 3.625% 20-Jun-2023	(27.349)	(0,02)	
(709.186)	TRS NRG Energy Inc 2.750% 20-Jun-2023	(684.372)	(0,61)	
(2.276.460)	TRS Palo Alto Networks Inc 0.004 % 20-Jun-2023	(777.205)	(0,69)	
(2.895.540)	TRS Palo Alto Networks Inc 0.008 % 20-Jun-2023	(1.072.483)	(0,95)	
145.090	TRS Pebblebrook Hotel Trust 0.018% 20-Jun-2023	(299.556)	(0,27)	
(542.277)	TRS Silicon Laboratories Inc 0.006% 20-Jun-2023	(78.805)	(0,07)	
(531.197)	TRS Southwest Airlines Co 0.013% 20-Jun-2023	(151.942)	(0,13)	
8.106	TRS Splunk Inc 0.500% 20-Jun-2023	(80.708)	(0,07)	
(93.636)	TRS The Chefs' Warehouse Inc 1.875% 20-Jun-2023	(55.104)	(0,05)	
69.689	TRS Tyler Technologies Inc 0.003% 20-Jun-2023	(11.105)	(0,01)	
Total Return Swaps insgesamt		(7.250.698)	(6,41)	
Credit Default Swaps - (5.441)				
(31. Dezember 2021: -)				
1.000.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(5.441)	(0,01)	
Credit Default Swaps insgesamt		(5.441)	(0,01)	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (14.768)				
(31. Dezember 2021: (15.470))				
6	CBOE Volatility Index® (VX) Long Futures Contracts Exp Feb-2023	137.579	(4.639)	(0,00)
(47)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.004.312)	(9.997)	(0,01)
(15)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.512.396)	(132)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(14.768)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.909.441) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (37.677))				
			(1.909.441)	(1,69)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(10.751.576)	(9,51)
Kurzfristige Nettoverbindlichkeiten			(506.900)	(0,44)
Summe Nettovermögen			113.142.193	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	56,00
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	34,60
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,19
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	6,17
Sonstiges Umlaufvermögen	3,04
Gesamtvermögen	100,00

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

Euro	US-Dollar	306.324	325.000	16. Feb. 23	Bank of America Merrill Lynch	3.650
Euro	US-Dollar	282.541	300.000	16. Feb. 23	Bank of America Merrill Lynch	3.150
						EUR 6.800

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

Euro	Schweizer Franken	7.354.635	7.242.661	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33.989
Euro	Schweizer Franken	14.276	14.068	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Euro	Schweizer Franken	299.555	295.508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	865
Euro	Schweizer Franken	17.466	17.221	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	Schweizer Franken	5.419	5.338	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	24
						EUR 34.994

Schweizer Franken	Euro	11.757	11.936	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)
Schweizer Franken	Euro	527	535	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Schweizer Franken	Euro	8.657.971	8.804.927	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53.732)
						EUR (53.787)
						CHF (53.238)

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

Schweizer Franken	Euro	116	117	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Schweizer Franken	117	116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
						EUR -

Schweizer Franken	Euro	11.192.695	11.382.674	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(69.462)
						EUR (69.462)
						CHF (68.753)

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

Euro	Pfund Sterling	60.706	53.500	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	284
Euro	Pfund Sterling	11.412	10.055	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60
Euro	Pfund Sterling	6.666	5.828	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	87
Euro	Pfund Sterling	5.619	4.900	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	87
Euro	Pfund Sterling	101.151	88.362	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.401
Euro	Pfund Sterling	36.081	31.045	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.035
Euro	Pfund Sterling	33.383	28.747	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	932
Euro	Pfund Sterling	32.212	27.827	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	798
						EUR 4.684

Pfund Sterling	Euro	4.388	5.104	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(151)
Pfund Sterling	Euro	14.764	17.160	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(494)
Pfund Sterling	Euro	110.262	127.636	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.162)
						GBP 4.147

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

Pfund Sterling	Euro	18.510.319	21.519.505	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(623.411)
Pfund Sterling	Euro	53.500	60.687	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(291)
Pfund Sterling	Euro	27.642	31.292	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(88)
Pfund Sterling	Euro	4.635	5.260	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28)
Pfund Sterling	Euro	31.626	36.173	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(471)
Pfund Sterling	Euro	17.884	20.506	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(318)
Pfund Sterling	Euro	5.087	5.912	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(169)
Pfund Sterling	Euro	42.676	49.560	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.383)

						EUR (629.966)
						GBP (557.796)

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

Pfund Sterling	Euro	97.297	113.114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.277)
						EUR (3.277)
						GBP (2.902)

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

Euro	Pfund Sterling	810.803	712.644	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.307
						EUR 6.307
						GBP 5.584
Pfund Sterling	Euro	18.437.674	21.435.050	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(620.965)
						EUR (620.965)
						GBP (549.826)

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

Euro	US-Dollar	226.086	240.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.668
Euro	US-Dollar	10.315	10.960	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	84
						EUR 1.752

US-Dollar	Euro	10.858.701	10.212.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(75.350)
US-Dollar	Euro	37.034.471	35.019.099	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(447.125)
						EUR (522.475)
						USD (559.284)

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

US-Dollar	Euro	787.613	744.752	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.509)
						EUR (9.509)
						USD (10.179)

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Republik Korea - 243.212			
	(31. Dezember 2021: 194.610)	243.212	1,30
27.769	Macquarie Korea Infrastructure Fund	243.212	1,30
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		243.212	1,30
Aktien			
Australien - 2.107.710			
	(31. Dezember 2021: 1.273.553)	2.107.710	11,22
80.709	Dexus (REIT)	425.580	2,27
223.853	Insurance Australia Group Ltd	723.753	3,85
31.987	National Australia Bank Ltd	653.683	3,48
34.510	Transurban Group	304.694	1,62
China - 1.276.241			
	(31. Dezember 2021: 842.361)	1.276.241	6,80
79.517	By-health Co Ltd	261.198	1,39
222.341	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	203.108	1,08
91.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	603.616	3,22
118.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	208.319	1,11
Hongkong - 2.701.944			
	(31. Dezember 2021: 1.936.649)	2.701.944	14,39
70.800	AIA Group Ltd	789.372	4,20
13.800	ASMPT Ltd	98.487	0,53
69.000	CLP Holdings Ltd	504.385	2,69
10.641	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	460.224	2,45
115.600	Link REIT (Units) (REIT)	849.476	4,52
Indien - 1.473.826			
	(31. Dezember 2021: 1.152.308)	1.473.826	7,85
34.648	Infosys Ltd ADR	631.806	3,37
41.853	ITC Ltd	167.440	0,89
167.806	ITC Ltd GDR	674.580	3,59
Indonesien - 1.082.218			
	(31. Dezember 2021: 762.736)	1.082.218	5,76
429.500	Bank Mandiri Persero Tbk PT	274.171	1,46
1.472.895	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	466.918	2,48
1.414.256	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	341.129	1,82
Neuseeland - 644.845			
	(31. Dezember 2021: 705.032)	644.845	3,43
28.941	Mercury NZ Ltd	102.323	0,54
91.161	Meridian Energy Ltd	304.946	1,62
69.056	Spark New Zealand Ltd	237.576	1,27
Republik Korea - 1.689.806			
	(31. Dezember 2021: 1.436.637)	1.689.806	9,00
32.540	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	1.298.255	6,91
10.451	SK Telecom Co Ltd	391.551	2,09
Singapur - 3.623.455			
	(31. Dezember 2021: 2.587.373)	3.623.455	19,30
152.900	ComfortDelGro Corp Ltd	140.893	0,75
40.900	DBS Group Holdings Ltd	1.035.736	5,52
127.400	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	356.939	1,90
42.800	Singapore Exchange Ltd	285.972	1,52
206.900	Singapore Technologies Engineering Ltd	517.925	2,76
30.100	United Overseas Bank Ltd	689.925	3,67
46.800	Venture Corp Ltd	596.065	3,18
Südkorea - 319.202			
	(31. Dezember 2021: -)	319.202	1,70
12.577	Hanon Systems	80.515	0,43
8.923	KT Corp	238.687	1,27
Taiwan - 2.105.939			
	(31. Dezember 2021: 2.627.833)	2.105.939	11,21
23.000	Advantech Co Ltd	248.068	1,32
53.000	Elite Material Co Ltd	295.302	1,57

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Taiwan Forts.			
49.000	ITEQ Corp	115.822	0,62
18.000	MediaTek Inc	366.319	1,95
74.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.080.428	5,75
Thailand - 401.069			
	(31. Dezember 2021: 519.216)	401.069	2,14
93.700	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	401.069	2,14
Vereinigtes Königreich - 748.055			
	(31. Dezember 2021: 612.953)	748.055	3,98
10.192	BHP Group Ltd	315.343	1,68
18.139	Woodside Energy Group Ltd	432.712	2,30
Gesamtanlagen in Aktien		18.174.310	96,78
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		18.417.522	98,08
Nettoumlaufvermögen		361.468	1,92
Summe Nettovermögen		18.778.990	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,88	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,12	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON ASIAN OPPORTUNITIES FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 2.088.289			
(31. Dezember 2021: 2.177.219)			
77.122	Allkem Ltd	589.678	1,35
5.825	CSL Ltd	1.139.714	2,62
18.922	OZ Minerals Ltd	358.897	0,83
China - 15.455.414			
(31. Dezember 2021: 22.258.056)			
10.000.000	Boshiwa International Holding Ltd [^]	-	-
398.543	By-health Co Ltd	1.309.137	3,01
121.756	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	1.393.897	3,20
219.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	470.076	1,08
120.964	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	735.438	1,69
65.824	Meituan '144A'	1.474.964	3,39
233.512	NARI Technology Co Ltd 'A'	819.779	1,88
34.400	NetEase Inc	505.129	1,16
138.800	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	966.535	2,22
165.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	1.097.784	2,52
143.900	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1.439.580	3,31
10.500	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	497.390	1,14
27.600	Sungrow Power Supply Co Ltd	443.894	1,02
49.500	Tencent Holdings Ltd	2.121.828	4,87
99.300	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	575.014	1,32
28.714	Yum China Holdings Inc	1.604.969	3,68
Hongkong - 2.675.176			
(31. Dezember 2021: 2.740.097)			
192.000	AIA Group Ltd	2.140.669	4,91
259.083	Vitasoy International Holdings Ltd	534.507	1,23
Indien - 11.620.178			
(31. Dezember 2021: 17.233.333)			
10.605	Asian Paints Ltd	395.588	0,91
67.470	FSN E-Commerce Ventures Ltd	126.491	0,29
54.691	Godrej Consumer Products Ltd	578.196	1,33
90.830	HDFC Bank Ltd	1.790.140	4,11
67.617	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	462.747	1,06
38.324	Hindustan Unilever Ltd	1.187.590	2,73
27.995	Housing Development Finance Corp Ltd	894.195	2,05
43.027	ICICI Bank Ltd	464.206	1,07
28.344	Info Edge India Ltd	1.340.601	3,08
150.054	Marico Ltd	924.529	2,12
5.889	Maruti Suzuki India Ltd	598.907	1,38
52.756	PB Fintech Ltd	285.525	0,66
46.213	Tata Consultancy Services Ltd	1.817.853	4,17
24.016	Titan Co Ltd	753.610	1,73
Indonesien - 1.295.405			
(31. Dezember 2021: 903.771)			
991.800	Bank Mandiri Persero Tbk PT	633.115	1,45
2.089.200	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	662.290	1,52
Niederlande - 1.359.499			
(31. Dezember 2021: 1.703.630)			
2.498	ASML Holding NV	1.359.499	3,12
Neuseeland - 534.965			
(31. Dezember 2021: 1.032.146)			
11.198	Xero Ltd	534.965	1,23
Philippinen - 8			
(31. Dezember 2021: 11)			
1	GT Capital Holdings Inc	8	-
Republik Korea - 2.721.737			
(31. Dezember 2021: 4.117.515)			
18.739	Samsung Electronics Co Ltd	820.248	1,89
2.159	Samsung SDI Co Ltd	1.011.631	2,32
14.993	SK Hynix Inc	889.858	2,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Singapur - 538.556			
(31. Dezember 2021: -)			
10.198	Sea Ltd ADR	538.556	1,24
Taiwan - 4.071.090			
(31. Dezember 2021: 5.971.780)			
79.000	Delta Electronics Inc	737.038	1,69
173.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.525.866	5,80
16.000	Voltron Power Technology Corp	808.186	1,86
Gesamtanlagen in Aktien		42.360.317	97,28
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		42.360.317	97,28
Nettoumlaufvermögen		1.183.903	2,72
Summe Nettovermögen		43.544.220	100,00
* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.			
[^] 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		97,02	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,98	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 1.416.644			
(31. Dezember 2021: 3.174.621)			
30.594	ASX Ltd	1.416.644	3,46
Dänemark - 1.115.745			
(31. Dezember 2021: 2.702.981)			
494	AP Moller - Maersk A/S - Class B	1.115.745	2,72
Frankreich - 3.174.643			
(31. Dezember 2021: 3.486.394)			
2.887	Kering SA	1.469.635	3,59
2.342	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.705.008	4,16
Deutschland - 5.553.526			
(31. Dezember 2021: 3.896.448)			
12.205	Daimler Truck Holding AG	378.717	0,93
23.272	Mercedes-Benz Group AG	1.529.942	3,74
20.430	SAP SE	2.106.998	5,14
22.356	Siemens AG ADR	1.537.869	3,75
Italien - 956.762			
(31. Dezember 2021: 1.197.309)			
177.675	Enel SpA	956.762	2,33
Japan - 2.436.985			
(31. Dezember 2021: 3.134.652)			
36.000	BayCurrent Consulting Inc	1.130.143	2,76
68.100	SBI Holdings Inc	1.306.842	3,19
Niederlande - 2.057.340			
(31. Dezember 2021: -)			
85.391	Universal Music Group NV	2.057.340	5,02
Republik Korea - 810.421			
(31. Dezember 2021: 4.510.067)			
5.898	HYBE Co Ltd	810.421	1,98
Singapur - 828.374			
(31. Dezember 2021: 989.518)			
123.900	Singapore Exchange Ltd	828.374	2,02
Schweiz - 1.479.628			
(31. Dezember 2021: 1.053.716)			
1.488	Swiss Life Holding AG	767.214	1,87
1.489	Zurich Insurance Group AG	712.414	1,74
Taiwan - 792.903			
(31. Dezember 2021: 883.593)			
10.643	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	792.903	1,94
Vereinigte Staaten von Amerika - 18.214.748			
(31. Dezember 2021: 59.838.781)			
5.770	Accenture Plc - Class A	1.539.609	3,76
10.940	Alphabet Inc - Class A	965.236	2,36
8.683	Archer-Daniels-Midland Co	806.260	1,97
271.144	Block Inc	1.706.136	4,16
11.543	Centene Corp	946.699	2,31
4.299	CyberArk Software Ltd	557.494	1,36
3.117	Enphase Energy Inc	825.927	2,02
72.912	Funko Inc - Class A	796.564	1,94
2.405	Globant SA	404.437	0,99
16.579	GXO Logistics Inc	707.509	1,73
2.394	Mastercard Inc	832.669	2,03
23.240	Nasdaq Inc	1.425.774	3,48
30.102	National Bank Holdings Corp	1.266.391	3,09
8.063	NVIDIA Corp	1.178.488	2,88
8.312	Salesforce Inc	1.102.047	2,69
9.315	Signature Bank/New York NY	1.073.088	2,62
5.348	Starbucks Corp	530.442	1,29

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
284.139	WisdomTree Inc	1.549.978	3,78
Gesamtanlagen in Aktien		38.837.719	94,80
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 206.672 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 275.976)		206.672	0,50
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		39.044.391	95,30
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (13.091) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (51.332))		(13.091)	(0,03)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(13.091)	(0,03)
Nettoumlaufvermögen		1.937.520	4,73
Summe Nettovermögen		40.968.820	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,31	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,50	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,19	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	9.862	10.500	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	64	
Euro	US-Dollar	26.086	27.859	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	85	
Euro	US-Dollar	4.177	4.413	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	61	
Euro	US-Dollar	10.319	11.015	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	39	
Euro	US-Dollar	1.521.925	1.610.137	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20.194	
					USD	20.995	
					EUR	19.613	
US-Dollar	Euro	3.109	2.928	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)	
US-Dollar	Euro	1.078	1.011	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	4.536	4.270	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)	
US-Dollar	Euro	16.194	15.207	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(97)	
US-Dollar	Euro	1.929	1.814	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)	
US-Dollar	Euro	19.198	18.059	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(148)	
US-Dollar	Euro	16.826	15.836	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(138)	
US-Dollar	Euro	10.617	9.967	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(60)	
US-Dollar	Euro	22.379	21.062	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(183)	
US-Dollar	Euro	56.136	52.634	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(248)	
					USD	(954)	
					EUR	(891)	
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)							
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.991	1.486	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.463	1.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11	
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.871	1.390	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8	
Singapur-Dollar	US-Dollar	710	528	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Singapur-Dollar	US-Dollar	107.840	79.820	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	709	
					USD	730	
					SGD	978	
US-Dollar	Singapur-Dollar	776	1.045	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	923	1.248	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	544	734	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.074	1.458	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)	
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.706	3.670	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(35)	
					USD	(67)	
					SGD	(90)	
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	86	104	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Pfund Sterling	7.664	6.338	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Pfund Sterling	51	42	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Pfund Sterling	107	88	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Pfund Sterling	274	224	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
					USD	4	
					GBP	3	
Pfund Sterling	US-Dollar	111	138	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
Pfund Sterling	US-Dollar	43	53	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
Pfund Sterling	US-Dollar	6.452	7.933	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(130)	
					USD	(135)	
					GBP	(112)	

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Grundstoffe - 6.892.609			
(31. Dezember 2021: 6.828.200)			
103.373	Gerdau SA - Preference	574.844	1,44
310.300	Gerdau SA ADR	1.739.232	4,36
183.727	Suzano SA	1.678.676	4,21
165.936	Vale SA	2.793.545	7,00
6.300	Vale SA ADR - Class B	106.312	0,27
Kommunikation - 2.710.877			
(31. Dezember 2021: 3.722.746)			
419.577	Americanas SA	765.287	1,92
21.585	Telefonica Brasil SA	156.764	0,39
103.440	Telefonica Brasil SA ADR	749.423	1,88
442.385	TIM SA/Brazil	1.039.403	2,60
Zyklische Konsumgüter - 4.761.374			
(31. Dezember 2021: 5.233.453)			
278.177	Atacadao SA	778.985	1,95
224.705	Cia Brasileira de Distribuicao	702.875	1,76
124.400	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	390.616	0,98
692.589	Sendas Distribuidora SA	2.553.387	6,40
18.279	Sendas Distribuidora SA ADR	335.511	0,84
Nicht-zyklische Konsumgüter - 872.069			
(31. Dezember 2021: -)			
460.392	BRF SA	720.705	1,81
94.308	BRF SA ADR	151.364	0,38
Bildung - 597.432			
(31. Dezember 2021: 768.111)			
309.852	YDUQS Participacoes SA	597.432	1,50
Energie - 1.474.060			
(31. Dezember 2021: 5.447.384)			
45.179	3R PETROLEUM OLEO E GAS SA	323.071	0,81
391.051	Vibra Energia SA	1.150.989	2,88
Finanzwerte - 11.914.977			
(31. Dezember 2021: 8.362.331)			
564.806	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.413.687	3,54
57.027	Banco Bradesco SA - Preference	163.690	0,41
883.846	Banco Bradesco SA ADR	2.567.573	6,44
197.645	Banco BTG Pactual SA (Units)	897.306	2,25
209.860	Banco do Brasil SA	1.380.650	3,46
161.392	BB Seguridade Participacoes SA	1.030.604	2,58
344.513	Bradespar SA - Preference	1.938.956	4,86
145.254	Itau Unibanco Holding SA - Preference	687.651	1,73
4.500	Itau Unibanco Holding SA ADR	21.262	0,05
1.125.849	Itausa SA - Preference	1.813.598	4,55
Lebensmittelverarbeiter - 768.261			
(31. Dezember 2021: 1.656.550)			
465.965	Marfrig Global Foods SA	768.261	1,92
Gesundheitswesen - 1.640.471			
(31. Dezember 2021: 2.438.225)			
753.512	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	725.718	1,82
163.773	Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	914.753	2,29
Industrie - 2.999.089			
(31. Dezember 2021: 3.457.551)			
7.217	Embraer SA	19.567	0,05
105.830	Embraer SA ADR	1.156.193	2,90
1.233.404	Santos Brasil Participacoes SA	1.823.329	4,57
Einkaufszentren - 1.064.053			
(31. Dezember 2021: 1.040.066)			
676.452	BR Malls Participacoes SA	1.064.053	2,67
Versorger - 3.102.563			
(31. Dezember 2021: 3.117.035)			
427.637	AES Brasil Energia SA	782.823	1,96

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Versorger Forts.			
2.306	AES Brasil Energia SA (Right)	103	0,00
94.959	Centrais Eletricas Brasileiras SA - Preference	777.604	1,95
78.164	Cia Paranaense de Energia ADR	565.516	1,42
48.358	CPFL Energia SA	304.084	0,76
48.234	Engie Brasil Energia SA	345.967	0,87
371.879	Light SA	326.466	0,82
Gesamtanlagen in Aktien		38.797.835	97,25
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 26.041 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.996)		26.041	0,06
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		38.823.876	97,31
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.058) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (1.787))		(1.058)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(1.058)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		1.071.601	2,69
Summe Nettovermögen		39.894.419	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			94,83
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,06
Sonstiges Umlaufvermögen			5,11
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	144	153	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	53	57	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	90	95	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	339	360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
Euro	US-Dollar	150	160	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	116	124	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	8.381	8.867	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		82
US-Dollar	Euro	205	192	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	177	166	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	58	54	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	84	79	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	176	165	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
					USD		86
					EUR		81
US-Dollar	Euro	74	70	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
					USD		(1)
					EUR		(1)
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Euro	US-Dollar	85	90	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	12.680	13.512	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		26
Euro	US-Dollar	4.776	5.078	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		22
Euro	US-Dollar	8.039	8.524	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		59
Euro	US-Dollar	30.447	32.342	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		166
Euro	US-Dollar	13.408	14.283	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		32
Euro	US-Dollar	10.446	11.097	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		56
Euro	US-Dollar	753.092	796.741	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		7.342
US-Dollar	Euro	90	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	15.916	14.904	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3
					USD		7.706
					EUR		7.223
US-Dollar	Euro	13.320	12.508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(35)
US-Dollar	Euro	126.750	119.205	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(527)
US-Dollar	Euro	12.091	11.390	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(71)
US-Dollar	Euro	7.538	7.094	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(37)
US-Dollar	Euro	5.233	4.906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(6)
US-Dollar	Euro	18.479	17.312	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(5)
US-Dollar	Euro	6.646	6.278	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(57)
					USD		(738)
					EUR		(692)
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	33.366	35.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		69

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Brazil Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	458.049	486.211	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.853
Euro	US-Dollar	9.575	10.180	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		44
Euro	US-Dollar	16.087	17.058	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		118
Euro	US-Dollar	60.807	64.592	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		332
Euro	US-Dollar	26.875	28.630	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		65
Euro	US-Dollar	20.884	22.185	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		113
Euro	US-Dollar	1.502.609	1.589.700	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		14.649
US-Dollar	Euro	31.719	29.702	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		6
					USD		18.249
					EUR		17.105
US-Dollar	Euro	40.962	38.467	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(109)
US-Dollar	Euro	15.000	14.118	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(73)
US-Dollar	Euro	10.399	9.751	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(12)
US-Dollar	Euro	36.740	34.420	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(11)
US-Dollar	Euro	13.216	12.485	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(114)
					USD		(319)
					EUR		(299)

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Vereinigte Staaten von Amerika - 20.968.150 (31. Dezember 2021: 21.154.917)			
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	1.695.791	7,27
2.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	2.683.770	11,50
3.310.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Mar-2023	3.282.583	14,06
1.900.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2023	1.882.337	8,07
2.900.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	2.870.328	12,30
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	1.677.861	7,19
1.700.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	1.676.072	7,18
1.900.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	1.867.871	8,00
3.400.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	3.331.537	14,27
Gesamtanlagen in Anleihen		20.968.150	89,84

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien-Swaps			
Vereinigte Staaten von Amerika - 119.577 (31. Dezember 2021: 18)			
44.500	Goldman Sachs Commodity Strategy 22-Nov-2023	85.471	0,37
(111.530)	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSCA Index 22-Nov-2023	34.106	0,14
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		119.577	0,51

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps - 15.440 (31. Dezember 2021: 921.017)			
(1.000.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 39 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	5.824	0,02
(900.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	9.616	0,04
Credit Default Swaps insgesamt		15.440	0,06

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 553.131 (31. Dezember 2021: 345.671)				
(71)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(6.426.182)	202.915	0,87
(1)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Apr-2023	(25.875)	2.022	0,01
(5)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Feb-2023	(122.727)	8.520	0,04
(5)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(115.491)	34.656	0,15
(2)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(50.701)	3.044	0,01
(1)	CBOE Volatility Index® (VX) Short Futures Contracts Exp May-2023	(26.200)	447	0,00
(1)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(193.050)	9.636	0,04
(2)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(289.535)	60.671	0,26
(17)	Eurodollar Short Futures Contracts Exp Dec-2023	(4.046.425)	11.005	0,05
(7)	FTSE/JSE Africa Top 40 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(278.991)	13.126	0,06
(5)	Hang Seng China Enterprises Index Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(216.515)	1.797	0,01
(2)	Hang Seng Index Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(255.142)	1.532	0,01
(1)	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(72.713)	933	0,00
14	SGX FTSE Taiwan Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	695.380	665	0,00

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(1)	South Korea Ten Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(86.951)	2.904	0,01
(23)	Three Month Canadian Bankers' Acceptance Rate Short Futures Contracts Exp Dec-2023	(4.055.788)	18.854	0,08
(9)	Three Month EURIBOR Short Futures Contracts Exp Dec-2023	(2.321.687)	10.462	0,04
(55)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(6.176.328)	57.669	0,25
(88)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.497.812)	32.272	0,14
(8)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.002.750)	16.735	0,07
(7)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(940.188)	23.885	0,10
(6)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(724.645)	39.381	0,17
Offene Terminkontrakte insgesamt			553.131	2,37
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 202.904 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 249.524)			202.904	0,87

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		21.859.202	93,65

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien-Swaps			
Vereinigte Staaten von Amerika - (35.659) (31. Dezember 2021: -)			
131.196	Goldman Sachs Equity Synthetic OET CBHSCA Index 22-Nov-2023	(35.659)	(0,15)
Gesamtanlagen in Aktien-Swaps		(35.659)	(0,15)
Credit Default Swaps - (47.527) (31. Dezember 2021: -)			
3.600.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(28.692)	(0,12)
4.100.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(18.835)	(0,08)
Credit Default Swaps insgesamt		(47.527)	(0,20)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (1.080.618) (31. Dezember 2021: (120.124))				
(25)	BOVESPA Index Short Futures Contracts Exp Feb-2023	(526.081)	(16.735)	(0,07)
4	CAC 40 10 Euro Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	277.054	(11.141)	(0,05)
7	Euro STOXX 50 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	283.616	(14.209)	(0,06)
18	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.230.284	(36.315)	(0,16)
25	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.914.837	(223.582)	(0,96)
4	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	569.180	(38.369)	(0,16)
22	Euro-OAT Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.997.904	(210.637)	(0,90)
56	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2023	6.319.427	(74.997)	(0,32)
5	FTSE 100 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	451.301	(1.340)	(0,01)
3	FTSE MIB Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	380.674	(14.413)	(0,06)
9	FTSE-Xinhua China A50 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	117.756	(687)	(0,00)
10	IBEX 35 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	877.159	(13.242)	(0,06)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
9	Japanese 10 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	9.975.160	(185.199)	(0,79)
7	KOSPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	405.289	(20.237)	(0,09)
2	OMX Stockholm 30 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	39.138	(213)	(0,00)
3	S&P TSX 60 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	518.419	(19.332)	(0,08)
25	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.969.044	(109.202)	(0,47)
(59)	SGX MSCI Singapore Index Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(1.279.860)	(6.189)	(0,03)
(20)	SGX Nifty50 Short Futures Contracts Exp Jan-2023	(728.920)	(606)	(0,00)
53	South Korea Three Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	4.335.983	(38.037)	(0,16)
9	SPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.071.114	(29.126)	(0,13)
11	Three Month SONIA Index Long Futures Contracts Exp Dec-2023	3.168.522	(1.509)	(0,01)
5	TOPIX Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	720.626	(15.063)	(0,06)
(2)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(410.156)	(238)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(1.080.618)	(4,63)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (201.075) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (182.082))			(201.075)	(0,86)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.364.879)	(5,84)
Nettoumlaufvermögen			2.844.783	12,19
Summe Nettovermögen			23.339.106	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		82,41		
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		2,17		
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		1,33		
Sonstiges Umlaufvermögen		14,09		
Gesamtvermögen		100,00		

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund							
Brasilianischer Real	US-Dollar	4.800.000	883.051	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	13.909	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	800.000	590.603	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	566	
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.500.000	1.106.335	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	2.107	
Chilenischer Peso	US-Dollar	468.300.000	536.767	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	7.850	
Euro	US-Dollar	300.000	321.606	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	1.108	
Japanischer Yen	US-Dollar	54.300.000	407.609	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	10.137	
Koreanischer Won	US-Dollar	141.900.000	110.885	15. Mrz. 23	Goldman Sachs International	1.984	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	36.500.000	1.827.980	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	20.773	
Polnischer Zloty	US-Dollar	6.700.000	1.509.181	15. Mrz. 23	Goldman Sachs International	10.789	
US-Dollar	Israelischer Schekel	2.059.399	7.000.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs International	60.132	
US-Dollar	Schwedische Krone	463.436	4.700.000	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	11.179	
US-Dollar	Schweizer Franken	2.181.622	2.000.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	1.719	
Ungarischer Forint	US-Dollar	806.800.000	2.058.585	16. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	60.277	
						USD	202.530
Australischer Dollar	US-Dollar	400.000	275.625	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(2.497)	
Australischer Dollar	US-Dollar	700.000	482.236	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(4.262)	
Indische Rupie	US-Dollar	169.000.000	2.037.004	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.992)	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.500.000	968.189	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(15.079)	
Norwegische Krone	US-Dollar	5.100.000	525.529	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.341)	
Pfund Sterling	US-Dollar	200.000	248.771	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(6.551)	
Pfund Sterling	US-Dollar	700.000	868.305	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(20.533)	
Schweizer Franken	US-Dollar	300.000	328.314	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(1.328)	
US-Dollar	Tschechische Krone	283.722	6.500.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(2.795)	
US-Dollar	Euro	964.697	900.000	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(3.445)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	204.828	3.190.200.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs International	(1.077)	
US-Dollar	Japanischer Yen	2.267.557	302.400.000	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(58.896)	
US-Dollar	Koreanischer Won	2.122.198	2.745.000.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(61.208)	
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	2.120.383	9.300.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(12.709)	
US-Dollar	Philippinischer Peso	1.683.683	94.000.000	15. Mrz. 23	Bank of America Merrill Lynch	(845)	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	173.539	3.000.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(1.948)	
						USD	(200.506)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	102	108	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	9.232	9.767	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	122	
						USD	123
						EUR	115
US-Dollar	Euro	117	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
						USD	(1)
						EUR	(1)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	101	108	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	9.207	9.741	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	122	
						USD	123
						EUR	115

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

US-Dollar	Euro	118	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)

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

Euro	US-Dollar	103	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	9.265	9.802	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	123
					USD	124
					EUR	116
US-Dollar	Euro	117	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)

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

Pfund Sterling	US-Dollar	106	128	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	136	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
					USD	1
					GBP	1
Pfund Sterling	US-Dollar	9.359	11.507	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(189)
					USD	(189)
					GBP	(156)

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

Pfund Sterling	US-Dollar	105	127	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	136	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
					USD	2
					GBP	2
Pfund Sterling	US-Dollar	9.334	11.475	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(188)
					USD	(188)
					GBP	(156)

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

Pfund Sterling	US-Dollar	107	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	136	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
					USD	1
					GBP	1

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

Pfund Sterling	US-Dollar	9.392	11.547	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(189)
					USD	(189)
					GBP	(156)

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Anleihen				Aktien Forts.			
Staatsanleihen - 49.486.621				Kommunikation Forts.			
(31. Dezember 2021: 34.994.461)				(31. Dezember 2021: 56.715.378)			
18.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	17.955.432	3,23	2.000	News Corp	36.900	0,01
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	2.981.967	0,54	5.557	News Corp	101.110	0,02
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	2.969.304	0,54	3.019	Omnicom Group Inc	246.275	0,04
5.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	4.934.886	0,89	7.278	Paramount Global - Class B	122.816	0,02
3.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	2.957.775	0,53	8.675	T-Mobile US Inc	1.214.543	0,22
6.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2023	5.909.535	1,06	1.295	VeriSign Inc	266.058	0,05
6.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	5.898.539	1,06	60.526	Verizon Communications Inc	2.385.027	0,43
6.000.000	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	5.879.183	1,06	26.531	Walt Disney Co/The	2.304.881	0,42
Gesamtanlagen in Anleihen 49.486.621 8,91				31.837	Warner Bros Discovery Inc	301.974	0,05
Aktien				Zyklische Konsumgüter - 42.044.896			
Grundstoffe - 10.346.086				(31. Dezember 2021: 56.715.378)			
(31. Dezember 2021: 11.561.205)				42.044.896 7,57			
3.197	Air Products and Chemicals Inc	985.683	0,18	889	Advance Auto Parts Inc	130.705	0,02
1.702	Albemarle Corp	368.951	0,07	1.827	Alaska Air Group Inc	78.451	0,01
1.477	Celanese Corp - Class A	151.001	0,03	8.995	American Airlines Group Inc	114.551	0,02
3.020	CF Industries Holdings Inc	257.304	0,05	3.905	Aptiv Plc	363.575	0,07
10.433	Dow Inc	525.771	0,09	271	AutoZone Inc	667.968	0,12
7.219	DuPont de Nemours Inc	495.440	0,09	3.367	Bath & Body Works Inc	141.902	0,03
1.795	Eastman Chemical Co	146.176	0,03	2.786	Best Buy Co Inc	223.437	0,04
3.529	Ecolab Inc	513.699	0,09	3.292	BorgWarner Inc	132.519	0,02
1.860	FMC Corp	232.137	0,04	2.918	Caesars Entertainment Inc	121.345	0,02
20.609	Freeport-McMoRan Inc	783.039	0,14	2.294	CarMax Inc	139.647	0,03
3.773	International Flavors & Fragrances Inc	395.580	0,07	13.721	Carnival Corp	110.523	0,02
5.032	International Paper Co	174.233	0,03	402	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	557.395	0,10
7.182	Linde Plc	2.343.558	0,42	6.166	Copart Inc	375.571	0,07
3.764	LyondellBasell Industries NV	312.675	0,06	6.434	Costco Wholesale Corp	2.937.571	0,53
4.535	Mosaic Co/The	198.928	0,03	2.032	Cummins Inc	492.343	0,09
11.438	Newmont Corp	539.931	0,10	1.862	Darden Restaurants Inc	257.580	0,05
3.609	Nucor Corp	475.793	0,08	9.516	Delta Air Lines Inc	312.743	0,06
3.387	PPG Industries Inc	425.864	0,08	3.251	Dollar General Corp	800.673	0,14
3.399	Sherwin-Williams Co/The	806.566	0,14	3.079	Dollar Tree Inc	435.386	0,08
2.188	Steel Dynamics Inc	213.757	0,04	533	Domino's Pizza Inc	184.527	0,03
Kommunikation - 50.502.670				4.557	DR Horton Inc	406.188	0,07
(31. Dezember 2021: 83.693.222)				8.179	Fastenal Co	386.949	0,07
76.831	Alphabet Inc	6.818.367	1,23	56.564	Ford Motor Co	658.122	0,12
86.413	Alphabet Inc - Class A	7.624.219	1,37	20.466	General Motors Co	688.374	0,12
128.696	Amazon.com Inc	10.809.821	1,95	2.038	Genuine Parts Co	353.583	0,06
3.612	Arista Networks Inc	438.370	0,08	1.804	Hasbro Inc	110.035	0,02
102.699	AT&T Inc	1.889.662	0,34	3.805	Hilton Worldwide Holdings Inc	480.838	0,09
560	Booking Holdings Inc	1.128.904	0,20	14.812	Home Depot Inc/The	4.678.592	0,84
1.949	CDW Corp/DE	347.994	0,06	4.736	Las Vegas Sands Corp	227.683	0,04
1.578	Charter Communications Inc	535.084	0,10	3.355	Lennar Corp	303.661	0,06
59.679	Cisco Systems Inc	2.843.704	0,51	1.966	Live Nation Entertainment Inc	137.099	0,03
62.416	Comcast Corp	2.181.751	0,39	3.889	LKQ Corp	207.692	0,04
11.294	Corning Inc	360.674	0,07	8.994	Lowe's Cos Inc	1.792.100	0,32
4.124	DISH Network Corp - Class A	57.880	0,01	3.824	Marriott International Inc/MD	569.260	0,10
7.917	eBay Inc	328.358	0,06	10.603	McDonald's Corp	2.793.838	0,50
1.832	Etsy Inc	219.519	0,04	4.550	MGM Resorts International	152.539	0,03
2.206	Expedia Group Inc	193.212	0,04	6.522	Newell Brands Inc	85.243	0,02
845	F5 Inc	121.236	0,02	18.212	NIKE Inc	2.131.350	0,38
568	FactSet Research Systems Inc	227.941	0,04	6.585	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	80.633	0,02
4.517	Fox Corp	137.136	0,02	47	NVR Inc	216.937	0,04
2.220	Fox Corp	63.148	0,01	916	O'Reilly Automotive Inc	773.067	0,14
8.612	Gen Digital Inc	184.512	0,03	5.011	PACCAR Inc	495.914	0,09
5.649	Interpublic Group of Cos Inc/The	188.140	0,03	520	Pool Corp	157.251	0,03
4.485	Juniper Networks Inc	143.363	0,03	3.498	PulteGroup Inc	159.246	0,03
12.443	Lumen Technologies Inc	65.015	0,01	618	Ralph Lauren Corp - Class A	65.301	0,01
4.078	Match Group Inc	169.217	0,03	5.113	Ross Stores Inc	593.364	0,11
32.576	Meta Platforms Inc - Class A	3.920.522	0,71	3.139	Royal Caribbean Cruises Ltd	155.145	0,03
2.466	Motorola Solutions Inc	635.451	0,11	8.802	Southwest Airlines Co	296.407	0,05
6.409	Netflix Inc	1.889.886	0,34	16.536	Starbucks Corp	1.640.123	0,30
				3.555	Tapestry Inc	135.357	0,02
				6.683	Target Corp	995.934	0,18
				38.917	Tesla Inc	4.796.715	0,86
				16.885	TJX Cos Inc/The	1.344.215	0,24
				1.600	Tractor Supply Co	359.880	0,07
				747	Ulta Beauty Inc	350.373	0,06
				4.683	United Airlines Holdings Inc	176.432	0,03
				4.739	VF Corp	130.773	0,02
				10.338	Walgreens Boots Alliance Inc	386.073	0,07
				20.378	Walmart Inc	2.889.600	0,52

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
810	Whirlpool Corp	114.603	0,02
629	WW Grainger Inc	349.884	0,06
1.396	Wynn Resorts Ltd	115.121	0,02
4.101	Yum! Brands Inc	524.990	0,09
Nicht-zyklische Konsumgüter - 109.319.531			
(31. Dezember 2021: 109.662.611)		109.319.531	19,68
25.238	Abbott Laboratories	2.772.142	0,50
22.270	AbbVie Inc	3.599.611	0,65
3.358	AbbVie Inc	542.770	0,10
1.047	Align Technology Inc	220.844	0,04
25.953	Altria Group Inc	1.186.441	0,21
2.452	AmerisourceBergen Corp	406.333	0,07
7.709	Amgen Inc	2.024.653	0,36
8.049	Archer-Daniels-Midland Co	747.390	0,13
5.988	Automatic Data Processing Inc	1.429.964	0,26
1.220	Avery Dennison Corp	220.808	0,04
7.258	Baxter International Inc	369.977	0,07
4.113	Becton Dickinson and Co	1.046.100	0,19
2.016	Biogen Inc	558.150	0,10
303	Bio-Rad Laboratories Inc	127.457	0,02
2.280	Bio-Techne Corp	188.909	0,03
20.984	Boston Scientific Corp	971.035	0,17
30.773	Bristol-Myers Squibb Co	2.213.656	0,40
2.736	Brown-Forman Corp	179.659	0,03
2.799	Campbell Soup Co	158.871	0,03
3.618	Cardinal Health Inc	278.098	0,05
2.896	Catalent Inc	130.450	0,02
8.238	Centene Corp	675.640	0,12
707	Charles River Laboratories International Inc	153.889	0,03
3.501	Church & Dwight Co Inc	282.198	0,05
4.397	Cigna Corp	1.457.232	0,26
1.277	Cintas Corp	576.546	0,10
1.859	Clorox Co/The	260.846	0,05
56.472	Coca-Cola Co/The	3.592.466	0,65
12.326	Colgate-Palmolive Co	971.227	0,17
6.919	Conagra Brands Inc	267.800	0,05
2.413	Constellation Brands Inc - Class A	559.201	0,10
653	Cooper Cos Inc/The	215.921	0,04
10.358	Corteva Inc	608.895	0,11
6.089	CoStar Group Inc	470.497	0,08
19.161	CVS Health Corp	1.785.709	0,32
9.523	Danaher Corp	2.528.404	0,46
748	DaVita Inc	55.849	0,01
2.878	DENTSPLY SIRONA Inc	91.592	0,02
5.658	Dexcom Inc	640.825	0,12
8.952	Edwards Lifesciences Corp	667.685	0,12
3.459	Elevance Health Inc	1.775.384	0,32
11.433	Eli Lilly & Co	4.181.791	0,75
1.764	Equifax Inc	342.913	0,06
3.327	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	825.811	0,15
1.113	FleetCor Technologies Inc	204.397	0,04
1.140	Gartner Inc	383.371	0,07
8.590	General Mills Inc	720.229	0,13
18.063	Gilead Sciences Inc	1.550.618	0,28
3.994	Global Payments Inc	396.704	0,07
3.099	HCA Healthcare Inc	743.807	0,13
1.969	Henry Schein Inc	157.244	0,03
2.152	Hershey Co/The	498.328	0,09
3.389	Hologic Inc	253.565	0,05
4.273	Hormel Foods Corp	194.635	0,04
1.824	Humana Inc	934.408	0,17
1.200	IDEXX Laboratories Inc	489.456	0,09
2.264	illumina Inc	457.611	0,08
2.760	Incyte Corp	221.669	0,04
5.147	Intuitive Surgical Inc	1.365.422	0,25
2.699	IQVIA Holdings Inc	552.715	0,10
1.536	J M Smucker Co/The	243.410	0,04
37.891	Johnson & Johnson	6.694.392	1,21
3.546	Kellogg Co	252.635	0,05
12.092	Keurig Dr Pepper Inc	431.140	0,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
4.866	Kimberly-Clark Corp	660.681	0,12
11.718	Kraft Heinz Co/The	476.981	0,09
9.267	Kroger Co/The	413.169	0,07
1.303	Laboratory Corp of America Holdings	306.876	0,06
2.111	Lamb Weston Holdings Inc	188.650	0,03
532	MarketAxess Holdings Inc	148.335	0,03
3.740	McCormick & Co Inc/MD	309.953	0,06
2.066	McKesson Corp	775.411	0,14
19.149	Medtronic Plc	1.488.356	0,27
36.726	Merck & Co Inc	4.074.566	0,73
4.849	Moderna Inc	870.711	0,16
877	Molina Healthcare Inc	289.599	0,05
2.657	Molson Coors Beverage Co - Class B	136.902	0,02
19.752	Mondelez International Inc	1.316.273	0,24
5.354	Monster Beverage Corp	543.538	0,10
2.271	Moody's Corp	632.508	0,11
3.665	Organon & Co	102.382	0,02
16.333	PayPal Holdings Inc	1.163.563	0,21
20.022	PepsiCo Inc	3.616.974	0,65
1.710	PerkinElmer Inc	239.665	0,04
81.329	Pfizer Inc	4.168.518	0,75
22.577	Philip Morris International Inc	2.285.808	0,41
34.238	Procter & Gamble Co/The	5.190.310	0,93
2.061	Quanta Services Inc	293.703	0,05
1.589	Quest Diagnostics Inc	248.559	0,04
1.545	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.114.895	0,20
2.143	ResMed Inc	445.948	0,08
1.523	Robert Half International Inc	112.420	0,02
3.115	Rollins Inc	113.807	0,02
1.538	S&P Global Inc	515.099	0,09
3.264	S&P Global Inc	1.093.163	0,20
1.501	STERIS Plc	277.205	0,05
4.853	Stryker Corp	1.186.364	0,21
7.342	Sysco Corp	561.259	0,10
652	Teleflex Inc	162.762	0,03
5.689	Thermo Fisher Scientific Inc	3.133.302	0,56
4.026	Tyson Foods Inc - Class A	250.598	0,05
1.009	United Rentals Inc	358.735	0,06
13.549	UnitedHealth Group Inc	7.184.696	1,29
949	Universal Health Services Inc	133.690	0,02
2.262	Verisk Analytics Inc - Class A	398.870	0,07
3.774	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.089.497	0,20
9.909	Viatris Inc	110.238	0,02
7.512	Viatris Inc	83.571	0,02
902	Waters Corp	308.840	0,06
1.107	West Pharmaceutical Services Inc	260.527	0,05
3.024	Zimmer Biomet Holdings Inc	385.515	0,07
6.747	Zoetis Inc	989.144	0,18
Energie - 25.314.129			
(31. Dezember 2021: 15.289.769)		25.314.129	4,55
4.724	APA Corp	220.493	0,04
14.738	Baker Hughes Co - Class A	435.139	0,08
25.812	Chevron Corp	4.633.899	0,83
18.113	ConocoPhillips	2.137.425	0,39
11.466	Coterra Energy Inc	281.777	0,05
9.435	Devon Energy Corp	580.394	0,11
2.617	Diamondback Energy Inc	357.927	0,06
1.952	Enphase Energy Inc	517.231	0,09
8.446	EOG Resources Inc	1.094.053	0,20
5.182	EQT Corp	175.281	0,03
59.800	Exxon Mobil Corp	6.596.837	1,19
1.431	First Solar Inc	214.314	0,04
13.071	Halliburton Co	514.278	0,09
3.966	Hess Corp	562.557	0,10
28.573	Kinder Morgan Inc	516.743	0,09
8.902	Marathon Oil Corp	240.933	0,04
6.803	Marathon Petroleum Corp	791.971	0,14
10.681	Occidental Petroleum Corp	672.743	0,12
6.440	ONEOK Inc	423.140	0,08
6.705	Phillips 66	697.890	0,13

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Energie Forts.			
3.442	Pioneer Natural Resources Co	786.136	0,14
20.864	Schlumberger Ltd	1.115.807	0,20
845	SolarEdge Technologies Inc	239.325	0,04
3.149	Targa Resources Corp	231.404	0,04
5.489	Valero Energy Corp	696.197	0,13
17.639	Williams Cos Inc/The	580.235	0,10
Finanzwerte - 73.027.040			
(31. Dezember 2021: 80.253.840)		73.027.040	13,14
8.333	Aflac Inc	599.518	0,11
2.235	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	325.628	0,06
3.938	Allstate Corp/The	534.012	0,10
8.644	American Express Co	1.276.848	0,23
10.966	American International Group Inc	693.545	0,12
6.710	American Tower Corp (REIT)	1.421.782	0,26
1.559	Ameriprise Financial Inc	485.356	0,09
2.361	Aon Plc	708.359	0,13
600	Aon Plc	180.015	0,03
5.320	Arch Capital Group Ltd	333.990	0,06
2.993	Arthur J Gallagher & Co	564.614	0,10
797	Assurant Inc	99.689	0,02
1.990	AvalonBay Communities Inc (REIT)	321.415	0,06
101.499	Bank of America Corp	3.361.139	0,60
10.598	Bank of New York Mellon Corp/The	482.368	0,09
26.150	Berkshire Hathaway Inc - Class B	8.079.696	1,45
2.173	BlackRock Inc	1.539.549	0,28
2.064	Boston Properties Inc (REIT)	139.495	0,03
3.379	Brown & Brown Inc	192.519	0,03
1.481	Camden Property Trust (REIT)	165.716	0,03
5.532	Capital One Financial Corp	514.282	0,09
1.595	Cboe Global Markets Inc	200.268	0,04
4.629	CBRE Group Inc - Class A	356.271	0,06
22.006	Charles Schwab Corp/The	1.832.110	0,33
6.019	Chubb Ltd	1.328.243	0,24
2.213	Cincinnati Financial Corp	226.545	0,04
27.911	Citigroup Inc	1.262.275	0,23
7.292	Citizens Financial Group Inc	287.050	0,05
5.200	CME Group Inc	874.380	0,16
1.859	Comerica Inc	124.283	0,02
6.241	Crown Castle Inc (REIT)	846.810	0,15
4.090	Digital Realty Trust Inc (REIT)	410.043	0,07
3.937	Discover Financial Services	385.098	0,07
1.347	Equinix Inc (REIT)	882.258	0,16
4.706	Equity Residential (REIT)	277.678	0,05
939	Essex Property Trust Inc (REIT)	199.002	0,04
565	Everest Re Group Ltd	187.086	0,03
2.016	Extra Space Storage Inc (REIT)	296.675	0,05
1.049	Federal Realty Investment Trust (REIT)	105.986	0,02
9.889	Fifth Third Bancorp	324.409	0,06
2.797	First Republic Bank/CA	341.024	0,06
4.094	Franklin Resources Inc	108.020	0,02
1.274	Globe Life Inc	153.587	0,03
4.920	Goldman Sachs Group Inc/The	1.689.553	0,30
4.657	Hartford Financial Services Group Inc/The	353.164	0,06
8.038	Healthpeak Properties Inc (REIT)	201.392	0,04
10.395	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	166.892	0,03
20.785	Huntington Bancshares Inc/OH	292.965	0,05
8.237	Intercontinental Exchange Inc	845.322	0,15
6.960	Invesco Ltd	125.176	0,02
8.817	Invitation Homes Inc (REIT)	261.292	0,05
4.298	Iron Mountain Inc (REIT)	214.234	0,04
42.264	JPMorgan Chase & Co	5.668.236	1,02
13.811	KeyCorp	240.795	0,04
9.016	KRC Interim Corp (REIT)	190.914	0,03
2.242	Lincoln National Corp	68.863	0,01
2.811	Loews Corp	163.952	0,03
2.531	M&T Bank Corp	367.109	0,07
7.192	Marsh & McLennan Cos Inc	1.190.528	0,21
12.296	Mastercard Inc	4.276.733	0,77
9.315	MetLife Inc	674.080	0,12
1.739	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	273.014	0,05

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Finanzwerte Forts.			
19.005	Morgan Stanley	1.615.710	0,29
5.093	Nasdaq Inc	312.456	0,06
2.877	Northern Trust Corp	254.571	0,05
5.911	PNC Financial Services Group Inc/The	933.908	0,17
3.497	Principal Financial Group Inc	293.381	0,05
8.430	Progressive Corp/The	1.093.666	0,20
13.306	Prologis Inc (REIT)	1.500.584	0,27
5.388	Prudential Financial Inc	535.837	0,10
2.281	Public Storage (REIT)	638.977	0,11
2.799	Raymond James Financial Inc	299.115	0,05
9.164	Realty Income Corp (REIT)	581.227	0,10
2.125	Regency Centers Corp (REIT)	132.781	0,02
13.466	Regions Financial Corp	290.394	0,05
1.581	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	443.312	0,08
890	Signature Bank/New York NY	102.528	0,02
4.749	Simon Property Group Inc (REIT)	558.007	0,10
5.405	State Street Corp	419.185	0,08
853	SVB Financial Group	196.250	0,04
6.697	Synchrony Financial	220.097	0,04
3.317	T Rowe Price Group Inc	361.702	0,06
3.420	Travelers Cos Inc/The	641.472	0,12
19.116	Truist Financial Corp	822.657	0,15
4.487	UDR Inc (REIT)	173.804	0,03
19.571	US Bancorp	853.785	0,15
5.981	Ventas Inc (REIT)	269.414	0,05
13.707	VICI Properties Inc (REIT)	444.175	0,08
23.678	Visa Inc - Class A	4.921.354	0,89
2.626	Vornado Realty Trust (REIT)	54.660	0,01
3.068	W R Berkley Corp	222.629	0,04
55.239	Wells Fargo & Co	2.281.094	0,41
6.775	Welltower Inc (REIT)	444.067	0,08
10.669	Weyerhaeuser Co (REIT)	330.792	0,06
1.585	Willis Towers Watson Plc	387.746	0,07
2.092	Zions Bancorp NA	102.853	0,02
Industrie - 39.387.869			
(31. Dezember 2021: 41.624.992)		39.387.869	7,09
7.979	3M Co	956.921	0,17
1.726	A O Smith Corp	98.805	0,02
4.305	Agilent Technologies Inc	644.179	0,12
1.241	Allegion plc	130.659	0,02
20.388	Arcor Plc	242.923	0,04
3.363	AMETEK Inc	469.895	0,08
8.572	Amphenol Corp - Class A	652.715	0,12
4.814	Ball Corp	246.164	0,04
8.173	Boeing Co/The	1.557.529	0,28
12.129	Carrier Global Corp	500.382	0,09
7.505	Caterpillar Inc	1.797.935	0,32
1.683	CH Robinson Worldwide Inc	154.079	0,03
30.859	CSX Corp	955.858	0,17
4.008	Deere & Co	1.719.131	0,31
1.918	Dover Corp	259.707	0,05
5.747	Eaton Corp Plc	902.193	0,16
8.718	Emerson Electric Co	837.451	0,15
2.264	Expeditors International of Washington Inc	235.218	0,04
3.461	FedEx Corp	599.428	0,11
5.126	Fortive Corp	329.346	0,06
2.248	Garmin Ltd	207.490	0,04
912	Generac Holdings Inc	91.797	0,02
3.322	General Dynamics Corp	824.238	0,15
15.803	General Electric Co	1.324.212	0,24
9.709	Honeywell International Inc	2.080.445	0,37
4.909	Howmet Aerospace Inc	193.537	0,03
560	Huntington Ingalls Industries Inc	129.175	0,02
1.129	IDEX Corp	257.779	0,05
4.067	Illinois Tool Works Inc	896.001	0,16
5.974	Ingersoll Rand Inc	312.231	0,06
1.839	Jacobs Solutions Inc	220.781	0,04
1.197	JB Hunt Transport Services Inc	208.691	0,04
9.935	Johnson Controls International plc	635.890	0,11
2.593	Keysight Technologies Inc	443.572	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Industrie Forts.			
2.767	L3Harris Technologies Inc	576.325	0,10
3.401	Lockheed Martin Corp	1.654.944	0,30
899	Martin Marietta Materials Inc	303.660	0,05
3.250	Masco Corp	151.661	0,03
336	Mettler-Toledo International Inc	485.034	0,09
933	Mohawk Industries Inc	95.376	0,02
796	Nordson Corp	189.185	0,03
3.401	Norfolk Southern Corp	837.751	0,15
2.096	Northrop Grumman Corp	1.144.395	0,21
1.274	Old Dominion Freight Line Inc	361.370	0,07
6.056	Otis Worldwide Corp	474.336	0,09
1.377	Packaging Corp of America	176.167	0,03
1.862	Parker-Hannifin Corp	541.609	0,10
2.213	Pentair Plc	99.508	0,02
21.279	Raytheon Technologies Corp	2.147.583	0,39
2.960	Republic Services Inc - Class A	381.796	0,07
1.693	Rockwell Automation Inc	436.041	0,08
1.972	Sealed Air Corp	98.393	0,02
776	Snap-on Inc	177.297	0,03
2.183	Stanley Black & Decker Inc	163.954	0,03
4.639	TE Connectivity Ltd	532.580	0,10
698	Teledyne Technologies Inc	279.169	0,05
3.049	Textron Inc	215.884	0,04
3.357	Trane Technologies Plc	564.362	0,10
733	TransDigm Group Inc	461.332	0,08
3.659	Trimble Inc	184.944	0,03
8.889	Union Pacific Corp	1.840.334	0,33
10.547	United Parcel Service Inc - Class B	1.832.910	0,33
1.854	Vulcan Materials Co	324.626	0,06
5.421	Waste Management Inc	850.474	0,15
2.621	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	261.654	0,05
3.711	Westrock Co	130.460	0,02
2.681	Xylem Inc/NY	296.398	0,05
Technologie - 100.949.706			
(31. Dezember 2021: 140.405.254)		100.949.706	18,17
9.116	Accenture Plc - Class A	2.432.422	0,44
10.260	Activision Blizzard Inc	785.506	0,14
6.745	Adobe Inc	2.269.760	0,41
23.265	Advanced Micro Devices Inc	1.507.107	0,27
2.379	Akamai Technologies Inc	200.562	0,04
7.491	Analog Devices Inc	1.228.749	0,22
1.296	ANSYS Inc	313.120	0,06
216.714	Apple Inc	28.156.566	5,07
12.538	Applied Materials Inc	1.221.076	0,22
3.125	Autodesk Inc	583.922	0,10
5.820	Broadcom Inc	3.254.166	0,59
1.786	Broadridge Financial Solutions Inc	239.565	0,04
3.898	Cadence Design Systems Inc	626.077	0,11
2.259	Ceridian HCM Holding Inc	144.926	0,03
7.462	Cognizant Technology Solutions Corp	426.864	0,08
3.075	DXC Technology Co	81.472	0,01
3.854	Electronic Arts Inc	470.843	0,08
863	EPAM Systems Inc	282.835	0,05
8.817	Fidelity National Information Services Inc	598.189	0,11
9.224	Fiserv Inc	932.224	0,17
9.432	Fortinet Inc	461.083	0,08
19.297	Hewlett Packard Enterprise Co	307.691	0,05
13.370	HP Inc	359.319	0,06
60.032	Intel Corp	1.586.346	0,29
13.178	International Business Machines Corp	1.856.583	0,33
4.065	Intuit Inc	1.581.854	0,28
964	Jack Henry & Associates Inc	169.216	0,03
2.044	KLA Corp	770.905	0,14
2.026	Lam Research Corp	851.609	0,15
2.043	Leidos Holdings Inc	214.893	0,04
7.677	Microchip Technology Inc	539.271	0,10
15.898	Micron Technology Inc	794.661	0,14
108.024	Microsoft Corp	25.906.856	4,66
650	Monolithic Power Systems Inc	229.869	0,04
1.167	MSCI Inc - Class A	543.244	0,10

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Technologie Forts.			
3.167	NetApp Inc	190.162	0,03
36.087	NVIDIA Corp	5.274.476	0,95
3.650	NXP Semiconductors NV	576.901	0,10
6.244	ON Semiconductor Corp	389.469	0,07
22.238	Oracle Corp	1.817.845	0,33
4.616	Paychex Inc	533.402	0,10
701	Paycom Software Inc	217.548	0,04
1.530	PTC Inc	183.615	0,03
1.491	Qorvo Inc	135.159	0,02
16.184	QUALCOMM Inc	1.779.431	0,32
1.529	Roper Technologies Inc	660.467	0,12
14.520	Salesforce Inc	1.925.134	0,35
2.815	Seagate Technology Holdings Plc	148.097	0,03
2.911	ServiceNow Inc	1.131.113	0,20
2.312	Skyworks Solutions Inc	210.716	0,04
2.207	Synopsys Inc	704.485	0,13
2.162	Take-Two Interactive Software Inc	225.161	0,04
2.260	Teradyne Inc	197.456	0,04
13.168	Texas Instruments Inc	2.175.749	0,39
612	Tyler Technologies Inc	197.349	0,04
4.508	Western Digital Corp	142.205	0,03
797	Zebra Technologies Corp	204.415	0,04
Versorger - 14.816.553			
(31. Dezember 2021: 13.760.916)		14.816.553	2,67
9.935	AES Corp/The	285.681	0,05
3.778	Alliant Energy Corp	208.602	0,04
3.592	Ameren Corp	319.401	0,06
7.407	American Electric Power Co Inc	703.220	0,13
2.620	American Water Works Co Inc	399.458	0,07
2.064	Atmos Energy Corp	231.405	0,04
9.516	CenterPoint Energy Inc	285.432	0,05
4.182	CMS Energy Corp	264.867	0,05
5.197	Consolidated Edison Inc	495.378	0,09
4.803	Constellation Energy Corp	413.995	0,07
12.012	Dominion Energy Inc	736.876	0,13
2.757	DTE Energy Co	324.071	0,06
11.097	Duke Energy Corp	1.142.935	0,21
5.497	Edison International	349.802	0,06
2.932	Entergy Corp	329.865	0,06
3.471	Eversource Energy	218.465	0,04
4.993	Eversource Energy	418.688	0,07
14.293	Exelon Corp	617.815	0,11
8.118	FirstEnergy Corp	340.591	0,06
28.778	NextEra Energy Inc	2.405.409	0,43
5.643	NiSource Inc	154.759	0,03
3.366	NRG Energy Inc	107.123	0,02
23.203	PG&E Corp	377.397	0,07
1.548	Pinnacle West Capital Corp	117.718	0,02
10.896	PPL Corp	318.436	0,06
7.189	Public Service Enterprise Group Inc	440.506	0,08
4.533	Sempra Energy	700.598	0,13
15.323	Southern Co/The (Units)	1.094.292	0,20
4.737	WEC Energy Group Inc	444.165	0,08
8.125	Xcel Energy Inc	569.603	0,10
Gesamtanlagen in Aktien		465.708.480	83,82
Indexpoptionen - 603.500			
(31. Dezember 2021: 19.386.988)			
142	CME E-Mini S&P 500 Index Call 17-Mar-2023 4,220.000	179.275	0,03
142	CME E-Mini S&P W3 Index Call 17-Feb-2023 4,230.000	71.000	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %	
Indexoptionen Forts.				
142	CME E-Mini S&P W3 Index Call 28-Feb-2023 4,050.000	353.225	0,07	
Indexoptionen insgesamt		603.500	0,11	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 812 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 40.477)		812	0,00	
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		515.799.413	92,84	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (595.325) (31. Dezember 2021: 2.927.226)				
153	E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2023	29.536.650	(595.325)	(0,11)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(595.325)	(0,11)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (33) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (37))		(33)	(0,00)	
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(595.358)	(0,11)	
Nettoumlaufvermögen		40.372.012	7,27	
Summe Nettovermögen		555.576.067	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	92,58
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,11
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen	7,31
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	118	126	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	110	116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	53	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	109	116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	8.181	8.655	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		109
US-Dollar	Euro	83	78	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	66	62	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	110
						EUR	103
US-Dollar	Euro	109	103	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	92	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	203	190	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	60	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(4)
						EUR	(4)

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Euro	US-Dollar	750	802	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	694	736	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		8
Euro	US-Dollar	334	357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	691	738	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3
Euro	US-Dollar	51.925	54.935	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		689
						USD	702
						EUR	656
US-Dollar	Euro	418	392	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
US-Dollar	Euro	585	551	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(5)
US-Dollar	Euro	1.287	1.206	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(6)
US-Dollar	Euro	345	325	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3)
US-Dollar	Euro	378	357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(5)
US-Dollar	Euro	530	498	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3)
US-Dollar	Euro	694	653	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(5)
						USD	(29)
						EUR	(27)

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Euro - 38.124.719			
(31. Dezember 2021: 38.737.815)			
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV FRN (Perpetual) 2.625% 26-Jan-2027	82.978	0,05
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV FRN (Perpetual) 3.248% 24-Nov-2025	90.839	0,05
200.000	Accor SA 3.000% 04-Feb-2026	207.000	0,12
100.000	Accor SA FRN (Perpetual) 4.375% 30-Jan-2024	100.924	0,06
100.000	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA 'EMTN' 1.375% 17-Jun-2025	98.801	0,06
100.000	Adevinta ASA 'REGS' 2.625% 15-Nov-2025	99.981	0,06
100.000	Adient Global Holdings Ltd 'REGS' 3.500% 15-Aug-2024	102.730	0,06
100.000	ADLER Group SA 2.250% 14-Jan-2029	36.020	0,02
100.000	ADLER Group SA 2.750% 13-Nov-2026	43.134	0,02
100.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy 'REGS' 3.625% 04-Feb-2028	90.897	0,05
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031	96.148	0,05
100.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026	94.212	0,05
100.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 'REGS' 3.625% 01-Jun-2028	85.185	0,05
100.000	Alpha Bank SA FRN 2.500% 23-Mar-2028	86.515	0,05
100.000	Alpha Services and Holdings SA 'EMTN' FRN 4.250% 13-Feb-2030	87.402	0,05
200.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	197.070	0,11
100.000	Altice Financing SA 'REGS' 3.000% 15-Jan-2028	84.885	0,05
100.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	80.123	0,04
100.000	Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027	78.564	0,04
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028	81.064	0,05
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	81.873	0,05
100.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.250% 15-Oct-2029	80.670	0,05
300.000	Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027	281.212	0,16
100.000	ams-OSRAM AG 'REGS' 6.000% 31-Jul-2025	100.330	0,06
100.000	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	72.247	0,04
100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029	78.441	0,04
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	89.451	0,05
100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl 'REGS' 1.875% 01-Feb-2028	86.029	0,05
100.000	Atlantia SpA 1.875% 12-Feb-2028	89.350	0,05
200.000	Atlantia SpA 'EMTN' 1.875% 13-Jul-2027	183.286	0,10
200.000	Atos SE 1.000% 12-Nov-2029	135.132	0,08
100.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	101.341	0,06
100.000	Avis Budget Finance Plc 'REGS' 4.750% 30-Jan-2026	100.418	0,06
100.000	Azzurra Aeroporti SpA 2.125% 30-May-2024	100.909	0,06
100.000	Ball Corp 0.875% 15-Mar-2024	103.619	0,06
100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.875% 09-Jan-2026	92.133	0,05
100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 'EMTN' 2.625% 28-Apr-2025	97.141	0,05
100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 8.500% 10-Sep-2030	94.480	0,05
100.000	Banca Popolare di Sondrio SPA 'EMTN' FRN 1.250% 13-Jul-2027	90.851	0,05
100.000	Banca Popolare di Sondrio SPA 'EMTN' FRN 6.250% 30-Jul-2029	106.012	0,06
100.000	Banco BPM SpA 'EMTN' 0.875% 15-Jul-2026	93.318	0,05
150.000	Banco BPM SpA 'EMTN' FRN 6.000% 21-Jan-2028	159.827	0,09
200.000	Banco BPM SpA FRN 4.250% 01-Oct-2029	204.016	0,11
100.000	Banco BPM SpA FRN 5.000% 14-Sep-2030	103.799	0,06
200.000	Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 1.125% 12-Feb-2027	175.643	0,10
100.000	Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 1.750% 07-Apr-2028	83.976	0,05
100.000	Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 3.871% 27-Mar-2030	84.620	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 1.750% 09-Mar-2028	82.662	0,05
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	90.101	0,05
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.750% 10-May-2024	103.060	0,06
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 5.625% 06-May-2026	108.383	0,06
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.500% 15-Apr-2031	93.553	0,05
100.000	Banco de Sabadell SA FRN 2.000% 17-Jan-2030	96.069	0,05
100.000	Banff Merger Sub Inc 'REGS' 8.375% 01-Sep-2026	96.881	0,05
100.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	101.227	0,06
100.000	Bank of Cyprus Pcl 'EMTN' FRN 2.500% 24-Jun-2027	88.477	0,05
100.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	90.296	0,05
100.000	Bayer AG FRN 2.375% 12-Nov-2029	96.395	0,05
100.000	Bayer AG FRN 3.125% 12-Nov-2029	91.273	0,05
100.000	Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2024	103.046	0,06
100.000	Bayer AG FRN 5.375% 25-Mar-2082	94.337	0,05
100.000	BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	90.018	0,05
100.000	Belden Inc 'REGS' 3.375% 15-Jul-2031	89.635	0,05
100.000	Belden Inc 'REGS' 3.875% 15-Mar-2028	98.160	0,05
100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 3.500% 23-Apr-2025	98.063	0,05
100.000	BK LC Lux Finco1 Sarl 'REGS' 5.250% 30-Apr-2029	93.186	0,05
100.000	Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025	102.390	0,06
100.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 3.375% 30-Jun-2025	104.620	0,06
100.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 3.625% 30-Nov-2030	96.608	0,05
200.000	BPER Banca 'EMTN' FRN 8.625% 20-Jan-2033	223.288	0,12
100.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	83.489	0,05
100.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029	77.239	0,04
100.000	British Telecommunications Plc FRN 1.874% 18-Aug-2080	94.188	0,05
100.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	86.362	0,05
200.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027	169.391	0,09
100.000	Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026	86.887	0,05
100.000	Carnival Plc 1.000% 28-Oct-2029	44.577	0,02
100.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 3.580% 07-Feb-2025	72.157	0,04
200.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.498% 07-Mar-2024	179.111	0,10
100.000	Castellum AB FRN (Perpetual) 3.125% 02-Dec-2026	68.347	0,04
100.000	Castor SpA 'REGS' 6.000% 15-Feb-2029	95.978	0,05
100.000	Catalent Pharma Solutions Inc 'REGS' 2.375% 01-Mar-2028	87.638	0,05
100.000	CECONOMY AG 1.750% 24-Jun-2026	68.291	0,04
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 0.750% 15-Nov-2026	91.918	0,05
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.250% 15-Jan-2029	86.005	0,05
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.500% 08-Jun-2028	89.362	0,05
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Sep-2032	79.311	0,04
100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033	78.226	0,04
200.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2026	197.624	0,11
100.000	Cellnex Telecom SA 1.000% 20-Apr-2027	91.165	0,05
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	83.342	0,05
100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 2.875% 18-Apr-2025	103.936	0,06
100.000	Centurion Bidco SpA 'REGS' 5.875% 30-Sep-2026	92.972	0,05
100.000	Chemours Co/The 4.000 % 15-May-2026	96.555	0,05
100.000	Chepharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028	94.433	0,05
100.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	90.270	0,05
100.000	Chrome Holdco SASU 'REGS' 5.000% 31-May-2029	83.307	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
100.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.500% 15-Mar-2027	92.692	0,05	
200.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.750% 22-May-2025	203.326	0,11	
100.000	Citycon Oyj FRN (Perpetual) 4.496% 24-Nov-2024	64.029	0,04	
100.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	98.877	0,06	
100.000	CMA CGM SA 'REGS' 7.500% 15-Jan-2026	110.912	0,06	
120.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 23-Mar-2026	125.722	0,07	
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 30-Mar-2027	15.557	0,01	
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030	100.781	0,06	
100.000	Constellium SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029	85.291	0,05	
100.000	ContourGlobal Power Holdings SA 'REGS' 4.125% 01-Aug-2025	105.391	0,06	
150.000	Coty Inc 'REGS' 3.875% 15-Apr-2026	150.009	0,08	
100.000	CPI Property Group SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Aug-2026	55.563	0,03	
100.000	Credito Emiliano Holding SpA FRN 3.500% 16-Dec-2030	98.382	0,05	
100.000	Crown European Holdings SA 'REGS' 3.375% 15-May-2025	105.732	0,06	
100.000	CT Investment GmbH 'REGS' 5.500% 15-Apr-2026	95.326	0,05	
100.000	Ctec II GmbH 'REGS' 5.250% 15-Feb-2030	89.426	0,05	
100.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	94.355	0,05	
100.000	Darling Global Finance BV 'REGS' 3.625% 15-May-2026	104.719	0,06	
100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.875% 11-Feb-2025	101.115	0,06	
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 2.000% 14-Jul-2024	102.716	0,06	
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 2.875% 16-May-2027	93.234	0,05	
200.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.000% 29-May-2026	193.248	0,11	
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.500% 14-Jul-2029	91.207	0,05	
100.000	Deutsche Lufthansa AG 'EMTN' 3.750% 11-Feb-2028	95.438	0,05	
100.000	DIC Asset AG 2.250% 22-Sep-2026	61.482	0,03	
100.000	Dometic Group AB 'EMTN' 3.000% 08-May-2026	99.967	0,06	
200.000	Douglas GmbH 'REGS' 6.000% 08-Apr-2026	179.596	0,10	
100.000	doValue SpA 'REGS' 5.000% 04-Aug-2025	103.370	0,06	
100.000	Dufry One BV 2.000% 15-Feb-2027	87.922	0,05	
100.000	Dufry One BV 2.500% 15-Oct-2024	104.181	0,06	
100.000	Dufry One BV 3.375% 15-Apr-2028	88.920	0,05	
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.700% 20-Jul-2080	96.042	0,05	
200.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 1.875% 02-Aug-2081	183.698	0,10	
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 4.496% 30-Apr-2079	105.649	0,06	
100.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 3.625% 07-Feb-2024	101.777	0,06	
100.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 6.250% 30-Oct-2025	94.197	0,05	
100.000	eircom Finance DAC 3.500% 15-May-2026	97.117	0,05	
100.000	Elis SA 'EMTN' 1.000% 03-Apr-2025	99.744	0,06	
100.000	Elis SA 'EMTN' 1.625% 03-Apr-2028	91.846	0,05	
100.000	ELM BV for Firmenich International SA FRN (Perpetual) 3.750% 03-Sep-2025	101.986	0,06	
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.875% 15-Oct-2025	100.561	0,06	
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029	86.099	0,05	
100.000	Eolo SpA 'REGS' 4.875% 21-Oct-2028	77.150	0,04	
100.000	Esselunga SpA 1.875% 25-Oct-2027	97.176	0,05	
100.000	Eurobank SA 'EMTN' FRN 2.000% 05-May-2027	90.392	0,05	
100.000	Eurobank SA 'EMTN' FRN 2.250% 14-Mar-2028	87.226	0,05	
100.000	Eurofins Scientific SE FRN (Perpetual) 3.250% 13-Nov-2025	96.223	0,05	
100.000	Evonik Industries AG FRN 1.375% 02-Sep-2081	87.119	0,05	
100.000	Fastighets AB Balder FRN 2.873% 02-Jun-2081	73.538	0,04	
100.000	Faurecia SE 2.375% 15-Jun-2027	89.608	0,05	
100.000	Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027	90.597	0,05	
100.000	Faurecia SE 3.750% 15-Jun-2028	91.404	0,05	
200.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	216.535	0,12	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
100.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 'REGS' 5.625% 01-Aug-2027	85.850	0,05	
100.000	Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029	82.735	0,05	
100.000	Fnac Darty SA 2.625% 30-May-2026	101.693	0,06	
100.000	Foodco Bondco SA 'REGS' 6.250% 15-May-2026	44.067	0,02	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.330% 25-Nov-2025	99.005	0,06	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.386% 17-Feb-2026	97.988	0,05	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 1.355% 07-Feb-2025	99.682	0,06	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 3.021% 06-Mar-2024	105.102	0,06	
250.000	Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026	159.899	0,09	
100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025	85.235	0,05	
100.000	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	101.684	0,06	
100.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	104.370	0,06	
100.000	Grifols Escrow Issuer SA 'REGS' 3.875% 15-Oct-2028	90.336	0,05	
100.000	Grifols SA 'REGS' 2.250% 15-Nov-2027	93.693	0,05	
100.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	99.180	0,06	
100.000	Gruenthal GmbH 'REGS' 3.625% 15-Nov-2026	98.351	0,05	
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA 'REGS' 3.375% 30-Apr-2026	87.543	0,05	
100.000	Guala Closures SpA 'REGS' 3.250% 15-Jun-2028	92.178	0,05	
100.000	Heimstaden AB 4.375% 06-Mar-2027	71.578	0,04	
100.000	Heimstaden Bostad AB 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.625% 13-Oct-2026	57.889	0,03	
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	57.917	0,03	
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.248% 19-Nov-2024	79.206	0,04	
100.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jan-2026	62.319	0,03	
100.000	Herens Midco Sarl 'REGS' 5.250% 15-May-2029	74.801	0,04	
100.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	93.917	0,05	
100.000	Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 2.250% 20-Oct-2025	101.745	0,06	
100.000	Iccrea Banca SpA FRN 2.125% 17-Jan-2027	94.772	0,05	
100.000	Ideal Standard International SA 'REGS' 6.375% 30-Jul-2026	46.003	0,03	
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.625% 15-May-2025	97.872	0,05	
100.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	90.936	0,05	
100.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	99.469	0,06	
100.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	97.380	0,05	
100.000	Iliad SA 1.875% 11-Feb-2028	88.720	0,05	
100.000	Iliad SA 2.375% 17-Jun-2026	96.892	0,05	
100.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.125% 15-Nov-2025	97.275	0,05	
100.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	88.458	0,05	
100.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 2.500% 15-Jan-2026	91.228	0,05	
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	99.958	0,06	
100.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 'GMTN' 1.625% 21-Oct-2028	91.047	0,05	
100.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 'GMTN' 1.875% 08-Jul-2026	98.065	0,05	
100.000	International Consolidated Airlines Group SA 3.750% 25-Mar-2029	82.690	0,05	
100.000	International Game Technology Plc 'REGS' 2.375% 15-Apr-2028	93.213	0,05	
100.000	International Game Technology Plc 'REGS' 3.500% 15-Jul-2024	106.673	0,06	
100.000	International Personal Finance Plc 9.750% 12-Nov-2025	89.789	0,05	
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 3.928% 15-Sep-2026	317.364	0,18	
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' FRN 5.875% 04-Mar-2029	108.973	0,06	
250.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030	194.705	0,11	
100.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA FRN (Perpetual) 4.750% 17-Dec-2024	104.431	0,06	
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.000% 15-Sep-2027	85.662	0,05	
51.479	Intrum AB 'REGS' 3.125% 15-Jul-2024	52.852	0,03	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Intrum AB 'REGS' 3.500% 15-Jul-2026	89.919	0,05
100.000	Intrum AB 'REGS' 4.875% 15-Aug-2025	98.001	0,05
100.000	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	101.914	0,06
100.000	Iqera Group SAS 'REGS' 6.500% 30-Sep-2024	99.396	0,06
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.250% 15-Jan-2028	94.479	0,05
100.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	95.798	0,05
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 2.200% 15-Jan-2024	102.075	0,06
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 4.500% 15-Jan-2026	92.439	0,05
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2028	81.557	0,05
100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 'REGS' 5.125% 30-Sep-2029	91.345	0,05
100.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	83.917	0,05
100.000	Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026	60.179	0,03
100.000	Koninklijke KPN NV FRN (Perpetual) 2.000% 08-Nov-2024	99.273	0,06
100.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 4.000% 15-May-2024	92.995	0,05
100.000	Leonardo SpA 'EMTN' 4.875% 24-Mar-2025	108.415	0,06
100.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024	105.854	0,06
100.000	Loarre Investments Sarl 'REGS' 6.500% 15-May-2029	99.163	0,06
100.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	96.258	0,05
100.000	Lottomatica SpA/Roma 'REGS' 6.250% 15-Jul-2025	104.715	0,06
100.000	Lottomatica SpA/Roma 'REGS' 9.750% 30-Sep-2027	111.167	0,06
100.000	Loxam SAS 5.750% 15-Jul-2027	92.107	0,05
100.000	Loxam SAS 'REGS' 4.250% 15-Apr-2024	106.777	0,06
100.000	Loxam SAS 'REGS' 4.500% 15-Feb-2027	98.165	0,05
100.000	Mahle GmbH 'EMTN' 2.375% 14-May-2028	77.641	0,04
100.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 2.625% 15-Sep-2024	103.391	0,06
100.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 3.125% 15-Sep-2026	97.280	0,05
100.000	Motion Finco Sarl 'REGS' 7.000% 15-May-2025	107.133	0,06
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24-Mar-2025	96.969	0,05
100.000	Mytilineos Financial Partners SA 2.500% 01-Dec-2024	105.413	0,06
100.000	Nassa Topco AS 'REGS' 2.875% 06-Apr-2024	103.834	0,06
100.000	National Bank of Greece SA FRN 8.250% 18-Jul-2029	106.516	0,06
100.000	Naturgy Finance BV FRN (Perpetual) 3.375% 24-Apr-2024	104.340	0,06
100.000	Neinor Homes SA 'REGS' 4.500% 15-Oct-2026	91.499	0,05
100.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 2.250% 20-Jul-2028	85.662	0,05
100.000	Netflix Inc 3.625 % 15-May-2027	103.269	0,06
100.000	Netflix Inc 4.625% 15-May-2029	105.268	0,06
100.000	Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030	98.285	0,05
100.000	Netflix Inc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2029	100.208	0,06
100.000	Nexi SpA 1.750% 31-Oct-2024	103.726	0,06
100.000	Nexi SpA 2.125% 30-Apr-2029	87.263	0,05
200.000	NGG Finance Plc FRN 1.625% 05-Dec-2079	199.699	0,11
100.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 7.500% 21-Aug-2026	102.165	0,06
100.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	72.936	0,04
100.000	Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026	90.807	0,05
100.000	Nokia Oyj 'EMTN' 2.000% 11-Mar-2026	100.640	0,06
100.000	Nokia Oyj 'EMTN' 3.125% 15-May-2028	101.670	0,06
100.000	Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028	90.957	0,05
30.000	Novo Banco SA/Luxembourg 3.500% 23-Jan-2043	25.383	0,01
150.000	OI European Group BV 'REGS' 3.125% 15-Nov-2024	156.465	0,09
100.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 5.375% 01-Oct-2029	78.459	0,04
100.000	Ontex Group NV 3.500% 15-Jul-2026	90.921	0,05
100.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028	93.862	0,05
100.000	OTP Bank Nyrt FRN 2.875% 15-Jul-2029	97.612	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	Paprec Holding SA 'REGS' 3.500% 01-Jul-2028	93.191	0,05
100.000	PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026	89.476	0,05
100.000	Peach Property Finance GmbH 'REGS' 4.375% 15-Nov-2025	80.016	0,04
100.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 5.250% 30-Jun-2025	103.185	0,06
100.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	91.959	0,05
100.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025	93.995	0,05
100.000	Piraeus Bank SA 'EMTN' FRN 3.875% 03-Nov-2027	90.816	0,05
100.000	Piraeus Financial Holdings SA 'EMTN' FRN 9.750% 26-Jun-2029	104.643	0,06
100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 2.125% 31-Jan-2025	101.135	0,06
100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 3.500% 20-May-2024	105.514	0,06
100.000	Pro-Gest SpA 'REGS' 3.250% 15-Dec-2024	70.680	0,04
100.000	ProGroup AG 'REGS' 3.000% 31-Mar-2026	94.861	0,05
100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 1.500% 01-Mar-2025	98.414	0,05
100.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	89.475	0,05
200.000	Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027	125.712	0,07
100.000	RCI Banque SA FRN 2.625% 18-Feb-2030	95.706	0,05
100.000	Rekeep SpA 'REGS' 7.250% 01-Feb-2026	91.434	0,05
100.000	Renault SA 'EMTN' 1.250% 24-Jun-2025	96.250	0,05
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.000% 28-Sep-2026	94.400	0,05
200.000	Renault SA 'EMTN' 2.375% 25-May-2026	193.468	0,11
100.000	Renault SA 'EMTN' 2.500% 01-Apr-2028	90.657	0,05
100.000	Repsol International Finance BV FRN 4.500% 25-Mar-2075	103.954	0,06
100.000	Repsol International Finance BV FRN (Perpetual) 2.500% 22-Dec-2026	92.556	0,05
100.000	Repsol International Finance BV FRN (Perpetual) 3.750% 11-Mar-2026	99.567	0,06
100.000	Rexel SA 2.125% 15-Dec-2028	93.417	0,05
100.000	Rolls-Royce Plc 'EMTN' 0.875% 09-May-2024	100.944	0,06
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 4.625% 16-Feb-2026	104.009	0,06
100.000	Rossini Sarl 'REGS' 6.750% 30-Oct-2025	106.586	0,06
100.000	Saipem Finance International BV 'EMTN' 2.625% 07-Jan-2025	101.650	0,06
50.000	Schaeffler AG 'EMTN' 1.875% 26-Mar-2024	52.435	0,03
60.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2.875% 26-Mar-2027	59.450	0,03
100.000	Schaeffler AG 'EMTN' 3.375% 12-Oct-2028	93.518	0,05
157.712	Selecta Group BV 'REGS' 8.000% 01-Apr-2026	143.710	0,08
100.000	SES SA FRN (Perpetual) 2.875% 27-May-2026	85.702	0,05
100.000	Sigma Holdco BV 'REGS' 5.750% 15-May-2026	77.603	0,04
100.000	Silgan Holdings Inc 3.250% 15-Mar-2025	104.029	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 2.125% 06-Jul-2024	100.917	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 3.875% 06-Jul-2032	72.372	0,04
100.000	SoftBank Group Corp 4.500% 20-Apr-2025	101.328	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 4.750% 30-Jul-2025	100.755	0,06
100.000	SoftBank Group Corp 5.250% 30-Jul-2027	93.587	0,05
100.000	Solvay Finance SACA FRN (Perpetual) 5.869% 03-Jun-2024	107.520	0,06
100.000	Solvay SA FRN (Perpetual) 4.250% 04-Dec-2023	105.692	0,06
100.000	SPCM SA 'REGS' 2.000% 01-Feb-2026	99.433	0,06
100.000	SPIE SA 3.125% 22-Mar-2024	106.643	0,06
100.000	Standard Industries Inc/NJ 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	91.866	0,05
90.105	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	73.921	0,04
100.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	91.663	0,05
100.000	Summit Properties Ltd 'REGS' 2.000% 31-Jan-2025	92.908	0,05
100.000	Synthomer Plc 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025	98.525	0,06
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	98.734	0,06
100.000	Tele Columbus AG 'REGS' 3.875% 02-May-2025	81.187	0,05
180.000	Telecom Italia Finance SA 'EMTN' 7.750% 24-Jan-2033	203.511	0,11
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 1.625% 18-Jan-2029	81.143	0,05
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.375% 12-Oct-2027	90.360	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.750% 15-Apr-2025	99.441	0,06	
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 2.875% 28-Jan-2026	97.550	0,05	
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.000% 30-Sep-2025	99.738	0,06	
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 3.625% 25-May-2026	100.474	0,06	
100.000	Telecom Italia SpA/Milano 'EMTN' 4.000% 11-Apr-2024	104.591	0,06	
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029	80.567	0,05	
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.880% 24-Feb-2028	86.961	0,05	
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.875% 22-Jun-2026	97.365	0,05	
200.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024	204.710	0,11	
100.000	Teollisuuden Voima Oyj 'EMTN' 1.125% 09-Mar-2026	95.112	0,05	
100.000	Teollisuuden Voima Oyj 'EMTN' 1.375% 23-Jun-2028	88.952	0,05	
100.000	Teollisuuden Voima Oyj 'EMTN' 2.000% 08-May-2024	104.162	0,06	
100.000	Tereos Finance Groupe I SA 'REGS' 7.500% 30-Oct-2025	108.124	0,06	
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN (Perpetual) 2.375% 09-Nov-2027	89.921	0,05	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.625% 15-Oct-2028	79.837	0,04	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.875% 31-Mar-2027	86.424	0,05	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.750% 09-May-2027	92.968	0,05	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	88.778	0,05	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.500% 01-Mar-2025	102.878	0,06	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.000% 31-Jan-2025	105.710	0,06	
50.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 2.500% 25-Feb-2025	52.394	0,03	
150.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 2.875% 22-Feb-2024	158.679	0,09	
100.000	TI Automotive Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Apr-2029	79.541	0,04	
100.000	Titan Global Finance Plc 2.375% 16-Nov-2024	104.367	0,06	
90.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	79.967	0,04	
100.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	95.344	0,05	
100.000	TMNL Holding BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	94.076	0,05	
100.000	Triodos Bank NV FRN 2.250% 05-Feb-2032	81.980	0,05	
100.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	98.248	0,05	
100.000	UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029	82.307	0,05	
100.000	Unicaja Banco SA FRN 3.125% 19-Jul-2032	85.974	0,05	
200.000	UniCredit SpA FRN 2.731% 15-Jan-2032	180.552	0,10	
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.000% 18-Mar-2025	105.094	0,06	
100.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3.250% 23-Sep-2030	99.662	0,06	
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' 3.875% 01-Mar-2028	100.519	0,06	
100.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024	106.938	0,06	
200.000	United Group BV 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	159.586	0,09	
100.000	United Group BV 'REGS' 4.875% 01-Jul-2024	100.000	0,06	
100.000	United Group BV 'REGS' 5.250% 01-Feb-2030	77.426	0,04	
100.000	UPC Holding BV 'REGS' 3.875% 15-Jun-2029	89.389	0,05	
100.000	Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028	82.515	0,05	
200.000	Valeo 'EMTN' 1.500% 18-Jun-2025	198.113	0,11	
100.000	Vallourec SA 'REGS' 8.500% 30-Jun-2026	105.172	0,06	
200.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	191.462	0,11	
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.500% 20-Jan-2029	85.680	0,05	
100.000	Veratlia SA 1.625% 14-May-2028	92.354	0,05	
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027	93.287	0,05	
100.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	97.218	0,05	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
100.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029	85.809	0,05	
100.000	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA 'REGS' 5.250% 01-Apr-2026	96.411	0,05	
100.000	Victoria Plc 3.625% 24-Aug-2026	88.547	0,05	
100.000	Vivion Investments Sarl 3.000% 08-Aug-2024	83.565	0,05	
100.000	Vmed Q2 UK Financing I Plc 'REGS' 3.250% 31-Jan-2031	85.529	0,05	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 2.625% 27-Aug-2080	94.366	0,05	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080	85.706	0,05	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079	105.093	0,06	
100.000	Vodafone Group Plc FRN 4.200% 03-Oct-2078	97.365	0,05	
100.000	Volvo Car AB 'EMTN' 2.125% 02-Apr-2024	104.259	0,06	
100.000	Volvo Car AB 'EMTN' 2.500% 07-Oct-2027	94.683	0,05	
200.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	165.645	0,09	
100.000	Webuild SpA 3.875% 28-Jul-2026	86.573	0,05	
200.000	Webuild SpA 5.875% 15-Dec-2025	192.381	0,11	
10.000	Wienerberger AG 2.000% 02-May-2024	10.497	0,01	
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 2.499% 20-Apr-2026	86.698	0,05	
100.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	78.611	0,04	
100.000	WMG Acquisition Corp 'REGS' 2.250% 15-Aug-2031	84.234	0,05	
100.000	ZF Europe Finance BV 2.000% 23-Feb-2026	92.617	0,05	
100.000	ZF Europe Finance BV 2.500% 23-Oct-2027	88.474	0,05	
100.000	ZF Europe Finance BV 3.000% 23-Oct-2029	81.811	0,05	
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.750% 25-May-2027	90.453	0,05	
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.000% 21-Sep-2025	98.951	0,06	
100.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.750% 21-Sep-2028	90.241	0,05	
100.000	Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3.375% 28-Feb-2030	77.765	0,04	
Pfund Sterling - 4.095.977				
(31. Dezember 2021: 4.418.011)				
100.000	B&M European Value Retail SA 4.000% 15-Nov-2028	98.450	0,06	
100.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 7.594% 06-Dec-2032	120.043	0,07	
100.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026	98.272	0,05	
100.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	101.304	0,06	
100.000	Boparan Finance Plc 'REGS' 7.625% 30-Nov-2025	81.203	0,05	
100.000	Bracklen MidCo1 Plc 'REGS' 6.750% 01-Nov-2027	97.669	0,05	
25.000	Burford Capital Plc 6.125% 26-Oct-2024	29.278	0,02	
100.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028	98.207	0,05	
100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 8.625% 28-Feb-2033	121.826	0,07	
100.000	Constellation Automotive Financing Plc 'REGS' 4.875% 15-Jul-2027	78.654	0,04	
100.000	Co-Operative Bank Finance Plc/The FRN 9.000% 27-Nov-2025	119.158	0,07	
100.000	Co-Operative Group Ltd 5.125% 17-May-2024	114.637	0,06	
100.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	109.797	0,06	
100.000	Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027	96.332	0,05	
100.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.250% 01-Jun-2028	92.852	0,05	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 2.748% 14-Jun-2024	114.180	0,06	
100.000	Galaxy Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jul-2026	102.191	0,06	
100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	93.819	0,05	
100.000	Heathrow Finance Plc 5.750% 03-Mar-2025	117.307	0,07	
100.000	Hurricane Finance Plc 'REGS' 8.000% 15-Oct-2025	111.552	0,06	
100.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	100.020	0,06	
100.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	103.630	0,06	
100.000	Kane Bidco Ltd 'REGS' 6.500% 15-Feb-2027	99.666	0,06	
100.000	Market Bidco Finco Plc 'REGS' 5.500% 04-Nov-2027	90.927	0,05	
100.000	Marks & Spencer Plc 'EMTN' 3.750% 19-May-2026	105.223	0,06	
100.000	Metro Bank Plc 'EMTN' FRN 9.500% 08-Oct-2025	93.235	0,05	
100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028	88.133	0,05	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Pfund Sterling Forts.				
100.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	100.612	0,06	
100.000	NGG Finance Plc FRN 5.625% 18-Jun-2073	114.776	0,06	
100.000	Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026	93.210	0,05	
100.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.250% 30-Sep-2025	111.028	0,06	
100.000	Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026	102.741	0,06	
100.000	Rolls-Royce Plc 'REGS' 5.750% 15-Oct-2027	110.696	0,06	
100.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' 8.250% 31-Jul-2025	109.548	0,06	
100.000	TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025	94.343	0,05	
100.000	Thames Water Kemble Finance Plc 'REGS' 4.625% 19-May-2026	102.703	0,06	
100.000	Very Group Funding Plc/The 'REGS' 6.500% 01-Aug-2026	85.672	0,05	
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030	94.562	0,05	
100.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 5.000% 15-Apr-2027	108.073	0,06	
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	98.348	0,06	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	92.100	0,05	
US-Dollar - 133.552.171				
(31. Dezember 2021: 140.801.284)				
		133.552.171	74,65	
70.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	60.134	0,03	
140.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	125.545	0,07	
225.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	182.530	0,10	
125.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	112.108	0,06	
100.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025	99.392	0,06	
40.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	34.446	0,02	
50.000	AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2024	48.315	0,03	
35.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	34.356	0,02	
200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd 5.950% 31-Jul-2024	200.115	0,11	
79.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	75.746	0,04	
40.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	36.852	0,02	
20.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	19.002	0,01	
50.000	ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	41.315	0,02	
35.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2026	34.057	0,02	
60.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	49.603	0,03	
80.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	65.482	0,04	
72.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	66.268	0,04	
40.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	38.968	0,02	
40.000	AdaptHealth LLC '144A' 4.625% 01-Aug-2029	33.542	0,02	
50.000	AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030	42.629	0,02	
30.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	27.621	0,02	
25.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	23.311	0,01	
75.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	63.885	0,04	
40.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	34.064	0,02	
34.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	30.896	0,02	
10.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	9.341	0,01	
50.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2030	48.650	0,03	
30.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	22.919	0,01	
35.000	Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027	35.482	0,02	
58.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	55.920	0,03	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
105.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	104.276	0,06	
40.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	33.964	0,02	
45.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	41.424	0,02	
40.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC '144A' 8.625% 30-Sep-2027	40.250	0,02	
30.000	Ahead DB Holdings LLC '144A' 6.625% 01-May-2028	24.151	0,01	
250.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033	190.520	0,11	
85.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	75.420	0,04	
100.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	102.465	0,06	
145.000	Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025	7.908	0,00	
200.000	Akbank TAS 'REGS' 6.800% 06-Feb-2026	193.797	0,11	
100.000	Akumin Inc '144A' 7.000% 01-Nov-2025	71.745	0,04	
180.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	164.453	0,09	
145.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	121.973	0,07	
112.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	104.280	0,06	
82.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	73.327	0,04	
80.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	76.192	0,04	
60.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 7.500% 15-Mar-2026	61.366	0,03	
50.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	44.661	0,02	
60.000	Algonquin Power & Utilities Corp FRN 4.750% 18-Jan-2082	48.687	0,03	
40.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	39.923	0,02	
90.000	Alliant Travel Co '144A' 7.250% 15-Aug-2027	85.732	0,05	
90.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	37.042	0,02	
51.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	50.697	0,03	
70.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	62.802	0,04	
80.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Nov-2029	65.896	0,04	
145.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	130.646	0,07	
60.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	43.624	0,02	
140.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	128.388	0,07	
190.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	165.708	0,09	
40.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	32.482	0,02	
100.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	82.780	0,05	
155.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	127.681	0,07	
50.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	46.451	0,03	
40.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	37.635	0,02	
137.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	132.894	0,07	
105.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	84.751	0,05	
125.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	98.555	0,06	
100.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	59.244	0,03	
200.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	152.930	0,09	
70.000	Altice France SA / France '144A' 5.125% 15-Jan-2029	52.748	0,03	
115.000	Altice France SA / France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	86.426	0,05	
95.000	Altice France SA / France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	74.601	0,04	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
184.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	140.634	0,08
165.000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 01-Feb-2027	150.635	0,08
50.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2029	27.250	0,02
65.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Jun-2026	27.160	0,02
95.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	59.334	0,03
60.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	45.705	0,03
50.000	AMC Networks Inc 5.000% 01-Apr-2024	46.837	0,03
130.945	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	113.813	0,06
51.816	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	44.865	0,03
106.386	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	89.027	0,05
125.013	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	102.317	0,06
28.856	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	22.500	0,01
30.000	American Airlines 2021-1 Class B Pass Through Trust 3.950% 11-Jul-2030	24.262	0,01
43.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	36.489	0,02
134.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	144.011	0,08
260.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	237.639	0,13
35.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	28.319	0,02
9.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.250% 15-Mar-2026	8.437	0,00
40.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.500% 01-Apr-2027	36.151	0,02
70.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	57.311	0,03
83.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	74.195	0,04
10.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	9.623	0,01
60.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.500% 20-May-2025	57.665	0,03
60.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.625% 20-May-2024	58.334	0,03
50.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.750% 20-May-2027	46.546	0,03
55.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.875% 20-Aug-2026	52.319	0,03
45.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	44.606	0,02
30.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	25.744	0,01
54.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	49.885	0,03
55.000	ams-OSRAM AG '144A' 7.000% 31-Jul-2025	51.843	0,03
31.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	26.578	0,01
35.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	33.342	0,02
70.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	59.461	0,03
35.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	26.030	0,01
65.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	59.513	0,03
65.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	61.543	0,03
48.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	44.608	0,02
40.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	40.547	0,02
35.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	32.496	0,02
50.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	50.355	0,03
55.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	48.767	0,03
20.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2044	14.114	0,01
35.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	31.608	0,02
30.000	Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043	22.688	0,01
83.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	68.970	0,04
70.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	57.638	0,03
30.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	24.296	0,01
40.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	37.095	0,02
70.000	Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029	73.647	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029	33.200	0,02
40.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	32.252	0,02
20.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	14.050	0,01
100.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	82.912	0,05
20.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	19.282	0,01
200.000	Arabian Centres Sukuk Ltd 'REGS' 5.375% 26-Nov-2024	191.666	0,11
50.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025	48.867	0,03
147.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	137.441	0,08
181.000	Aramark Services Inc '144A' 6.375% 01-May-2025	179.143	0,10
65.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	50.924	0,03
75.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	60.288	0,03
37.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	33.916	0,02
15.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	14.343	0,01
55.000	Arconic Corp '144A' 6.000% 15-May-2025	54.208	0,03
75.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	70.499	0,04
69.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	59.923	0,03
100.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	69.767	0,04
78.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	66.385	0,04
107.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	85.003	0,05
70.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	68.625	0,04
124.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	107.667	0,06
85.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	81.082	0,05
89.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	66.712	0,04
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	74.957	0,04
80.000	Aretex Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2029	66.197	0,04
65.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	51.122	0,03
84.453	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	70.490	0,04
40.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	35.267	0,02
105.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	87.958	0,05
80.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	67.506	0,04
70.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032	57.680	0,03
30.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	26.788	0,01
99.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	96.185	0,05
20.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 8.250% 31-Dec-2028	19.630	0,01
66.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	59.860	0,03
55.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	54.311	0,03
100.000	Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031	80.041	0,04
50.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029	40.115	0,02
25.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	20.086	0,01
15.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	13.269	0,01
100.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 5.250% 30-Sep-2028	80.592	0,05
30.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 7.500% 30-Sep-2029	19.080	0,01
40.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	32.974	0,02
40.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	38.747	0,02
115.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	107.000	0,06
20.000	At Home Group Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2028	14.126	0,01
50.000	At Home Group Inc '144A' 7.125% 15-Jul-2029	29.070	0,02
25.000	Athabasca Oil Corp '144A' 9.750% 01-Nov-2026	26.530	0,01
255.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	188.396	0,11

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
30.000	ATI Inc 4.875% 01-Oct-2029	26.550	0,01
50.000	ATI Inc 5.875 % 01-Dec-2027	47.892	0,03
50.000	Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031	42.947	0,02
60.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028	53.290	0,03
45.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.500% 01-May-2027	8.538	0,00
50.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	8.725	0,00
70.000	Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029	58.872	0,03
151.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	137.519	0,08
150.000	Avaya Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2028	45.994	0,03
90.000	Avianca Midco 2 Plc 'REGS' 9.000% 01-Dec-2028	66.983	0,04
45.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	43.952	0,02
55.000	Avient Corp '144A' 7.125% 01-Aug-2030	53.837	0,03
10.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 4.750% 01-Apr-2028	8.438	0,00
30.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.375% 01-Mar-2029	25.702	0,01
10.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	9.062	0,01
25.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	22.714	0,01
5.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	4.796	0,00
50.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	46.297	0,03
115.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	95.033	0,05
200.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	164.569	0,09
70.000	B&G Foods Inc 5.250% 01-Apr-2025	61.487	0,03
50.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	38.423	0,02
45.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	42.738	0,02
85.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	67.957	0,04
105.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	84.465	0,05
65.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	63.103	0,04
70.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	69.186	0,04
170.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS' 3.200% 27-Jan-2025	162.683	0,09
75.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS' 4.375% 18-Mar-2027	72.032	0,04
45.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 2.750% 11-Jan-2026	40.949	0,02
140.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 4.500% 10-Jan-2025	135.129	0,08
100.000	Banco de Bogota SA 'REGS' 6.250% 12-May-2036	98.230	0,05
190.000	Bancolumbia SA 3.000% 29-Jan-2025	180.152	0,10
50.000	Banijay Entertainment SASU '144A' 5.375% 01-Mar-2025	47.329	0,03
200.000	Bank Muscat SAOG 'EMTN' 4.750% 17-Mar-2026	191.170	0,11
40.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	37.209	0,02
135.000	Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027	134.378	0,08
55.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	48.438	0,03
90.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	80.163	0,04
70.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	61.530	0,03
40.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	39.560	0,02
50.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	42.332	0,02
110.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	103.412	0,06
30.000	Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025	32.083	0,02
70.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027	36.861	0,02
75.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	52.618	0,03
150.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	95.687	0,05
50.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	24.082	0,01
255.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	122.752	0,07
225.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025	191.605	0,11
55.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	37.588	0,02
80.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 01-Feb-2027	55.258	0,03
275.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 11.000% 30-Sep-2028	215.832	0,12
52.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 14.000% 15-Oct-2030	31.130	0,02
70.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	71.339	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
65.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	58.372	0,03
30.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	18.575	0,01
100.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2026	93.580	0,05
50.000	Beazer Homes USA Inc 5.875 % 15-Oct-2027	43.814	0,02
20.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	17.823	0,01
50.000	BellRing Brands Inc '144A' 7.000% 15-Mar-2030	48.176	0,03
10.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	9.550	0,01
15.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	14.670	0,01
18.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	17.227	0,01
30.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	29.324	0,02
60.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026	55.201	0,03
67.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	63.952	0,04
105.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	91.350	0,05
40.000	Blackstone Mortgage Trust Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2027	34.446	0,02
10.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	8.741	0,00
70.000	Block Inc 2.750% 01-Jun-2026	62.623	0,04
100.000	Block Inc 3.500% 01-Jun-2031	79.920	0,04
20.000	Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029	16.848	0,01
90.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	87.257	0,05
62.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	61.616	0,03
30.000	BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	24.939	0,01
10.000	Boise Cascade Co '144A' 4.875% 01-Jul-2030	8.765	0,00
60.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	55.540	0,03
150.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	145.798	0,08
112.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 15-Mar-2025	111.139	0,06
170.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	165.249	0,09
60.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	53.264	0,03
75.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 4.000% 01-Jul-2029	66.119	0,04
200.000	Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2026	183.604	0,10
55.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	53.575	0,03
55.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 9.125% 01-Mar-2026	51.975	0,03
84.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	78.359	0,04
70.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	60.983	0,03
29.000	Boyne USA Inc '144A' 4.750% 15-May-2029	25.703	0,01
96.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 8.500% 15-Jul-2025	76.854	0,04
200.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7.450% 15-Nov-2029	158.219	0,09
180.000	BRF SA 'REGS' 5.750% 21-Sep-2050	128.761	0,07
25.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	22.676	0,01
45.000	Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027	41.252	0,02
75.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	73.766	0,04
40.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	36.864	0,02
60.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081	50.548	0,03
50.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.875% 23-Nov-2081	39.405	0,02
65.000	BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029	55.405	0,03
60.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	50.234	0,03
83.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Sellco LL '144A' 5.750% 15-May-2026	75.795	0,04
10.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	7.813	0,00
50.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	44.484	0,02
20.000	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2026	18.258	0,01
60.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	53.775	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
35.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	30.676	0,02
20.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	19.353	0,01
25.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	18.451	0,01
30.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	22.544	0,01
71.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	67.765	0,04
106.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	93.338	0,05
110.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	89.470	0,05
95.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	84.349	0,05
60.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2032	56.436	0,03
120.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	107.339	0,06
40.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	36.081	0,02
35.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	30.682	0,02
200.000	C&W Senior Financing DAC '144A' 6.875% 15-Sep-2027	186.436	0,10
100.000	CA Magnum Holdings 'REGS' 5.375% 31-Oct-2026	91.373	0,05
110.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	86.453	0,05
120.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027	99.476	0,06
89.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028	66.281	0,04
110.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	89.715	0,05
176.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	171.536	0,10
179.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	176.245	0,10
89.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025	87.253	0,05
100.000	California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026	96.222	0,05
50.000	Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026	46.681	0,03
40.000	Callon Petroleum Co 8.250% 15-Jul-2025	40.050	0,02
45.000	Callon Petroleum Co '144A' 7.500% 15-Jun-2030	41.233	0,02
45.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	42.781	0,02
85.000	Calpine Corp '144A' 3.750% 01-Mar-2031	68.525	0,04
97.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	86.593	0,05
55.000	Calpine Corp '144A' 4.625% 01-Feb-2029	47.422	0,03
71.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	59.747	0,03
113.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	101.129	0,06
85.000	Calpine Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2026	81.103	0,05
22.700	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 8.125% 15-Jan-2027	21.253	0,01
37.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 01-Apr-2025	38.620	0,02
30.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	28.164	0,02
65.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	39.650	0,02
40.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	36.366	0,02
30.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	19.960	0,01
425.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	304.202	0,17
100.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	66.826	0,04
145.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	115.183	0,06
65.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	61.533	0,03
60.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Feb-2026	60.020	0,03
100.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	81.475	0,05
175.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	179.967	0,10
25.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	24.293	0,01
38.000	Carpenter Technology Corp 6.375% 15-Jul-2028	36.206	0,02
40.000	Carpenter Technology Corp 7.625% 15-Mar-2030	40.153	0,02
25.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	17.782	0,01
20.000	Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029	15.899	0,01
30.000	Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029	21.065	0,01
20.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	17.802	0,01
20.000	Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	7.731	0,00
65.000	Carvana Co '144A' 5.500% 15-Apr-2027	25.833	0,01
20.000	Carvana Co '144A' 5.875% 01-Oct-2028	7.838	0,00
310.000	Carvana Co '144A' 10.250% 01-May-2030	146.244	0,08

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	18.243	0,01
55.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	48.245	0,03
40.000	Castle US Holding Corp '144A' 9.500% 15-Feb-2028	15.925	0,01
75.000	Castlelake Aviation Finance DAC '144A' 5.000% 15-Apr-2027	65.358	0,04
53.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	41.916	0,02
41.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	38.209	0,02
20.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	18.872	0,01
284.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	226.795	0,13
300.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	240.750	0,13
170.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	125.800	0,07
260.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	215.387	0,12
150.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	115.387	0,06
295.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	252.178	0,14
120.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750 % 01-Feb-2032	97.529	0,05
246.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	222.865	0,12
142.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	128.198	0,07
80.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	77.564	0,04
389.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 6.375% 01-Sep-2029	366.308	0,20
65.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	56.103	0,03
150.000	CDI Escrow Issuer Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2030	134.728	0,08
50.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	46.562	0,03
30.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	26.990	0,02
15.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	14.324	0,01
60.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	59.251	0,03
55.000	Cellnex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041	37.699	0,02
200.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	169.903	0,09
180.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 5.450% 19-Nov-2029	173.317	0,10
80.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual) 5.125% 08-Jun-2026	74.023	0,04
80.000	Cengage Learning Inc '144A' 9.500% 15-Jun-2024	76.419	0,04
90.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	84.081	0,05
65.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	53.373	0,03
40.000	Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028	37.274	0,02
90.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	74.619	0,04
90.000	Central Parent Inc / CDK Global Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2029	88.206	0,05
45.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	43.053	0,02
45.000	Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029	35.440	0,02
30.000	Cerdia Finanz GmbH '144A' 10.500% 15-Feb-2027	25.205	0,01
40.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	35.434	0,02
45.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031	38.990	0,02
40.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	36.910	0,02
105.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	97.127	0,05
50.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	40.940	0,02
130.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	116.948	0,07
145.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	131.348	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	33.511	0,02
80.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	77.302	0,04
40.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	37.959	0,02
95.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	92.620	0,05
200.000	China Hongqiao Group Ltd 6.250% 08-Jun-2024	187.161	0,10
200.000	China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09-Apr-2024	91.250	0,05
70.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2028	61.055	0,03
65.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	63.396	0,04
75.000	Chord Energy Corp '144A' 6.375% 01-Jun-2026	73.149	0,04
85.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031	61.871	0,03
50.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	37.791	0,02
185.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	158.967	0,09
50.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029	41.889	0,02
200.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	99.411	0,06
170.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	87.692	0,05
224.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	204.400	0,11
100.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027	90.229	0,05
65.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	58.276	0,03
105.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	99.656	0,06
80.000	Ciena Corp '144A' 4.000% 31-Jan-2030	70.511	0,04
40.000	Cimpress Plc '144A' 7.000% 15-Jun-2026	27.715	0,02
65.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	48.347	0,03
30.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	25.026	0,01
75.000	Cinemark USA Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	75.936	0,04
85.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	77.818	0,04
200.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	196.405	0,11
70.000	Clarios Global LP '144A' 6.750% 15-May-2025	70.196	0,04
85.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028	73.744	0,04
120.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029	102.198	0,06
40.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	37.969	0,02
20.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	18.590	0,01
10.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	9.558	0,01
145.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	125.692	0,07
95.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	69.934	0,04
85.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	62.161	0,03
10.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	8.845	0,00
75.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Feb-2031	62.383	0,03
50.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Jan-2032	40.089	0,02
75.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4.750% 15-Mar-2028	69.272	0,04
25.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	23.926	0,01
20.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029	17.779	0,01
65.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2031	57.488	0,03
70.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	70.295	0,04
500.000	Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	422.320	0,24
85.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 6.625% 15-Apr-2029	80.970	0,05
95.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Apr-2030	81.518	0,05
94.000	CMG Media Corp '144A' 8.875% 15-Dec-2027	70.902	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
30.000	CNX Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Apr-2030	24.659	0,01
29.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	26.727	0,01
51.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	50.705	0,03
60.000	Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029	35.478	0,02
30.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026	27.291	0,02
90.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	88.306	0,05
80.000	Coherent Corp '144A' 5.000% 15-Dec-2029	69.098	0,04
150.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	79.485	0,04
50.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	43.008	0,02
70.000	Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031	58.956	0,03
70.000	Commercial Metals Co 4.125% 15-Jan-2030	62.264	0,03
25.000	Commercial Metals Co 4.375% 15-Mar-2032	21.784	0,01
75.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	60.606	0,03
137.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	126.201	0,07
50.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	35.825	0,02
100.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	78.250	0,04
110.000	CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027	74.886	0,04
108.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	98.801	0,06
124.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	106.279	0,06
30.000	Compass Minerals International Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2024	29.026	0,02
120.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	115.386	0,06
30.000	Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030	25.830	0,01
69.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	62.397	0,03
220.000	Condor Merger Sub Inc '144A' 7.375% 15-Feb-2030	177.337	0,10
50.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029	40.915	0,02
230.000	Connect Finco SARRL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	213.628	0,12
10.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	9.395	0,01
45.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028	41.448	0,02
50.000	Consolidated Communications Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2028	36.938	0,02
20.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	15.591	0,01
100.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 6.500% 15-May-2026	93.863	0,05
35.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	30.959	0,02
45.000	Constellation SE '144A' 3.750% 15-Apr-2029	36.617	0,02
20.000	Constellation SE '144A' 5.625% 15-Jun-2028	18.516	0,01
20.000	Constellation SE '144A' 5.875% 15-Feb-2026	19.084	0,01
20.000	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 13.000% 01-Jun-2024	20.899	0,01
30.000	CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027	26.086	0,01
65.000	CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026	66.748	0,04
110.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	84.534	0,05
115.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029	81.193	0,05
52.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 6.750% 15-Aug-2024	41.682	0,02
30.000	Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026	30.754	0,02
110.000	Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029	103.717	0,06
120.000	Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026	113.959	0,06
35.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	31.726	0,02
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd 3.300% 12-Jan-2031	105.808	0,06
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd 5.125% 17-Jan-2025	135.464	0,08
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd 5.125% 14-Jan-2027	115.904	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd 6.150% 17-Sep-2025	131.355	0,07	
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd 7.250% 08-Apr-2026	127.672	0,07	
26.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	21.053	0,01	
50.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	41.029	0,02	
65.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	48.360	0,03	
100.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	87.538	0,05	
50.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	47.469	0,03	
36.000	Credit Acceptance Corp '144A' 5.125% 31-Dec-2024	33.927	0,02	
50.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026	47.181	0,03	
40.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5.750% 01-Apr-2025	38.981	0,02	
50.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5.625% 01-May-2027	46.586	0,03	
60.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029	55.137	0,03	
40.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 8.000% 01-Apr-2029	39.862	0,02	
64.000	Crocs Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2031	52.238	0,03	
35.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	29.594	0,02	
25.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	23.882	0,01	
50.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	48.543	0,03	
45.000	Crown Americas LLC '144A' 5.250% 01-Apr-2030	42.613	0,02	
15.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	15.468	0,01	
60.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	54.231	0,03	
119.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	115.077	0,06	
50.000	CSC Holdings LLC 5.250% 01-Jun-2024	46.625	0,03	
50.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	32.689	0,02	
16.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	11.344	0,01	
70.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	48.698	0,03	
210.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	116.500	0,07	
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Nov-2031	112.000	0,06	
54.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	43.623	0,02	
69.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	58.031	0,03	
91.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	51.524	0,03	
109.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	89.338	0,05	
294.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	199.832	0,11	
400.000	CSN Inova Ventures 'REGS' 6.750% 28-Jan-2028	382.430	0,21	
200.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	175.907	0,10	
70.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028	59.440	0,03	
12.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	10.099	0,01	
65.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	30.404	0,02	
65.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	62.148	0,03	
75.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	69.111	0,04	
50.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	43.604	0,02	
50.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028	44.913	0,03	
55.000	CWT Travel Group Inc '144A' 8.500% 19-Nov-2026	46.756	0,03	
35.000	Dana Inc 4.250% 01-Sep-2030	28.248	0,02	
90.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	72.117	0,04	
20.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	18.587	0,01	
20.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	18.222	0,01	
200.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 6.750% 15-Feb-2025	194.268	0,11	
35.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	33.742	0,02	
110.000	Darling Ingredients Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2030	107.673	0,06	
40.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	40.258	0,02	
290.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	217.081	0,12	
316.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	254.322	0,14	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
25.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	22.036	0,01	
25.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	24.191	0,01	
50.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS' 6.125% 31-Oct-2026	48.240	0,03	
50.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS' 6.450% 04-Jun-2029	46.910	0,03	
25.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	23.725	0,01	
74.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	61.642	0,03	
35.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	31.255	0,02	
75.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	76.753	0,04	
50.000	Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029	41.190	0,02	
80.000	Diamond BC BV '144A' 4.625% 01-Oct-2029	64.304	0,04	
80.000	Diebold Nixdorf Inc '144A' 9.375% 15-Jul-2025	54.534	0,03	
50.000	Digital International Finance Ltd/Digital international Holdings Ltd 'REGS' 8.750% 25-May-2024	43.079	0,02	
420.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	376.555	0,21	
375.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	242.653	0,14	
499.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	464.716	0,26	
125.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	88.641	0,05	
252.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	204.186	0,11	
284.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	239.756	0,13	
240.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	192.000	0,11	
50.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 01-May-2024	42.329	0,02	
45.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	25.665	0,01	
34.000	Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025	32.630	0,02	
75.000	Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028	65.780	0,04	
100.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	70.281	0,04	
35.000	DPL Inc 4.125% 01-Jul-2025	32.943	0,02	
33.000	DPL Inc 4.350% 15-Apr-2029	29.713	0,02	
40.000	Drax Fincos Plc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	38.289	0,02	
116.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	120.141	0,07	
150.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	129.155	0,07	
117.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	98.309	0,05	
35.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 5.000% 15-Dec-2029	29.997	0,02	
40.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	34.874	0,02	
150.000	Eagle Intermediate Global Holding BV/Eagle US Finance LLC 'REGS' 7.500% 01-May-2025	96.874	0,05	
50.000	Earthstone Energy Holdings LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2027	47.816	0,03	
40.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	38.118	0,02	
40.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029	34.157	0,02	
105.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	98.385	0,06	
80.000	eG Global Finance Plc '144A' 6.750% 07-Feb-2025	69.969	0,04	
50.000	eG Global Finance Plc '144A' 8.500% 30-Oct-2025	46.660	0,03	
55.000	Elanco Animal Health Inc 6.400% 28-Aug-2028	52.608	0,03	
125.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	101.122	0,06	
125.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	106.450	0,06	
120.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	56.065	0,03	
115.000	Embeckta Corp '144A' 5.000% 15-Feb-2030	97.488	0,05	
70.000	Embraer Netherlands Finance BV 5.050% 15-Jun-2025	68.056	0,04	
170.000	Embraer Netherlands Finance BV 5.400% 01-Feb-2027	163.067	0,09	
50.000	Embraer Netherlands Finance BV 'REGS' 6.950% 17-Jan-2028	50.086	0,03	
40.000	Emergent BioSolutions Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2028	19.948	0,01	
50.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	45.271	0,03	
50.000	Empire Resorts Inc '144A' 7.750% 01-Nov-2026	40.173	0,02	
60.000	Enact Holdings Inc '144A' 6.500% 15-Aug-2025	59.203	0,03	
75.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	68.174	0,04	
71.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	64.606	0,04	
105.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	90.418	0,05	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
68.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	59.823	0,03	
105.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	100.970	0,06	
60.000	Endurance International Group Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	41.322	0,02	
70.000	Enerflex Ltd '144A' 9.000% 15-Oct-2027	69.900	0,04	
100.000	Energiean Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024	96.725	0,05	
105.000	Energiean Israel Finance Ltd '144A' 4.875% 30-Mar-2026	97.461	0,05	
105.000	Energiean Israel Finance Ltd '144A' 5.375% 30-Mar-2028	94.500	0,05	
115.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	97.484	0,05	
30.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	26.046	0,01	
50.000	Energizer Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Dec-2027	47.647	0,03	
18.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	18.653	0,01	
10.000	EnerSys '144A' 4.375% 15-Dec-2027	9.047	0,01	
75.000	EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA '144A' 5.375% 30-Dec-2030	52.611	0,03	
40.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	38.156	0,02	
120.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	118.926	0,07	
45.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	42.605	0,02	
25.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	23.544	0,01	
20.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	15.192	0,01	
100.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	80.341	0,04	
30.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	24.884	0,01	
100.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd 'REGS' 3.375% 12-May-2026	87.324	0,05	
40.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 01-Sep-2024	37.711	0,02	
33.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	30.648	0,02	
30.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	29.241	0,02	
25.000	Ensign Drilling Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2024	23.667	0,01	
51.000	Enstar Finance LLC FRN 5.750% 01-Sep-2040	46.502	0,03	
100.000	Entegris Escrow Corp '144A' 5.950% 15-Jun-2030	92.350	0,05	
45.000	Entegris Inc '144A' 3.625% 01-May-2029	36.699	0,02	
60.000	Entegris Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2028	53.150	0,03	
52.000	Envision Healthcare Corp '144A' 8.750% 15-Oct-2026	14.402	0,01	
65.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2026	61.322	0,03	
79.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	70.419	0,04	
65.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	58.237	0,03	
25.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	18.781	0,01	
54.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	45.435	0,03	
120.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	98.335	0,05	
19.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	18.368	0,01	
30.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	28.725	0,02	
30.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2027	29.418	0,02	
30.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2030	28.947	0,02	
35.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	30.109	0,02	
35.000	FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc '144A' 5.625% 15-Aug-2026	32.523	0,02	
100.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	90.928	0,05	
80.000	Fair Isaac Corp '144A' 5.250% 15-May-2026	78.452	0,04	
35.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026	28.788	0,02	
80.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	72.872	0,04	
35.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	28.767	0,02	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
110.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 4.625% 15-Jan-2029	93.229	0,05	
100.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	80.848	0,05	
20.000	Finance of America Funding LLC '144A' 7.875% 15-Nov-2025	10.412	0,01	
50.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.500% 01-Mar-2024	48.988	0,03	
100.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 01-Mar-2026	94.851	0,05	
200.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 6.875% 15-Oct-2027	188.057	0,11	
200.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS' 7.500% 01-Apr-2025	195.080	0,11	
35.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	29.000	0,02	
92.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	80.920	0,05	
60.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	53.147	0,03	
50.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	46.408	0,03	
135.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	107.389	0,06	
45.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	36.770	0,02	
125.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	83.347	0,05	
109.000	FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027	101.903	0,06	
23.000	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	20.575	0,01	
65.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	73.322	0,04	
30.000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15-Nov-2025	25.266	0,01	
10.000	Fluor Corp 3.500% 15-Dec-2024	9.617	0,01	
25.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	22.544	0,01	
230.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	191.730	0,11	
65.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	60.074	0,03	
75.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15-May-2024	73.841	0,04	
80.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125% 15-Apr-2032	74.724	0,04	
40.000	Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029	31.220	0,02	
70.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	78.762	0,04	
175.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	131.570	0,07	
87.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	82.765	0,05	
200.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	144.098	0,08	
210.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	160.516	0,09	
150.000	Ford Motor Co 6.100% 19-Aug-2032	139.057	0,08	
10.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	9.633	0,01	
30.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	29.711	0,02	
35.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	34.187	0,02	
95.000	Ford Motor Co 7.450% 16-Jul-2031	97.380	0,05	
50.000	Ford Motor Co 7.500% 01-Aug-2026	52.168	0,03	
40.000	Ford Motor Co 9.625% 22-Apr-2030	45.320	0,03	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.300% 10-Feb-2025	90.488	0,05	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.700% 10-Aug-2026	130.459	0,07	
30.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028	24.814	0,01	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	120.005	0,07	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-Nov-2025	135.867	0,08	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.625% 17-Jun-2031	78.759	0,04	
95.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	90.691	0,05	
20.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	19.480	0,01	
65.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	57.389	0,03	
125.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	102.851	0,06	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024	144.429	0,08	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	134.594	0,08	
150.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	140.729	0,08	
75.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	67.965	0,04	
60.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	55.387	0,03	
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	47.738	0,03	
130.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.950% 28-May-2027	121.520	0,07	
155.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	140.709	0,08	
175.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16-Jun-2025	168.562	0,09	
120.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024	118.686	0,07	
50.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350% 04-Nov-2027	51.360	0,03	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
75.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	70.245	0,04
40.000	Forestar Group Inc '144A' 3.850% 15-May-2026	35.124	0,02
30.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	25.791	0,01
70.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028	59.810	0,03
93.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	87.602	0,05
32.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	32.136	0,02
200.000	Fortune Star BVI Ltd 5.000% 18-May-2026	137.249	0,08
80.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	60.258	0,03
55.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027	42.873	0,02
60.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026	50.142	0,03
35.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.125% 15-Nov-2024	32.255	0,02
54.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.250% 15-Apr-2025	48.657	0,03
100.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	77.498	0,04
112.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	97.475	0,05
220.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	204.769	0,11
85.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	66.884	0,04
85.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	70.434	0,04
110.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750 % 15-May-2030	112.056	0,06
50.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	46.088	0,03
200.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	201.152	0,11
65.000	FTAI Infra Escrow Holdings LLC '144A' 10.500% 01-Jun-2027	65.115	0,04
50.000	Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028	44.328	0,02
58.000	FXI Holdings Inc '144A' 7.875 % 01-Nov-2024	48.150	0,03
70.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250 % 15-Nov-2026	58.265	0,03
35.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	28.570	0,02
85.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	60.072	0,03
65.000	Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031	45.441	0,03
115.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	101.740	0,06
65.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	62.699	0,04
35.000	Garden Spino Corp '144A' 8.625% 20-Jul-2030	37.151	0,02
65.000	Gartner Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2029	57.195	0,03
80.000	Gartner Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2030	69.078	0,04
70.000	Gartner Inc '144A' 4.500% 01-Jul-2028	65.387	0,04
55.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026	53.160	0,03
40.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	33.669	0,02
200.000	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 'REGS' 7.125% 31-Jul-2026	192.562	0,11
145.000	Gen Digital Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025	141.371	0,08
109.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	106.962	0,06
70.000	Gen Digital Inc '144A' 7.125% 30-Sep-2030	68.870	0,04
35.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 5.625% 15-Jun-2024	33.847	0,02
30.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	27.496	0,02
50.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.500% 01-Oct-2025	47.569	0,03
66.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	60.856	0,03
75.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	70.798	0,04
100.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	87.585	0,05
35.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	30.865	0,02
70.000	GEO Group Inc/The 10.500% 30-Jun-2028	71.149	0,04
10.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	9.886	0,01
60.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	52.827	0,03
66.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	62.474	0,03

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
35.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	29.971	0,02
45.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	43.053	0,02
56.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2029	47.529	0,03
50.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029	43.826	0,02
40.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	38.320	0,02
70.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	65.401	0,04
80.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	48.214	0,03
102.645	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024	87.469	0,05
65.000	Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051	49.613	0,03
25.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2032	19.822	0,01
96.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	68.860	0,04
40.000	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027	33.314	0,02
73.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	69.438	0,04
35.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	29.347	0,02
55.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	52.150	0,03
150.000	goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	132.963	0,07
20.000	goeasy Ltd '144A' 5.375% 01-Dec-2024	19.221	0,01
150.000	Gol Finance SA 'REGS' 7.000% 31-Jan-2025	66.187	0,04
50.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	49.360	0,03
10.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	9.162	0,01
50.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026	47.235	0,03
110.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 15-Jul-2029	91.899	0,05
30.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250 % 30-Apr-2031	24.813	0,01
50.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250% 15-Jul-2031	40.962	0,02
30.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033	24.539	0,01
20.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000% 15-Mar-2028	19.800	0,01
34.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	34.992	0,02
120.000	GoTo Group Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	64.728	0,04
45.000	GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026	38.434	0,02
35.000	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2028	22.195	0,01
45.000	GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028	37.021	0,02
95.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	93.488	0,05
50.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	41.793	0,02
55.000	Grand Canyon University 4.125% 01-Oct-2024	51.726	0,03
80.000	Grand Canyon University 5.125% 01-Oct-2028	75.463	0,04
10.000	Granite US Holdings Corp '144A' 11.000% 01-Oct-2027	10.552	0,01
25.000	Graphic Packaging International LLC 4.125% 15-Aug-2024	24.601	0,01
60.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	52.287	0,03
50.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	42.876	0,02
40.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030	34.078	0,02
85.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 4.750% 15-Jul-2027	80.138	0,04
30.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	21.673	0,01
115.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	81.838	0,05
111.000	Gray Television Inc '144A' 7.000% 15-May-2027	98.612	0,06
50.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5.750% 01-Dec-2025	48.949	0,03
66.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	60.492	0,03
50.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	43.233	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
64.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	54.279	0,03
87.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	63.139	0,04
65.000	Grupo Aeromexico SAB de CV 'REGS' 8.500% 17-Mar-2027	57.492	0,03
150.000	Grupo Aval Ltd 'REGS' 4.375% 04-Feb-2030	121.958	0,07
45.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA 'REGS' 5.500% 29-Apr-2026	43.498	0,02
60.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	57.568	0,03
50.000	Guitar Center Inc '144A' 8.500% 15-Jan-2026	41.151	0,02
80.000	Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026	78.102	0,04
70.000	H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028	59.748	0,03
10.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	8.852	0,00
75.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.625% 15-May-2024	72.762	0,04
55.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	49.243	0,03
45.000	Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026	40.412	0,02
64.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	50.633	0,03
75.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	71.765	0,04
95.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	82.668	0,05
60.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025	58.200	0,03
36.548	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	31.355	0,02
105.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	95.224	0,05
25.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	23.134	0,01
35.000	HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028	31.095	0,02
40.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	35.006	0,02
60.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	59.171	0,03
101.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	89.948	0,05
90.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	84.130	0,05
19.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	14.225	0,01
90.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	75.488	0,04
100.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000 % 01-Dec-2029	75.990	0,04
60.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030	51.378	0,03
65.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	60.241	0,03
50.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.500% 15-Oct-2030	45.812	0,03
63.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	61.470	0,03
10.000	H-Food Holdings LLC / Hearthsides Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	5.816	0,00
25.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	21.014	0,01
50.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	44.576	0,02
45.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 15-Apr-2030	40.082	0,02
80.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	69.305	0,04
55.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	49.873	0,03
55.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 15-Apr-2032	47.541	0,03
25.000	Hillenbrand Inc 3.750% 01-Mar-2031	20.533	0,01
55.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	53.186	0,03
35.000	Hillenbrand Inc 5.750% 15-Jun-2025	34.890	0,02
119.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	108.039	0,06
225.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	180.580	0,10
75.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	64.976	0,04
135.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	113.223	0,06
40.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	38.871	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
35.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 4.875% 01-Jul-2031	28.611	0,02
68.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	58.567	0,03
64.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	61.027	0,03
2.000	Historic TW Inc Step-Up Coupon 8.300% 15-Jan-2036	2.286	0,00
48.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	33.123	0,02
57.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	51.997	0,03
75.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 6.375% 15-Apr-2027	73.784	0,04
110.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	94.636	0,05
50.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	47.231	0,03
25.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	17.318	0,01
78.000	Horizon Therapeutics USA Inc '144A' 5.500% 01-Aug-2027	79.585	0,04
49.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	41.108	0,02
65.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	52.683	0,03
65.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	58.662	0,03
25.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	23.995	0,01
60.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	51.087	0,03
150.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	148.455	0,08
106.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	103.103	0,06
30.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	30.454	0,02
95.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	97.641	0,05
200.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	186.000	0,10
40.000	HUB International Ltd '144A' 5.625% 01-Dec-2029	34.987	0,02
170.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	166.773	0,09
40.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500% 01-Apr-2026	36.382	0,02
70.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	63.461	0,04
60.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	57.655	0,03
104.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	97.187	0,05
85.000	Hunt Cos Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2029	71.554	0,04
131.100	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 'REGS' 6.375% 01-Jun-2028	125.193	0,07
30.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	26.625	0,01
65.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	55.061	0,03
90.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	86.480	0,05
125.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	114.725	0,06
209.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	201.307	0,11
65.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	63.168	0,04
60.000	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	55.295	0,03
134.000	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	114.193	0,06
105.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	85.672	0,05
70.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	59.406	0,03
25.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4.750% 15-Sep-2026	21.674	0,01
50.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.000% 15-May-2027	43.961	0,02
200.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	177.048	0,10
165.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	153.315	0,09
100.000	Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028	90.512	0,05
240.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	208.701	0,12
45.000	Indika Energy Capital IV Pte Ltd 'REGS' 8.250% 22-Oct-2025	44.525	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
55.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc '144A' 3.375% 15-Jan-2026	50.600	0,03
10.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2024	9.715	0,01
55.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	47.269	0,03
45.000	Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031	37.904	0,02
60.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	58.977	0,03
50.000	INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026	35.970	0,02
55.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	49.540	0,03
283.000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	253.707	0,14
50.000	InterCement Financial Operations BV '144A' 5.750% 17-Jul-2024	35.579	0,02
20.000	Interface Inc '144A' 5.500% 01-Dec-2028	16.541	0,01
70.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	65.377	0,04
30.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	28.006	0,02
30.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	29.824	0,02
145.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	139.525	0,08
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	192.614	0,11
90.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	58.325	0,03
82.000	Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025	71.880	0,04
84.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	80.378	0,04
76.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	72.618	0,04
50.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	49.952	0,03
20.000	Iris Holding Inc '144A' 10.000% 15-Dec-2028	16.513	0,01
104.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	85.716	0,05
89.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	81.989	0,05
119.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	103.992	0,06
50.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	44.998	0,03
85.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	78.346	0,04
277.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	241.338	0,13
111.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	96.391	0,05
70.000	Iron Mountain Information Management Services Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2032	58.250	0,03
20.000	iStar Inc 4.250% 01-Aug-2025	19.633	0,01
70.000	iStar Inc 4.750% 01-Oct-2024	69.594	0,04
40.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026	39.439	0,02
138.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	116.474	0,07
35.000	Jacobs Entertainment Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2029	31.638	0,02
35.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	24.838	0,01
50.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	38.072	0,02
150.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	138.237	0,08
40.000	James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028	36.765	0,02
31.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	26.705	0,01
183.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	163.433	0,09
35.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 7.125% 15-Apr-2026	33.830	0,02
105.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	85.806	0,05
35.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2025	29.368	0,02
20.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.875% 15-Dec-2027	15.085	0,01
25.000	JELD-WEN Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	23.557	0,01
200.000	JGSH Philippines Ltd 4.125% 09-Jul-2030	176.150	0,10
10.000	JPW Industries Holding Corp '144A' 9.000% 01-Oct-2024	8.648	0,00
70.000	JSM Global Sarl 'REGS' 4.750% 20-Oct-2030	46.752	0,03
177.000	JSW Hydro Energy Ltd 'REGS' 4.125% 18-May-2031	147.786	0,08
200.000	JSW Steel Ltd 5.950% 18-Apr-2024	199.250	0,11
10.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10.500 % 15-Feb-2026	9.848	0,01
50.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031	40.253	0,02
30.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028	26.225	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
17.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	16.634	0,01
200.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN 3.343% 02-Oct-2031	176.253	0,10
50.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	40.256	0,02
25.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	21.780	0,01
30.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	30.230	0,02
80.000	KB Home 7.250% 15-Jul-2030	77.835	0,04
30.000	KBR Inc '144A' 4.750% 30-Sep-2028	26.684	0,01
100.000	KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025	94.688	0,05
8.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	7.885	0,00
30.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	25.145	0,01
45.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	35.723	0,02
100.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	76.380	0,04
8.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	6.033	0,00
130.000	Kinetik Holdings LP '144A' 5.875% 15-Jun-2030	122.087	0,07
200.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 3.200% 12-Jan-2031	160.260	0,09
160.000	Klabin Austria GmbH 'REGS' 5.750% 03-Apr-2029	157.926	0,09
25.000	KLX Energy Services Holdings Inc '144A' 11.500% 01-Nov-2025	22.539	0,01
45.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	36.837	0,02
50.000	Koppers Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2025	47.579	0,03
15.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	13.841	0,01
170.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7.125% 04-Apr-2026	145.194	0,08
65.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	56.306	0,03
200.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd 4.229% 29-Oct-2026	173.084	0,10
200.000	KWG Group Holdings Ltd 5.875% 10-Nov-2024	87.149	0,05
35.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	30.560	0,02
50.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	47.418	0,03
40.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	31.945	0,02
85.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	78.412	0,04
55.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027	46.312	0,03
50.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	40.442	0,02
10.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	9.413	0,01
100.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	82.803	0,05
50.000	Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028	44.834	0,03
55.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	48.168	0,03
35.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	32.266	0,02
125.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030	110.569	0,06
88.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032	77.013	0,04
60.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	56.956	0,03
25.000	Land O'Lakes Capital Trust I '144A' 7.450% 15-Mar-2028	24.500	0,01
45.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	44.424	0,02
30.000	Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-Jan-2028	29.302	0,02
202.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	186.028	0,10
352.000	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	334.684	0,19
280.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	251.847	0,14
276.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	234.790	0,13
100.000	Latam Airlines Group SA 'REGS' 13.375% 15-Oct-2029	101.947	0,06
105.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	67.109	0,04
105.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	84.219	0,05
69.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	57.262	0,03
163.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	152.783	0,09
52.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	31.538	0,02
45.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025	30.395	0,02
35.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC '144A' 4.250% 01-Jul-2029	29.948	0,02
86.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027	72.876	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
30.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2025	28.280	0,02	
5.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	4.456	0,00	
200.000	Lenovo Group Ltd 'EMTN' 5.875% 24-Apr-2025	194.900	0,11	
175.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	148.464	0,08	
90.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	66.051	0,04	
95.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	68.467	0,04	
75.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	59.320	0,03	
130.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	102.697	0,06	
110.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	91.768	0,05	
30.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	23.850	0,01	
100.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.125% 30-Jun-2025	98.062	0,05	
20.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.500% 30-Jun-2027	19.470	0,01	
50.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	47.316	0,03	
30.000	LFS Topco LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2026	24.246	0,01	
85.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	65.784	0,04	
10.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	4.567	0,00	
20.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	9.850	0,01	
35.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	21.398	0,01	
40.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	44.415	0,02	
100.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051	81.596	0,05	
30.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	27.952	0,02	
40.000	Life Time Inc '144A' 8.000% 15-Apr-2026	36.050	0,02	
50.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	28.322	0,02	
7.016	Ligado Networks LLC '144A' 17.500% 01-May-2024	726	0,00	
25.000	Likewise Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	23.039	0,01	
135.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	78.448	0,04	
100.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	83.000	0,05	
55.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2031	44.846	0,03	
40.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2027	36.146	0,02	
5.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	4.273	0,00	
74.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	66.106	0,04	
40.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	38.792	0,02	
15.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	14.209	0,01	
100.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	98.129	0,05	
45.000	Louisiana-Pacific Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	39.062	0,02	
80.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029	69.716	0,04	
90.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.375% 15-May-2031	76.643	0,04	
10.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2027	9.358	0,01	
35.000	LSB Industries Inc '144A' 6.250% 15-Oct-2028	32.068	0,02	
50.000	LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029	41.371	0,02	
45.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	39.884	0,02	
35.000	Lumen Technologies Inc 5.625% 01-Apr-2025	33.645	0,02	
35.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	29.124	0,02	
30.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	20.532	0,01	
80.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	53.335	0,03	
85.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	72.223	0,04	
80.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	55.325	0,03	
95.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	82.736	0,05	
80.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.375% 15-Jun-2029	57.702	0,03	
35.000	M/I Homes Inc 3.950% 15-Feb-2030	28.305	0,02	
51.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	45.392	0,03	
60.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	36.270	0,02	
40.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	27.911	0,02	
61.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	54.099	0,03	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
50.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Mar-2030	43.460	0,02	
100.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.125% 15-Mar-2032	84.200	0,05	
100.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	82.127	0,05	
100.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	68.728	0,04	
10.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	9.690	0,01	
50.000	MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6.375% 01-Jun-2029	37.375	0,02	
25.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 10.000% 15-Apr-2025	16.750	0,01	
110.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 11.500% 15-Dec-2028	94.059	0,05	
30.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	28.242	0,02	
200.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	154.809	0,09	
35.000	Marriott Ownership Resorts Inc 4.750% 15-Jan-2028	30.532	0,02	
45.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 4.500% 15-Jun-2029	37.392	0,02	
20.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2025	20.613	0,01	
30.000	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 28-Feb-2025	30.052	0,02	
35.000	Masonite International Corp '144A' 3.500% 15-Feb-2030	28.358	0,02	
50.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	46.317	0,03	
90.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	86.621	0,05	
130.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	99.861	0,06	
40.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028	35.729	0,02	
40.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	36.869	0,02	
15.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	13.977	0,01	
85.000	Mativ Holdings Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	75.214	0,04	
45.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	36.552	0,02	
25.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	22.215	0,01	
50.000	Mattel Inc 5.450% 01-Nov-2041	40.781	0,02	
50.000	Mattel Inc '144A' 3.375% 01-Apr-2026	46.035	0,03	
50.000	Mattel Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2029	43.988	0,02	
69.000	Mattel Inc '144A' 5.875% 15-Dec-2027	67.741	0,04	
103.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	100.352	0,06	
124.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	114.912	0,06	
45.000	Maxar Technologies Inc '144A' 7.750% 15-Jun-2027	46.771	0,03	
41.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A' 10.125% 01-Aug-2024	39.893	0,02	
200.000	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS' 7.250% 30-Jun-2031	165.358	0,09	
105.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028	88.393	0,05	
50.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	41.413	0,02	
100.000	Medco Bell Pte Ltd 'REGS' 6.375% 30-Jan-2027	90.559	0,05	
100.000	Medco Oak Tree Pte Ltd 'REGS' 7.375% 14-May-2026	95.375	0,05	
370.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	298.466	0,17	
270.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	214.935	0,12	
50.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	47.215	0,03	
100.000	MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027	102.118	0,06	
100.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.750% 21-Jul-2028	83.772	0,05	
200.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	184.011	0,10	
63.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	55.540	0,03	
60.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.625% 17-Jul-2027	51.167	0,03	
50.000	MercadoLibre Inc 3.125% 14-Jan-2031	38.720	0,02	
70.000	Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029	58.624	0,03	
85.000	Meritage Homes Corp 5.125% 06-Jun-2027	80.064	0,04	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
90.000	Meritage Homes Corp 6.000% 01-Jun-2025	89.722	0,05
50.000	Meritage Homes Corp '144A' 3.875% 15-Apr-2029	42.197	0,02
80.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	75.025	0,04
10.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	9.592	0,01
80.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	74.338	0,04
70.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	62.228	0,03
30.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	22.875	0,01
100.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	84.078	0,05
200.000	Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management Sarl 'REGS' 4.875% 15-Jan-2028	178.284	0,10
49.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	45.264	0,03
80.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	70.875	0,04
55.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.250% 18-Jun-2025	51.811	0,03
125.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15-May-2024	120.839	0,07
80.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	74.833	0,04
80.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	73.419	0,04
50.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	43.710	0,02
35.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	32.597	0,02
40.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	38.931	0,02
55.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	55.370	0,03
200.000	MHP SE 'REGS' 7.750% 10-May-2024	101.904	0,06
40.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	32.229	0,02
140.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	93.793	0,05
140.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	120.124	0,07
10.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5.375% 15-Aug-2027	9.070	0,01
75.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	63.912	0,04
55.000	Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026	35.272	0,02
72.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	68.967	0,04
75.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.000% 01-Nov-2027	76.793	0,04
75.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	75.649	0,04
70.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.500% 01-May-2030	71.050	0,04
35.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	31.233	0,02
100.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	82.103	0,05
30.000	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2030	23.924	0,01
45.000	ModivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	38.007	0,02
40.000	ModivCare Inc '144A' 5.875% 15-Nov-2025	37.625	0,02
50.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 7.875% 15-Oct-2024	50.014	0,03
105.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 8.000% 01-Feb-2026	97.731	0,05
110.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	93.382	0,05
60.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032	49.913	0,03
70.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	64.005	0,04
45.000	Mong Duong Finance Holdings BV 'REGS' 5.125% 07-May-2029	37.522	0,02
42.000	Moog Inc '144A' 4.250% 15-Dec-2027	38.922	0,02
30.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	27.054	0,02
65.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	61.545	0,03
20.000	Motion Bondco DAC '144A' 6.625% 15-Nov-2027	17.150	0,01
100.000	Movida Europe SA 'REGS' 5.250% 08-Feb-2031	75.108	0,04
150.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	117.321	0,07
100.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	66.721	0,04
132.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	100.899	0,06
120.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027	101.131	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.250% 01-Aug-2026	36.496	0,02
55.000	MSCI Inc '144A' 3.250% 15-Aug-2033	42.554	0,02
110.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Sep-2030	91.633	0,05
110.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Nov-2031	91.127	0,05
100.000	MSCI Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2031	83.320	0,05
116.000	MSCI Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2029	101.246	0,06
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS' 6.500% 13-Oct-2026	200.326	0,11
30.000	Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	26.401	0,01
22.000	Murphy Oil Corp 5.750% 15-Aug-2025	21.656	0,01
50.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027	47.961	0,03
40.000	Murphy Oil Corp 6.125% 01-Dec-2042	31.503	0,02
41.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	39.523	0,02
30.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	29.786	0,02
40.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	36.672	0,02
36.000	Murphy Oil USA Inc 5.625% 01-May-2027	35.018	0,02
95.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	78.551	0,04
171.300	MV24 Capital BV 'REGS' 6.748% 01-Jun-2034	156.748	0,09
45.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	42.984	0,02
40.000	Nabors Industries Inc '144A' 7.375% 15-May-2027	38.794	0,02
50.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026	47.199	0,03
30.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.500% 15-Jan-2028	27.494	0,02
17.000	Nathan's Famous Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	16.651	0,01
5.000	National CineMedia LLC '144A' 5.875% 15-Apr-2028	1.158	0,00
40.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030	30.947	0,02
105.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	85.789	0,05
75.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031	58.410	0,03
50.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	44.829	0,03
200.000	Natura Cosmeticos SA 'REGS' 4.125% 03-May-2028	163.443	0,09
50.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	43.858	0,02
110.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	89.922	0,05
12.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	11.632	0,01
40.000	Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025	38.466	0,02
85.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	81.067	0,05
45.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	32.138	0,02
65.000	Navient Corp 'MTN' 6.125% 25-Mar-2024	63.781	0,04
50.000	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc 'REGS' 10.750% 01-Jul-2025	47.088	0,03
70.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	59.916	0,03
150.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	118.392	0,07
70.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Feb-2027	60.722	0,03
45.000	NCL Corp Ltd '144A' 7.750% 15-Feb-2029	33.923	0,02
40.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	29.579	0,02
26.000	NCR Corp '144A' 5.000% 01-Oct-2028	22.208	0,01
80.000	NCR Corp '144A' 5.125% 15-Apr-2029	67.067	0,04
50.000	NCR Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2030	41.332	0,02
35.000	NCR Corp '144A' 5.750% 01-Sep-2027	33.547	0,02
7.000	NCR Corp '144A' 6.125% 01-Sep-2029	6.557	0,00
75.000	Necessity Retail REIT Inc/The / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	55.235	0,03
80.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 3.625% 28-Jun-2031	62.694	0,04
250.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	236.114	0,13
180.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025	175.096	0,10
60.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	52.578	0,03
90.000	Netflix Inc 4.375% 15-Nov-2026	87.300	0,05
160.000	Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028	154.854	0,09
65.000	Netflix Inc 5.750% 01-Mar-2024	65.562	0,04
190.000	Netflix Inc 5.875% 15-Nov-2028	193.046	0,11
67.000	Netflix Inc 6.375% 15-May-2029	69.075	0,04
95.000	Netflix Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2025	90.453	0,05
84.000	Netflix Inc '144A' 4.875% 15-Jun-2030	78.479	0,04
90.000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029	87.460	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
80.000	Network I2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.975% 03-Mar-2026	70.000	0,04	
50.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	44.464	0,02	
20.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	18.544	0,01	
215.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	200.079	0,11	
164.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	155.492	0,09	
161.000	Newell Brands Inc 4.450% 01-Apr-2026	151.822	0,08	
40.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	38.965	0,02	
30.000	Newell Brands Inc 5.625% 01-Apr-2036	25.812	0,01	
42.000	Newell Brands Inc 5.750% 01-Apr-2046	33.552	0,02	
121.000	Newell Brands Inc 6.375% 15-Sep-2027	120.445	0,07	
45.000	Newell Brands Inc 6.625% 15-Sep-2029	44.498	0,02	
85.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	73.851	0,04	
55.000	News Corp '144A' 5.125% 15-Feb-2032	50.129	0,03	
160.000	Nexa Resources SA 'REGS' 5.375% 04-May-2027	150.061	0,08	
115.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	99.649	0,06	
151.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	138.828	0,08	
76.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	69.693	0,04	
60.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.250% 15-Jul-2024	58.298	0,03	
51.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.500% 15-Sep-2027	46.766	0,03	
75.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	63.945	0,04	
150.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	123.972	0,07	
30.000	NFP Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2030	28.397	0,02	
170.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	151.437	0,08	
40.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025	32.663	0,02	
70.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026	53.657	0,03	
110.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	103.300	0,06	
35.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	35.410	0,02	
20.000	Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027	18.929	0,01	
50.000	Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039	47.547	0,03	
120.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	100.122	0,06	
35.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	26.375	0,01	
125.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	76.162	0,04	
60.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	55.425	0,03	
135.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	129.843	0,07	
45.000	Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	42.696	0,02	
50.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027	44.056	0,02	
25.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	19.388	0,01	
25.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	23.386	0,01	
55.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	49.377	0,03	
29.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	23.715	0,01	
125.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	111.102	0,06	
116.000	NRG Energy Inc 5.750% 15-Jan-2028	109.075	0,06	
23.000	NRG Energy Inc 6.625% 15-Jan-2027	22.843	0,01	
25.000	NRG Energy Inc '144A' 3.375 % 15-Feb-2029	20.118	0,01	
85.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625 % 15-Feb-2031	64.815	0,04	
100.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875 % 15-Feb-2032	75.297	0,04	
112.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	98.684	0,06	
50.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	46.834	0,03	
55.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	53.040	0,03	
42.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	40.514	0,02	
40.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	37.058	0,02	
90.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	86.489	0,05	
50.000	Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026	47.249	0,03	
25.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	19.340	0,01	
50.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	40.117	0,02	
46.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	36.009	0,02	
20.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	16.022	0,01	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
40.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	32.381	0,02	
95.000	Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025	94.810	0,05	
125.000	Occidental Petroleum Corp 5.875 % 01-Sep-2025	124.735	0,07	
120.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	121.334	0,07	
50.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	48.661	0,03	
60.000	Occidental Petroleum Corp 6.375 % 01-Sep-2028	60.684	0,03	
150.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	153.338	0,09	
95.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	97.968	0,05	
170.000	Occidental Petroleum Corp 6.625 % 01-Sep-2030	176.058	0,10	
26.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	26.500	0,01	
205.000	Occidental Petroleum Corp 7.150 % 15-May-2028	212.878	0,12	
74.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	79.459	0,04	
57.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	62.858	0,04	
15.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	16.293	0,01	
100.000	Occidental Petroleum Corp 8.875 % 15-Jul-2030	113.068	0,06	
35.000	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	33.481	0,02	
50.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	45.922	0,03	
100.000	Odeon Finco Plc '144A' 12.750% 01-Nov-2027	87.128	0,05	
58.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	42.589	0,02	
70.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	54.384	0,03	
174.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	116.925	0,07	
48.000	Office Properties Income Trust 4.250% 15-May-2024	45.501	0,03	
160.000	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	145.195	0,08	
61.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030	56.329	0,03	
80.000	Oi European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	70.172	0,04	
65.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	59.428	0,03	
40.000	Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027	37.869	0,02	
119.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	113.261	0,06	
50.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	40.657	0,02	
50.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250 % 01-Oct-2029	38.010	0,02	
65.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3.875% 01-Sep-2028	56.822	0,03	
50.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	41.461	0,02	
50.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	39.826	0,02	
130.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	97.168	0,05	
115.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	94.249	0,05	
110.000	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	106.674	0,06	
60.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	55.355	0,03	
97.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	93.402	0,05	
135.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	128.670	0,07	
105.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 15-Feb-2028	90.284	0,05	
100.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 01-Dec-2029	80.571	0,05	
115.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 15-Feb-2030	92.739	0,05	
103.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2031	80.210	0,04	
70.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	61.319	0,03	
300.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	266.145	0,15	
165.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	143.077	0,08	
35.000	Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026	21.875	0,01	
50.000	Oscar AcquisitionCo LLC / Oscar Finance Inc '144A' 9.500% 15-Apr-2030	44.935	0,03	
40.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030	33.157	0,02	
12.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	10.822	0,01	
50.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.250% 15-Jun-2025	49.612	0,03	
85.000	Owens & Minor Inc '144A' 4.500% 31-Mar-2029	67.881	0,04	
15.000	Owens & Minor Inc '144A' 6.625% 01-Apr-2030	12.910	0,01	
10.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.375% 15-Aug-2025	9.678	0,01	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
70.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.625% 13-May-2027	68.041	0,04	
20.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	16.250	0,01	
100.000	Pacific Western Bank FRN 3.250% 01-May-2031	92.272	0,05	
80.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	71.032	0,04	
80.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	71.574	0,04	
150.000	Pampa Energia SA 'REGS' 7.500% 24-Jan-2027	137.625	0,08	
91.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	76.101	0,04	
30.000	Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7.750% 15-Dec-2025	28.941	0,02	
110.000	Paramount Global FRN 6.250% 28-Feb-2057	88.851	0,05	
114.000	Paramount Global FRN 6.375% 30-Mar-2062	93.348	0,05	
60.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	50.868	0,03	
60.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	54.133	0,03	
55.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	55.054	0,03	
80.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	53.376	0,03	
60.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.500% 01-Oct-2029	50.150	0,03	
65.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.625% 01-May-2030	53.881	0,03	
50.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 5.875% 15-Jul-2027	47.561	0,03	
25.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	17.023	0,01	
90.000	Party City Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	26.100	0,01	
100.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	83.130	0,05	
65.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	58.440	0,03	
50.000	Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028	44.265	0,02	
35.000	Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029	31.511	0,02	
105.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	93.841	0,05	
55.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 7.250% 15-Jun-2025	54.443	0,03	
85.000	PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026	81.277	0,05	
73.000	PDC Energy Inc 6.125% 15-Sep-2024	72.094	0,04	
50.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029	32.550	0,02	
40.000	Pediatrix Medical Group Inc '144A' 5.375% 15-Feb-2030	34.817	0,02	
20.000	Penn Entertainment Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2029	15.826	0,01	
60.000	Penn Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2027	54.499	0,03	
58.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	45.320	0,03	
45.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	40.634	0,02	
100.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	79.448	0,04	
40.000	Penske Automotive Group Inc 3.500% 01-Sep-2025	37.185	0,02	
45.000	Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029	36.582	0,02	
140.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	131.425	0,07	
80.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	69.424	0,04	
89.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	84.131	0,05	
35.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	35.133	0,02	
200.000	Periana Holdings LLC/DE 5.950% 19-Apr-2026	187.382	0,10	
30.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	28.347	0,02	
50.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	47.318	0,03	
76.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	70.600	0,04	
65.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	44.057	0,02	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
200.000	Peru LNG Srl 'REGS' 5.375% 22-Mar-2030	167.348	0,09	
200.000	Petron Corp FRN (Perpetual) 5.950% 19-Apr-2026	171.800	0,10	
100.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	90.665	0,05	
110.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	103.517	0,06	
75.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	68.559	0,04	
140.000	PG&E Corp 5.250% 01-Jul-2030	127.615	0,07	
71.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	59.535	0,03	
70.000	PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026	62.271	0,03	
65.000	Photo Holdings Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-Oct-2026	37.590	0,02	
65.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	56.932	0,03	
30.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6.875% 15-Mar-2027	25.689	0,01	
30.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7.250% 15-Mar-2029	23.504	0,01	
35.000	Plantronics Inc '144A' 4.750% 01-Mar-2029	32.469	0,02	
63.000	Playtika Holding Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	49.534	0,03	
30.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	22.927	0,01	
60.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	21.863	0,01	
185.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	155.864	0,09	
165.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	142.209	0,08	
165.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	149.655	0,08	
141.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	132.936	0,07	
87.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	84.263	0,05	
75.000	PRA Group Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	72.592	0,04	
55.000	PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026	49.845	0,03	
30.000	Precision Drilling Corp '144A' 6.875% 15-Jan-2029	27.969	0,02	
50.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	48.454	0,03	
100.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	73.870	0,04	
60.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031	42.522	0,02	
30.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4.875% 01-Feb-2027	27.404	0,02	
51.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8.250% 01-Feb-2028	47.362	0,03	
50.000	Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031	41.268	0,02	
50.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	47.014	0,03	
110.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	93.124	0,05	
105.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	90.892	0,05	
60.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2024	59.042	0,03	
90.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	86.565	0,05	
104.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	94.871	0,05	
123.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	106.367	0,06	
100.000	PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	80.598	0,05	
30.000	Promontoria Holding 264 BV '144A' 7.875% 01-Mar-2027	27.826	0,02	
30.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025	26.251	0,01	
43.000	PTC Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2025	40.957	0,02	
50.000	PTC Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2028	45.088	0,03	
200.000	Puma International Financing SA '144A' 5.125% 06-Oct-2024	187.926	0,11	
105.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	62.926	0,04	
65.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	53.170	0,03	
90.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	63.761	0,04	
60.000	QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024	55.605	0,03	
20.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	10.486	0,01	
15.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	7.438	0,00	
80.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5.375% 01-Dec-2028	34.607	0,02	
55.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	40.495	0,02	
135.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	56.244	0,03	
85.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	47.849	0,03	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
51.000	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A' 7.250% 01-Apr-2025	47.077	0,03
50.000	Rakuten Group Inc '144A' 10.250% 30-Nov-2024	50.625	0,03
40.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125 % 22-Apr-2026	31.000	0,02
53.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	36.002	0,02
70.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	66.607	0,04
65.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	67.066	0,04
30.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	26.695	0,01
120.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 5.500% 01-Jun-2024	119.700	0,07
56.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 7.625% 15-Jan-2026	53.483	0,03
45.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	30.906	0,02
120.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.250% 15-Apr-2030	87.697	0,05
134.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	101.530	0,06
180.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030	156.330	0,09
144.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A' 9.750% 01-Dec-2026	116.188	0,06
100.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 'REGS' 4.500% 14-Jul-2028	84.184	0,05
75.000	Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029	60.769	0,03
25.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	20.251	0,01
200.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	135.838	0,08
100.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	71.237	0,04
50.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	45.328	0,03
50.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029	43.193	0,02
50.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2025	49.211	0,03
8.000	Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027	3.260	0,00
50.000	Rite Aid Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2026	26.819	0,02
30.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	26.966	0,02
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd 5.200% 12-Jan-2026	144.526	0,08
45.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026	40.091	0,02
45.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	36.545	0,02
125.000	ROBLOX Corp '144A' 3.875% 01-May-2030	98.688	0,06
15.000	ROCC Holdings LLC '144A' 9.250% 15-Aug-2026	14.950	0,01
60.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	54.973	0,03
150.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	129.447	0,07
75.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	59.557	0,03
130.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	99.534	0,06
75.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033	56.123	0,03
75.000	Rocket Software Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2029	59.401	0,03
40.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	37.835	0,02
79.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	69.658	0,04
54.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	48.621	0,03
40.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	33.704	0,02
25.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	23.301	0,01
35.000	Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029	30.308	0,02
150.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	138.750	0,08
105.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750 % 15-Oct-2027	100.184	0,06
50.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	36.829	0,02
60.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	51.154	0,03
45.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	36.432	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
65.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.375% 15-Jul-2027	52.712	0,03
100.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	84.127	0,05
105.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	83.981	0,05
70.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 8.250% 15-Jan-2029	70.437	0,04
50.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	51.440	0,03
79.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	84.901	0,05
90.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.625% 15-Aug-2027	90.381	0,05
60.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	45.894	0,03
105.000	RR Donnelley & Sons Co '144A' 6.125% 01-Nov-2026	98.175	0,05
100.000	RRD Parent Inc '144A' 10.000% 15-Oct-2031	165.750	0,09
40.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 5.250% 10-Jan-2028	37.950	0,02
30.000	Ryan Specialty Group LLC '144A' 4.375% 01-Feb-2030	26.014	0,01
75.000	Sabre GLBL Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	71.793	0,04
155.000	Sabre GLBL Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2025	154.671	0,09
50.000	Sabre GLBL Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2027	51.500	0,03
50.000	Sagicor Financial Co Ltd '144A' 5.300% 13-May-2028	46.914	0,03
50.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025	48.243	0,03
68.000	Sands China Ltd 2.800% 08-Mar-2027	58.330	0,03
150.000	Sands China Ltd 3.350% 08-Mar-2029	122.747	0,07
100.000	Sands China Ltd 3.750% 08-Aug-2031	78.826	0,04
295.000	Sands China Ltd 4.300% 08-Jan-2026	272.625	0,15
48.000	Sands China Ltd 4.875% 18-Jun-2030	42.247	0,02
520.000	Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	498.789	0,28
561.000	Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	527.257	0,29
50.000	Sasol Financing USA LLC 4.375% 18-Sep-2026	44.325	0,02
50.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	40.776	0,02
200.000	Sasol Financing USA LLC 5.875% 27-Mar-2024	196.149	0,11
165.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	137.485	0,08
145.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	131.238	0,07
40.000	Science Applications International Corp '144A' 4.875% 01-Apr-2028	37.063	0,02
55.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	46.530	0,03
60.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	57.342	0,03
10.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	9.618	0,01
40.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.625% 01-Jul-2025	40.877	0,02
95.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	81.477	0,05
75.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	60.508	0,03
100.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026	84.875	0,05
30.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.375% 01-Feb-2032	22.655	0,01
35.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	28.413	0,02
31.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	24.923	0,01
15.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375 % 15-Jan-2031	12.042	0,01
75.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	67.056	0,04
111.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	91.982	0,05
100.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	97.422	0,05
95.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	93.282	0,05
50.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	46.688	0,03
110.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	93.462	0,05
50.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	45.450	0,03
95.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	89.437	0,05
10.000	Sealed Air Corp '144A' 5.125% 01-Dec-2024	9.842	0,01
50.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	49.375	0,03
40.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	39.715	0,02
40.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	34.849	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
15.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	15.457	0,01	
30.000	SEG Holding LLC / SEG Finance Corp '144A' 5.625% 15-Oct-2028	28.291	0,02	
141.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	134.357	0,08	
100.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029	86.385	0,05	
50.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	48.917	0,03	
81.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.625% 01-Nov-2024	80.845	0,05	
40.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.875% 01-Sep-2030	37.967	0,02	
60.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	49.450	0,03	
40.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	34.891	0,02	
70.000	Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030	57.735	0,03	
45.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	37.986	0,02	
50.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	46.688	0,03	
60.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	56.359	0,03	
65.000	Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027	66.775	0,04	
85.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	80.484	0,03	
70.000	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	63.746	0,04	
50.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	43.206	0,02	
60.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	57.402	0,03	
40.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	31.541	0,02	
11.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	8.681	0,00	
42.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	29.095	0,02	
29.000	Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027	25.010	0,01	
70.000	Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025	66.792	0,04	
15.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 15-Feb-2028	13.120	0,01	
50.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 01-Apr-2029	42.122	0,02	
100.000	Shelf Drilling Holdings Ltd 'REGS' 8.250% 15-Feb-2025	86.943	0,05	
45.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	42.589	0,02	
70.000	Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	21.437	0,01	
55.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	50.978	0,03	
100.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	81.526	0,05	
200.000	Simpar Europe SA 'REGS' 5.200% 26-Jan-2031	151.766	0,08	
15.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030	11.265	0,01	
10.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2027	8.172	0,00	
50.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030	35.043	0,02	
90.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	80.027	0,04	
155.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	121.225	0,07	
225.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	196.250	0,11	
160.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	132.394	0,07	
270.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	250.197	0,14	
258.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	236.079	0,13	
74.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31-Jul-2024	71.364	0,04	
30.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	30.277	0,02	
40.000	SK Invictus Intermediate II Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029	32.852	0,02	
50.000	SLM Corp 3.125% 02-Nov-2026	42.585	0,02	
40.000	SLM Corp 4.200 % 29-Oct-2025	36.667	0,02	
30.000	SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025	28.846	0,02	
25.000	SM Energy Co 6.500% 15-Jul-2028	24.001	0,01	
30.000	SM Energy Co 6.625% 15-Jan-2027	28.944	0,02	
30.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	29.173	0,02	
200.000	SMC Global Power Holdings Corp FRN (Perpetual) 7.000% 21-Oct-2025	153.000	0,09	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
130.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	116.583	0,07	
67.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	66.722	0,04	
55.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	44.110	0,02	
40.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.875% 15-Nov-2031	31.501	0,02	
55.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	51.657	0,03	
15.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	13.761	0,01	
100.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	85.652	0,05	
35.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	32.498	0,02	
60.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	54.837	0,03	
50.000	Southwestern Energy Co 5.700 % 23-Jan-2025	49.206	0,03	
20.000	Southwestern Energy Co 7.750% 01-Oct-2027	20.414	0,01	
40.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	34.450	0,02	
35.000	SPCM SA '144A' 3.375 % 15-Mar-2030	28.220	0,02	
70.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	56.284	0,03	
40.000	Spectrum Brands Inc 5.750% 15-Jul-2025	39.607	0,02	
70.000	Spectrum Brands Inc '144A' 3.875% 15-Mar-2031	54.532	0,03	
15.000	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2027	13.334	0,01	
84.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	67.932	0,04	
276.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	273.326	0,15	
66.667	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	67.097	0,04	
43.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	43.214	0,02	
340.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	354.362	0,20	
237.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	282.588	0,16	
289.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	295.423	0,17	
175.000	Sprint LLC 7.625% 01-Mar-2026	184.517	0,10	
50.000	SPX FLOW Inc '144A' 8.750% 01-Apr-2030	39.498	0,02	
40.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	35.510	0,02	
75.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	59.786	0,03	
75.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	60.737	0,03	
188.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	176.826	0,10	
80.000	Stagwell Global LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	66.116	0,04	
116.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	87.681	0,05	
170.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	138.892	0,08	
150.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	134.906	0,08	
85.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	78.559	0,04	
220.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	189.803	0,11	
100.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	72.168	0,04	
47.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	44.931	0,03	
35.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.625% 15-Jul-2026	30.669	0,02	
35.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.750% 31-Dec-2024	32.906	0,02	
45.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2027	39.442	0,02	
110.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	95.802	0,05	
5.000	Station Casinos LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2031	4.017	0,00	
110.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	95.975	0,05	
60.000	Stena AB '144A' 7.000% 01-Feb-2024	58.070	0,03	
30.000	Stena International SA '144A' 5.750% 01-Mar-2024	28.870	0,02	
35.000	Stena International SA '144A' 6.125% 01-Feb-2025	32.688	0,02	
100.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	87.381	0,05	
99.000	Stericycle Inc '144A' 5.375% 15-Jul-2024	97.176	0,05	
35.000	Stevens Holding Co Inc '144A' 6.125% 01-Oct-2026	35.148	0,02	
100.000	Stillwater Mining Co 'REGS' 4.000% 16-Nov-2026	88.435	0,05	
40.000	StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	32.052	0,02	
30.000	Strathcona Resources Ltd/Alberta '144A' 6.875% 01-Aug-2026	21.931	0,01	
100.000	Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029	74.186	0,04	
50.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025	43.430	0,02	
50.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.500 % 15-Jan-2028	38.905	0,02	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
50.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	47.835	0,03	
81.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	68.952	0,04	
60.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	55.968	0,03	
25.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	24.542	0,01	
55.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025	46.790	0,03	
100.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2026	95.048	0,05	
55.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	47.283	0,03	
35.000	Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026	31.312	0,02	
85.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	74.472	0,04	
95.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 30-Apr-2030	82.593	0,05	
75.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	71.157	0,04	
50.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	42.822	0,02	
36.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	35.586	0,02	
54.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	55.030	0,03	
90.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	52.267	0,03	
25.000	Sylvamo Corp '144A' 7.000% 01-Sep-2029	23.830	0,01	
35.000	Synaptics Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	29.540	0,02	
40.000	Syneos Health Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	32.234	0,02	
30.000	Synovus Financial Corp FRN 5.900% 07-Feb-2039	29.396	0,02	
70.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028	62.189	0,03	
20.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	18.704	0,01	
100.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030	86.603	0,05	
35.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	30.319	0,02	
95.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	96.005	0,05	
70.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	73.766	0,04	
15.000	Tap Rock Resources LLC '144A' 7.000% 01-Oct-2026	13.970	0,01	
12.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.625% 01-Mar-2024	11.966	0,01	
95.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	82.691	0,05	
50.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	46.904	0,03	
45.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	43.283	0,02	
55.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	31.780	0,02	
55.000	TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026	53.627	0,03	
94.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	89.297	0,05	
95.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	90.350	0,05	
30.000	Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029	27.121	0,02	
70.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	53.013	0,03	
100.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	81.963	0,05	
85.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	69.153	0,04	
120.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	99.799	0,06	
200.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	189.900	0,11	
50.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	47.740	0,03	
50.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	45.732	0,03	
200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	182.000	0,10	
30.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	13.521	0,01	
75.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	34.595	0,02	
15.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	4.362	0,00	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
140.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2031	109.698	0,06	
105.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	88.369	0,05	
60.000	Tenet Healthcare Corp 4.625% 15-Jul-2024	58.603	0,03	
100.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.250% 01-Jun-2029	86.815	0,05	
100.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15-Jan-2030	86.732	0,05	
40.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 01-Sep-2024	38.909	0,02	
25.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	22.409	0,01	
210.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 01-Jan-2026	199.802	0,11	
85.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 01-Nov-2027	79.243	0,04	
223.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028	200.127	0,11	
135.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2030	128.865	0,07	
30.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027	28.708	0,02	
200.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 4.000% 15-Aug-2026	171.510	0,10	
85.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	76.502	0,04	
38.250	Termocandelaria Power Ltd 'REGS' 7.875% 30-Jan-2029	35.068	0,02	
65.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	56.665	0,03	
50.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	44.826	0,03	
25.000	Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	27.008	0,02	
125.000	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC 6.150% 01-Feb-2036	110.225	0,06	
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.150% 01-Oct-2026	262.959	0,15	
140.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.100% 01-Oct-2046	85.904	0,05	
80.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.750% 09-May-2027	72.412	0,04	
280.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 5.125% 09-May-2029	249.717	0,14	
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6.000% 15-Apr-2024	196.428	0,11	
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 6.750% 01-Mar-2028	97.730	0,05	
80.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.125% 31-Jan-2025	79.682	0,04	
80.000	Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029	62.927	0,04	
60.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	54.130	0,03	
30.000	Titan International Inc 7.000% 30-Apr-2028	28.362	0,02	
60.000	TK Elevator Holdco GmbH '144A' 7.625% 15-Jul-2028	49.088	0,03	
120.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	106.409	0,06	
100.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	56.169	0,03	
70.000	TMS International Corp/DE '144A' 6.250% 15-Apr-2029	50.239	0,03	
170.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	120.267	0,07	
22.207	Topaz Solar Farms LLC '144A' 4.875 % 30-Sep-2039	19.763	0,01	
17.985	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	17.095	0,01	
65.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	53.378	0,03	
55.000	TopBuild Corp '144A' 4.125% 15-Feb-2032	44.773	0,03	
50.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV 'REGS' 6.375% 20-Sep-2028	39.165	0,02	
30.000	TPro Acquisition Corp '144A' 11.000% 15-Oct-2024	29.829	0,02	
25.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	23.077	0,01	
135.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	118.938	0,07	
115.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	100.455	0,06	
296.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	278.379	0,16	
90.000	TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026	87.566	0,05	
73.000	TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027	72.340	0,04	
300.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	296.517	0,17	
100.000	TransDigm UK Holdings Plc 6.875% 15-May-2026	97.806	0,05	
59.707	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15-Jan-2024	58.399	0,03	
55.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	34.767	0,02	
35.000	Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	31.003	0,02	
100.000	Transocean Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	84.342	0,05	
100.000	Transocean Inc '144A' 8.000% 01-Feb-2027	81.658	0,05	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
60.000	Transocean Inc '144A' 11.500% 30-Jan-2027	60.239	0,03
62.000	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.750% 15-Oct-2024	61.677	0,03
33.600	Transocean Pontus Ltd '144A' 6.125% 01-Aug-2025	32.995	0,02
48.125	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	46.907	0,03
46.000	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.250% 01-Dec-2024	45.385	0,03
40.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	39.467	0,02
20.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	19.016	0,01
50.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.500% 01-Dec-2029	40.815	0,02
30.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030	24.932	0,01
98.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	96.038	0,05
54.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	45.986	0,03
90.000	TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 5.875% 15-Jun-2024	89.299	0,05
20.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	17.887	0,01
35.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	31.762	0,02
35.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 9.250% 01-Aug-2024	33.516	0,02
35.000	TriMas Corp '144A' 4.125% 15-Apr-2029	30.611	0,02
45.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	37.058	0,02
50.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	48.603	0,03
30.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	19.471	0,01
60.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	49.445	0,03
50.000	TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025	49.480	0,03
85.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	68.292	0,04
45.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	37.882	0,02
95.000	Triumph Group Inc '144A' 6.250% 15-Sep-2024	89.924	0,05
30.000	Triumph Group Inc '144A' 8.875% 01-Jun-2024	30.571	0,02
100.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.000% 15-Aug-2026	91.864	0,05
60.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	55.146	0,03
127.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	105.807	0,06
15.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	12.885	0,01
100.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025	60.510	0,03
200.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026	160.764	0,09
200.000	Turk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	189.218	0,11
200.000	Türkiye İsbankası AS 'REGS' 6.125% 25-Apr-2024	198.788	0,11
35.000	Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026	30.238	0,02
65.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	56.977	0,03
30.000	Twilio Inc 3.625% 15-Mar-2029	24.411	0,01
25.000	Twilio Inc 3.875% 15-Mar-2031	19.870	0,01
70.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	61.119	0,03
100.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	100.098	0,06
60.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027	60.103	0,03
115.000	Uber Technologies Inc '144A' 8.000% 01-Nov-2026	115.629	0,06
200.000	Ulker Bisküvi Sanayi AS 'REGS' 6.950% 30-Oct-2025	169.235	0,09
80.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	71.294	0,04
65.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459% 30-Jun-2035	53.076	0,03
85.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	75.042	0,04
150.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	138.057	0,08
60.000	Unisys Corp '144A' 6.875% 01-Nov-2027	46.158	0,03
12.292	United Airlines 2016-1 Class B Pass Through Trust 3.650% 07-Jan-2026	11.145	0,01
15.000	United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-Jan-2025	14.351	0,01
10.000	United Airlines Holdings Inc 5.000% 01-Feb-2024	9.842	0,01
85.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	78.933	0,04
150.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	130.868	0,07
10.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	9.624	0,01
110.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	89.884	0,05
241.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	223.436	0,12
90.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	75.649	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
65.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	55.677	0,03
188.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	178.573	0,10
75.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	70.602	0,04
67.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	66.252	0,04
43.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	38.012	0,02
122.000	United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029	118.584	0,07
120.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	108.250	0,06
60.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	47.969	0,03
35.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	30.181	0,02
175.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	110.964	0,06
95.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	63.115	0,04
55.000	Univar Solutions USA Inc/Washington '144A' 5.125% 01-Dec-2027	52.254	0,03
65.000	Universal Entertainment Corp '144A' 8.500% 11-Dec-2024	60.780	0,03
125.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	104.767	0,06
157.000	Univision Communications Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2025	149.844	0,08
125.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	120.867	0,07
75.000	Univision Communications Inc '144A' 7.375% 30-Jun-2030	72.000	0,04
50.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	42.101	0,02
45.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	40.009	0,02
50.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	42.328	0,02
125.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	111.084	0,06
42.936	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	39.195	0,02
28.849	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	26.263	0,01
70.000	US Foods Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	61.732	0,03
85.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	75.573	0,04
70.000	US Foods Inc '144A' 6.250% 15-Apr-2025	69.381	0,04
81.000	US Renal Care Inc '144A' 10.625% 15-Jul-2027	17.213	0,01
66.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	63.419	0,04
62.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	58.070	0,03
80.000	USI Inc/NY '144A' 6.875% 01-May-2025	77.194	0,04
100.000	Usuminas International Sarl 'REGS' 5.875% 18-Jul-2026	97.250	0,05
30.000	Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	30.052	0,02
100.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	82.183	0,05
30.000	Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030	29.157	0,02
100.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	86.853	0,05
95.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	94.458	0,05
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc 'REGS' 8.950% 11-Mar-2025	136.114	0,08
200.000	Vedanta Resources Ltd 'REGS' 6.125% 09-Aug-2024	126.506	0,07
50.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025	17.154	0,01
140.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	122.746	0,07
100.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	81.875	0,05
150.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	128.063	0,07
150.000	Vericast Corp '144A' 11.000% 15-Sep-2026	160.172	0,09
100.000	Vericast Corp '144A' 12.500% 15-Dec-2027	113.875	0,06
150.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7.500% 01-Sep-2025	103.853	0,06
20.000	Vermilion Energy Inc '144A' 6.875% 01-May-2030	18.324	0,01
95.000	Verscond Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Aug-2026	93.277	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
100.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	85.118	0,05
165.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	153.346	0,09
60.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	54.606	0,03
35.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	26.315	0,01
80.000	Viavi Solutions Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2029	67.368	0,04
57.000	Vibrantz Technologies Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2030	43.014	0,02
48.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	37.747	0,02
40.000	Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029	22.052	0,01
50.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	42.211	0,02
70.000	Videotron Ltd '144A' 5.125% 15-Apr-2027	66.237	0,04
70.000	Videotron Ltd '144A' 5.375% 15-Jun-2024	69.239	0,04
80.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	65.340	0,04
70.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025	63.438	0,04
45.000	Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029	37.296	0,02
7.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029	5.644	0,00
40.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	38.049	0,02
70.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	56.197	0,03
80.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030	66.976	0,04
135.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	121.239	0,07
45.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028	39.428	0,02
18.000	Virtusa Corp '144A' 7.125% 15-Dec-2028	13.743	0,01
40.000	Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	29.422	0,02
40.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 7.875% 01-May-2027	36.137	0,02
105.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	90.803	0,05
110.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.000% 31-Jul-2027	102.069	0,06
230.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2026	221.980	0,12
95.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2027	90.438	0,05
25.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	22.052	0,01
115.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	93.354	0,05
115.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	94.052	0,05
45.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	38.776	0,02
55.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	45.994	0,03
50.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	37.180	0,02
85.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	62.032	0,03
285.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	285.266	0,16
140.000	VTR Finance NV 'REGS' 6.375% 15-Jul-2028	54.945	0,03
130.000	VZ Secured Financing BV '144A' 5.000% 15-Jan-2032	105.876	0,06
45.000	Wabash National Corp '144A' 4.500% 15-Oct-2028	38.362	0,02
40.000	Warrior Met Coal Inc '144A' 7.875% 01-Dec-2028	39.484	0,02
35.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	33.028	0,02
40.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	35.414	0,02
55.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	52.337	0,03
75.000	Weatherford International Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2028	73.631	0,04
120.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	115.451	0,06
20.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 4.875% 15-Sep-2028	16.841	0,01
95.000	Weir Group Plc/The '144A' 2.200% 13-May-2026	84.461	0,05
10.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	6.716	0,00
45.000	Wesco Aircraft Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2024	22.275	0,01
50.000	Wesco Aircraft Holdings Inc '144A' 9.000% 15-Nov-2026	33.875	0,02
110.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	111.617	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
123.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	124.872	0,07
200.000	West China Cement Ltd 4.950% 08-Jul-2026	170.000	0,10
25.000	Western Global Airlines LLC '144A' 10.375% 15-Aug-2025	18.817	0,01
65.000	Western Midstream Operating LP 3.350% 01-Feb-2025	61.644	0,03
35.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	33.190	0,02
149.000	Western Midstream Operating LP 4.300% 01-Feb-2030	129.224	0,07
20.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	18.459	0,01
43.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	40.884	0,02
85.000	Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028	78.350	0,04
57.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	46.884	0,03
48.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	39.895	0,02
135.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 01-Feb-2050	110.239	0,06
60.000	WeWork Cos Inc '144A' 7.875% 01-May-2025	22.895	0,01
50.000	WeWork Cos LLC / WW Co-Obligor Inc '144A' 5.000% 10-Jul-2025	16.611	0,01
125.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	108.330	0,06
20.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	17.315	0,01
35.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	33.633	0,02
25.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15-Aug-2028	22.602	0,01
22.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025	21.814	0,01
35.000	Wilton RE Ltd '144A' FRN (Perpetual) 6.000% 22-Oct-2030	30.435	0,02
134.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	109.503	0,06
60.000	Winnbago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	56.180	0,03
55.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.000% 15-Feb-2031	44.038	0,02
35.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	30.145	0,02
40.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.875% 15-Jul-2030	34.525	0,02
45.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029	34.156	0,02
25.000	World Acceptance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	14.031	0,01
85.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	75.427	0,04
5.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 01-Oct-2024	4.932	0,00
75.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	60.733	0,03
50.000	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	25.045	0,01
50.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	44.940	0,03
105.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	94.925	0,05
160.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	152.225	0,09
50.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024	47.286	0,03
50.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	40.536	0,02
130.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	119.460	0,07
30.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027	26.270	0,01
85.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.625% 26-Aug-2028	72.785	0,04
30.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	25.763	0,01
150.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.750% 15-Apr-2025	149.405	0,08
20.000	Xerox Corp 3.800% 15-May-2024	19.302	0,01
61.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	45.548	0,03
178.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2025	163.154	0,09
74.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.500% 15-Aug-2028	59.354	0,03
25.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	20.511	0,01
65.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	62.598	0,04
50.000	XP Inc 'REGS' 3.250% 01-Jul-2026	44.998	0,03
50.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	44.498	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
200.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' 8.250% 15-Oct-2024	204.189	0,11
105.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	88.264	0,05
170.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	150.595	0,08
30.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	24.867	0,01
120.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	111.312	0,06
36.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	36.616	0,02
130.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	119.493	0,07
133.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	98.941	0,06
105.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	59.769	0,03
120.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	113.114	0,06
27.000	Ziff Davis Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2030	22.895	0,01
35.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030	28.320	0,02
45.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	41.940	0,02
93.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	77.974	0,04
80.000	ZipRecruiter Inc '144A' 5.000% 15-Jan-2030	66.058	0,04
63.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3.875% 01-Feb-2029	53.024	0,03
Gesamtanlagen in Anleihen		175.772.867	98,25
Credit Default Swaps - 23.296			
(31. Dezember 2021: 462.608)			
(1.000.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 39 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	5.824	0,00
(3.000.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 39 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	17.472	0,01
Credit Default Swaps insgesamt		23.296	0,01
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 785.200 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.415.514)		785.200	0,44
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		176.581.363	98,70
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (3.087.854) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (363.707))		(3.087.854)	(1,73)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(3.087.854)	(1,73)
Nettoumlaufvermögen		5.409.727	3,03
Summe Nettovermögen		178.903.236	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		96,51	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,44	
Sonstiges Umlaufvermögen		3,05	
Gesamtvermögen		100,00	

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund							
Euro	US-Dollar	350.000	373.808	13. Jan. 23	HSBC Bank plc		1,123
Euro	US-Dollar	2.500.000	2.653.624	13. Jan. 23	Morgan Stanley		24,450
Pfund Sterling	US-Dollar	200.000	241.331	13. Jan. 23	Morgan Stanley		528
US-Dollar	Pfund Sterling	4.544.761	3.694.000	13. Jan. 23	HSBC Bank plc		77,611
						USD	103,712
US-Dollar	Euro	41.629.064	39.371.990	13. Jan. 23	Morgan Stanley		(547,362)
						USD	(547,362)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged)							
Dänische Krone	US-Dollar	289	41	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Dänische Krone	US-Dollar	709	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Dänische Krone	US-Dollar	93.365	13.283	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		168
						USD	168
						DKK	1,167
US-Dollar	Dänische Krone	13.302	93.091	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(109)
US-Dollar	Dänische Krone	73	508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Dänische Krone	109	763	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(111)
						DKK	(771)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	2.244	2.382	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		19
Euro	US-Dollar	376.981	402.601	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1,232
Euro	US-Dollar	49.433.256	52.298.426	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		655,923
						USD	657,174
						EUR	613,923
US-Dollar	Euro	2.384	2.244	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(20)
US-Dollar	Euro	11.299	10.627	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(84)
US-Dollar	Euro	15.475.725	14.562.465	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(124,013)
US-Dollar	Euro	8.088	7.606	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(60)
US-Dollar	Euro	285.745	269.016	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2,433)
US-Dollar	Euro	4.457	4.199	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(41)
US-Dollar	Euro	431.761	406.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3,531)
US-Dollar	Euro	4.646	4.398	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(65)
US-Dollar	Euro	1.693	1.599	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(20)
						USD	(130,267)
						EUR	(121,694)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	32	34	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	79	84	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged) Forts.

Euro	US-Dollar	10.302	10.899	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	137
					USD	137
					EUR	128
US-Dollar	Euro	10.915	10.271	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(87)
US-Dollar	Euro	60	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	90	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(89)
					EUR	(83)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	71	75	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	9.308	9.848	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	124
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	124
					EUR	116
US-Dollar	Euro	82	77	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	6.000	6.369	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	101	108	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	13.282	14.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	176
US-Dollar	Euro	127	119	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	235
					EUR	220
US-Dollar	Euro	77	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	116	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(2)
					EUR	(2)

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

Euro	US-Dollar	9.350	9.892	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	124
Euro	US-Dollar	71	76	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	124
					EUR	116

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	82	77	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	78	84	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.279	10.875	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	136
US-Dollar	Euro	60	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	136
					EUR	127
US-Dollar	Euro	60	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	90	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(2)
					EUR	(2)

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

Norwegische Krone	US-Dollar	701	72	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Norwegische Krone	US-Dollar	95.392	9.583	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	158
US-Dollar	Norwegische Krone	53	522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	158
					NOK	1.548
US-Dollar	Norwegische Krone	75	743	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					NOK	(10)

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

US-Dollar	Schwedische Krone	48	503	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schwedische Krone	74	769	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Schwedische Krone	51	534	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	1
					SEK	10
Schwedische Krone	US-Dollar	705	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Schwedische Krone	US-Dollar	94.226	9.170	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(134)
					USD	(136)
					SEK	(1.419)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	13.750	16.566	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Pfund Sterling	US-Dollar	6.726	8.117	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
Pfund Sterling	US-Dollar	191.768	231.482	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	423

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	176.445	213.363	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12
Pfund Sterling	US-Dollar	54.272	65.389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	242
Pfund Sterling	US-Dollar	246.565	296.798	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.373
Pfund Sterling	US-Dollar	111.136	133.939	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	457
US-Dollar	Pfund Sterling	30.206	24.581	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	480
US-Dollar	Pfund Sterling	29.624	23.942	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	671
US-Dollar	Pfund Sterling	24.842	19.971	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	692
US-Dollar	Pfund Sterling	28.271	23.194	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	222
US-Dollar	Pfund Sterling	574.922	471.855	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.308
US-Dollar	Pfund Sterling	40.609	33.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	260
US-Dollar	Pfund Sterling	395.155	326.526	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	287
US-Dollar	Pfund Sterling	27.953	22.779	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	407
US-Dollar	Pfund Sterling	31.504	25.862	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	229
US-Dollar	Pfund Sterling	86.340	71.044	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	427
US-Dollar	Pfund Sterling	11.934	9.739	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	156
					USD	10.718
					GBP	8.866
US-Dollar	Pfund Sterling	133.896	111.136	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(461)
US-Dollar	Pfund Sterling	231.426	191.768	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(419)
Pfund Sterling	US-Dollar	87.363	106.422	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(774)
Pfund Sterling	US-Dollar	59.190.532	72.772.729	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.193.693)
Pfund Sterling	US-Dollar	57.839	70.873	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(928)
Pfund Sterling	US-Dollar	45.480	55.811	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(812)
Pfund Sterling	US-Dollar	124.607	153.120	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.433)
Pfund Sterling	US-Dollar	449.922	559.484	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15.394)
Pfund Sterling	US-Dollar	115.985	143.512	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.251)
Pfund Sterling	US-Dollar	37.621	46.799	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.303)
Pfund Sterling	US-Dollar	67.691	82.507	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(648)
Pfund Sterling	US-Dollar	164.161	199.799	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.278)
Pfund Sterling	US-Dollar	149.001	181.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(895)
US-Dollar	Pfund Sterling	17.737	14.735	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(82)
US-Dollar	Pfund Sterling	16.571	13.750	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57)
US-Dollar	Pfund Sterling	8.119	6.726	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Pfund Sterling	18.541	15.388	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(69)
US-Dollar	Pfund Sterling	49.062	40.573	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
					USD	(1.222.515)
					GBP	(1.011.220)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	36	44	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	79	96	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	203	168	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	168	203	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	119	143	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	10.214	12.295	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Pfund Sterling	US-Dollar	15.247	18.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	68
Pfund Sterling	US-Dollar	147	178	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	96	79	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	44	36	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	30	25	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	712	580	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10
US-Dollar	Pfund Sterling	2.570	2.125	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	144.013	119.002	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	105
US-Dollar	Pfund Sterling	11.713	9.638	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58
US-Dollar	Pfund Sterling	2.309	1.897	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
US-Dollar	Pfund Sterling	209.980	172.336	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.574
US-Dollar	Pfund Sterling	2	2	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	183.974	147.896	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5.124
US-Dollar	Pfund Sterling	27	22	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	953	775	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
US-Dollar	Pfund Sterling	201	165	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	12	10	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	7.030
					GBP	5.815
US-Dollar	Pfund Sterling	143	119	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	3.293	4.012	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(29)
Pfund Sterling	US-Dollar	190	231	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.934	10.874	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.536	3.155	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(88)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.832	2.267	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(51)
Pfund Sterling	US-Dollar	166.011	206.437	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.680)
Pfund Sterling	US-Dollar	317	389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
Pfund Sterling	US-Dollar	23.101	28.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(412)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.344	1.646	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)
Pfund Sterling	US-Dollar	21.871.844	26.890.682	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(441.089)
US-Dollar	Pfund Sterling	612	508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(447.451)
					GBP	(370.115)

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

Pfund Sterling	US-Dollar	7.573	9.123	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31
Pfund Sterling	US-Dollar	2.834	3.420	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6
Pfund Sterling	US-Dollar	66.269	79.769	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	369
Pfund Sterling	US-Dollar	18.519	22.319	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	76
Pfund Sterling	US-Dollar	37.336	45.068	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	82
Pfund Sterling	US-Dollar	34.577	41.660	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	154
Pfund Sterling	US-Dollar	71.881	86.921	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Pfund Sterling	17.757	14.577	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	129

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	6.444	5.259	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	84
US-Dollar	Pfund Sterling	18.198	14.830	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	265
US-Dollar	Pfund Sterling	10.643	8.661	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	169
US-Dollar	Pfund Sterling	7.625	6.162	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	173
US-Dollar	Pfund Sterling	24.281	19.519	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	676
US-Dollar	Pfund Sterling	30.380	24.925	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	239
US-Dollar	Pfund Sterling	337.715	277.173	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.531
US-Dollar	Pfund Sterling	15.238	12.520	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	98
US-Dollar	Pfund Sterling	12.021	9.892	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
US-Dollar	Pfund Sterling	231.829	191.566	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	169
					USD	5.315
					GBP	4.396
US-Dollar	Pfund Sterling	22.312	18.519	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(77)
US-Dollar	Pfund Sterling	45.057	37.336	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(82)
Pfund Sterling	US-Dollar	32.311	39.651	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(577)
Pfund Sterling	US-Dollar	33.979	41.755	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(663)
Pfund Sterling	US-Dollar	264.049	328.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.034)
Pfund Sterling	US-Dollar	21.765	26.930	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(610)
Pfund Sterling	US-Dollar	22.214	27.633	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(770)
Pfund Sterling	US-Dollar	29.255	35.658	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(280)
Pfund Sterling	US-Dollar	70.467	85.639	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(423)
Pfund Sterling	US-Dollar	15.889	19.469	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(255)
Pfund Sterling	US-Dollar	12.470	15.191	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(111)
Pfund Sterling	US-Dollar	12.147	14.783	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(95)
Pfund Sterling	US-Dollar	34.839.670	42.834.179	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(702.610)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.420	2.834	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Pfund Sterling	14.215	11.756	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Pfund Sterling	15.233	12.643	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.567	18.748	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(104)
US-Dollar	Pfund Sterling	9.126	7.573	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
					USD	(715.785)
					GBP	(592.072)

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	61	73	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	976	1.179	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Pfund Sterling	US-Dollar	934	1.129	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	9	11	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	73	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	13	11	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	7	6	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	173	142	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	7.765	6.416	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Pfund Sterling	104	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	11.338	9.306	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	85
US-Dollar	Pfund Sterling	1.108	909	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9
US-Dollar	Pfund Sterling	28	22	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	3.931	3.199	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63
US-Dollar	Pfund Sterling	10	8	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	168
					GBP	139
US-Dollar	Pfund Sterling	1.178	976	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	7.687	9.563	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(266)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.844	3.519	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(80)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.793	10.934	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(301)
Pfund Sterling	US-Dollar	409	502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.163.976	1.431.069	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23.474)
					USD	(24.131)
					GBP	(19.960)

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Kanadischer Dollar - 1.587.800			
(31. Dezember 2021: 825.419)			
		1.587.800	3,41
5.000	407 International Inc 3.830% 11-May-2046	3.136	0,01
5.000	407 International Inc 5.750% 14-Feb-2036	3.845	0,01
5.000	407 International Inc 'MTN' 2.840% 07-Mar-2050	2.567	0,01
25.000	407 International Inc 'MTN' 3.350% 16-May-2024	18.099	0,04
5.000	407 International Inc 'MTN' 4.680% 07-Oct-2053	3.561	0,01
5.000	407 International Inc 'MTN' 5.960% 03-Dec-2035	4.047	0,01
5.000	55 Ontario School Board Trust/The 5.900% 02-Jun-2033	4.136	0,01
20.000	AIMCo Realty Investors LP 2.266% 26-Jun-2024	14.184	0,03
10.000	Algonquin Power Co 4.090% 17-Feb-2027	7.012	0,01
30.000	Allied Properties Real Estate Investment Trust 3.095% 06-Feb-2032	17.509	0,04
10.000	AltaLink LP 'MTN' 2.747% 29-May-2026	6.979	0,01
10.000	AltaLink LP 'MTN' 3.717% 03-Dec-2046	6.181	0,01
10.000	AltaLink LP 'MTN' 3.990% 30-Jun-2042	6.549	0,01
5.000	AltaLink LP 'MTN' 4.090% 30-Jun-2045	3.293	0,01
25.000	Apple Inc 2.513% 19-Aug-2024	17.839	0,04
10.000	Athene Global Funding 2.470% 09-Jun-2028	6.297	0,01
20.000	Bank of America Corp FRN 2.932% 25-Apr-2025	14.294	0,03
70.000	Bank of America Corp FRN 3.615% 16-Mar-2028	48.554	0,10
40.000	Bank of Montreal 2.280% 29-Jul-2024	28.290	0,06
10.000	Bank of Montreal FRN 2.880% 17-Sep-2029	7.050	0,01
45.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.370% 03-Feb-2025	31.464	0,07
5.000	Bank of Nova Scotia/The 2.160% 03-Feb-2025	3.480	0,01
20.000	Bank of Nova Scotia/The 2.950% 08-Mar-2027	13.656	0,03
5.000	Bank of Nova Scotia/The 3.100% 02-Feb-2028	3.440	0,01
5.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 2.836% 03-Jul-2029	3.538	0,01
10.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.890% 18-Jan-2029	7.250	0,02
20.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 3.934% 03-May-2032	13.781	0,03
10.000	bclMC Realty Corp 'MTN' 2.840% 03-Jun-2025	7.045	0,01
5.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 5.850% 10-Nov-2032	3.864	0,01
60.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 3.350% 12-Mar-2025	42.787	0,09
5.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 6.170% 26-Feb-2037	3.897	0,01
10.000	Brookfield Corp 5.950% 14-Jun-2035	7.543	0,02
10.000	Brookfield Corp 'MTN' 5.040% 08-Mar-2024	7.360	0,02
15.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN' 3.410% 09-Oct-2029	9.903	0,02
10.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 3.630% 15-Jan-2027	6.997	0,01
55.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 4.290% 05-Nov-2049	33.877	0,07
10.000	Bruce Power LP 3.969% 23-Jun-2026	7.172	0,02
2.000	Cameco Corp 2.950% 21-Oct-2027	1.338	0,00
80.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.000% 17-Apr-2025	55.237	0,12
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.750% 07-Mar-2025	7.038	0,01
5.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 3.290% 15-Jan-2024	3.622	0,01
5.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 2.010% 21-Jul-2030	3.376	0,01
55.000	Canadian National Railway Co 3.050% 08-Feb-2050	29.477	0,06
20.000	Canadian Natural Resources Ltd 'MTN' 3.550% 03-Jun-2024	14.527	0,03
20.000	Canadian Pacific Railway Co 2.540% 28-Feb-2028	13.277	0,03
10.000	Canadian Western Bank 2.597% 06-Sep-2024	7.055	0,01
10.000	Cenovus Energy Inc 3.500% 07-Feb-2028	6.981	0,01
2.000	CGI Inc 2.100 % 18-Sep-2028	1.274	0,00
60.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 2.981% 04-Mar-2030	37.919	0,08
5.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.178% 08-Mar-2028	3.510	0,01
5.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.293% 08-Feb-2024	3.642	0,01
10.000	CNH Industrial Capital Canada Ltd 1.500% 01-Oct-2024	6.918	0,01
5.000	CU Inc 2.963 % 07-Sep-2049	2.630	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.			
5.000	CU Inc 3.964% 27-Jul-2045	3.185	0,01
5.000	CU Inc 4.543% 24-Oct-2041	3.491	0,01
5.000	CU Inc 4.722 % 09-Sep-2043	3.562	0,01
5.000	CU Inc 'MTN' 3.857% 14-Nov-2052	3.050	0,01
15.000	Enbridge Gas Inc 4.150% 17-Aug-2032	10.553	0,02
5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.200% 02-Jun-2044	3.277	0,01
5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.500% 23-Nov-2043	3.433	0,01
10.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.880% 21-Jun-2041	7.217	0,02
20.000	Enbridge Inc 'MTN' 3.100% 21-Sep-2033	11.975	0,03
10.000	Enbridge Inc 'MTN' 3.200% 08-Jun-2027	6.861	0,01
20.000	Enbridge Inc 'MTN' 4.240% 27-Aug-2042	11.942	0,03
20.000	Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 3.520% 22-Feb-2029	13.634	0,03
5.000	Energir Inc 3.530% 16-May-2047	2.973	0,01
20.000	Equitable Bank 3.362% 02-Mar-2026	13.727	0,03
10.000	Fairfax Financial Holdings Ltd 4.250% 06-Dec-2027	7.015	0,01
30.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 5.200% 01-Oct-2025	22.227	0,05
20.000	First Capital Real Estate Investment Trust 3.456% 22-Jan-2027	13.255	0,03
5.000	First Capital Real Estate Investment Trust 4.790% 30-Aug-2024	3.598	0,01
15.000	FortisBC Energy Inc 'MTN' 2.420% 18-Jul-2031	9.370	0,02
50.000	General Motors Financial of Canada Ltd 3.150% 08-Feb-2027	33.414	0,07
25.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.599% 30-Nov-2027	16.701	0,04
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.307% 31-Oct-2025	28.441	0,06
5.000	Greater Toronto Airports Authority 'MTN' 5.300% 25-Feb-2041	3.875	0,01
5.000	Great-West Lifeco Inc 3.337% 28-Feb-2028	3.451	0,01
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.670% 21-Mar-2033	4.123	0,01
5.000	Great-West Lifeco Inc 6.740% 24-Nov-2031	4.115	0,01
5.000	Honda Canada Finance Inc 2.500% 04-Jun-2024	3.556	0,01
10.000	Honda Canada Finance Inc 3.444% 23-May-2025	7.121	0,01
10.000	Hydro One Inc 2.230% 17-Sep-2031	6.136	0,01
5.000	Hydro One Inc 7.350% 03-Jun-2030	4.255	0,01
25.000	Hydro One Inc 'MTN' 2.540% 05-Apr-2024	17.916	0,04
10.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.630% 25-Jun-2049	6.039	0,01
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 3.720% 18-Nov-2047	3.070	0,01
5.000	Hydro One Inc 'MTN' 6.590% 22-Apr-2043	4.443	0,01
20.000	Hyundai Capital Canada Inc 3.196% 16-Feb-2027	13.444	0,03
5.000	IGM Financial Inc 4.206% 21-Mar-2050	3.069	0,01
20.000	Inter Pipeline Ltd 5.760% 17-Feb-2028	14.958	0,03
10.000	John Deere Financial Inc 2.410% 14-Jan-2025	7.019	0,01
20.000	John Deere Financial Inc 'MTN' 2.460% 04-Apr-2024	14.305	0,03
5.000	Loblaw Cos Ltd 4.488% 11-Dec-2028	3.639	0,01
10.000	Loblaw Cos Ltd 5.008% 13-Sep-2032	7.338	0,02
5.000	Macquarie Group Ltd FRN 2.723% 21-Aug-2029	3.141	0,01
15.000	Manulife Financial Corp FRN 2.818% 13-May-2035	9.336	0,02
10.000	Metro Inc/CN 'MTN' 5.030% 01-Dec-2044	7.067	0,01
10.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.950% 20-Mar-2028	6.387	0,01
10.000	Molson Coors International LP 3.440% 15-Jul-2026	6.967	0,01
20.000	National Bank of Canada 2.983% 04-Mar-2024	14.392	0,03
5.165	NAV Canada 7.400% 01-Jun-2027	4.257	0,01
20.000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 3.200% 24-Apr-2026	14.045	0,03
5.000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 4.350% 10-Jan-2039	3.312	0,01
10.000	OMERS Realty Corp 3.331% 05-Jun-2025	7.129	0,01
10.000	Paccar Financial Ltd/Canada 0.985% 14-May-2024	6.972	0,01
5.000	Pembina Pipeline Corp 4.020% 27-Mar-2028	3.510	0,01
20.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.240% 15-Jun-2027	14.292	0,03
10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.740% 21-Jan-2047	6.216	0,01
20.000	RioCan Real Estate Investment Trust 2.361% 10-Mar-2027	12.906	0,03
10.000	RioCan Real Estate Investment Trust 3.287% 12-Feb-2024	7.182	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.			
10.000	Rogers Communications Inc 3.100% 15-Apr-2025	7.053	0,01
5.000	Rogers Communications Inc 3.250% 01-May-2029	3.299	0,01
15.000	Rogers Communications Inc 3.650% 31-Mar-2027	10.457	0,02
5.000	Rogers Communications Inc 4.000% 13-Mar-2024	3.638	0,01
5.000	Rogers Communications Inc 5.250% 15-Apr-2022	3.337	0,01
65.000	Royal Bank of Canada 2.328% 28-Jan-2027	43.364	0,09
8.000	Royal Bank of Canada 2.333% 05-Dec-2023	5.768	0,01
5.000	Royal Bank of Canada 2.352% 02-Jul-2024	3.546	0,01
10.000	Royal Bank of Canada 2.609% 01-Nov-2024	7.067	0,01
30.000	Royal Bank of Canada 3.369% 29-Sep-2025	21.236	0,05
10.000	Royal Bank of Canada FRN 2.880% 23-Dec-2029	6.997	0,01
10.000	Saputo Inc 2.297% 22-Jun-2028	6.431	0,01
20.000	Scotiabank Capital Trust FRN 5.650% 31-Dec-2056	14.602	0,03
10.000	Shaw Communications Inc 4.350% 31-Jan-2024	7.292	0,02
5.000	Sun Life Assurance Co of Canada 6.300% 15-May-2028	3.925	0,01
60.000	Sun Life Financial Inc FRN 3.150% 18-Nov-2036	36.881	0,08
5.000	Sun Life Financial Inc 'MTN' FRN 5.400% 29-May-2042	3.583	0,01
25.000	Suncor Energy Inc 'MTN' 3.950% 04-Mar-2051	13.888	0,03
10.000	Sysco Canada Inc 3.650% 25-Apr-2025	7.144	0,02
10.000	TCHC Issuer Trust 4.877% 11-May-2037	7.537	0,02
10.000	TELUS Corp 2.750% 08-Jul-2026	6.868	0,01
5.000	TELUS Corp 3.150% 19-Feb-2030	3.268	0,01
5.000	TELUS Corp 5.150% 26-Nov-2043	3.436	0,01
10.000	TELUS Corp 5.250% 15-Nov-2032	7.347	0,02
20.000	TELUS Corp 5.650% 13-Sep-2052	14.698	0,03
5.000	TELUS Corp 'MTN' 4.400% 29-Jan-2046	3.074	0,01
2.000	Teranet Holdings LP 5.754% 17-Dec-2040	1.396	0,00
10.000	Thomson Reuters Corp 2.239% 14-May-2025	6.950	0,01
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.896% 11-Sep-2028	12.565	0,03
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.943% 13-Mar-2025	3.459	0,01
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 2.667% 09-Sep-2025	13.908	0,03
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 3.226% 24-Jul-2024	3.597	0,01
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 4.210% 01-Jun-2027	7.176	0,02
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.060% 26-Jan-2032	6.717	0,01
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.105% 22-Apr-2030	3.499	0,01
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.224% 25-Jul-2029	7.108	0,01
30.000	Toyota Credit Canada Inc 'MTN' 2.730% 25-Aug-2025	20.938	0,04
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 3.800% 05-Apr-2027	7.047	0,01
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 3.390% 15-Mar-2028	6.844	0,01
50.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 4.340% 15-Oct-2049	29.582	0,06
10.000	TWDC Enterprises 18 Corp 2.758% 07-Oct-2024	7.110	0,01
5.000	Ventas Canada Finance Ltd 2.800% 12-Apr-2024	3.558	0,01
5.000	Ventas Canada Finance Ltd 4.125% 30-Sep-2024	3.595	0,01
30.000	Verizon Communications Inc 4.050% 22-Mar-2051	17.565	0,04
10.000	VW Credit Canada Inc 2.850% 26-Sep-2024	7.079	0,01
20.000	Walt Disney Co/The 3.057% 30-Mar-2027	13.734	0,03
10.000	Wells Fargo & Co 2.975% 19-May-2026	6.883	0,01
10.000	Wells Fargo & Co 3.184% 08-Feb-2024	7.204	0,02
20.000	Wells Fargo & Co FRN 4.168% 28-Apr-2026 VAR	14.369	0,03
Euro - 11.323.775			
(31. Dezember 2021: 4.725.066)		11.323.775	24,33
100.000	Air Liquide Finance SA 'EMTN' 2.875% 16-Sep-2032	101.429	0,22
100.000	Allianz SE FRN 3.099% 06-Jul-2047	98.923	0,21
100.000	American Tower Corp 0.400% 15-Feb-2027	91.534	0,20
20.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2030	18.512	0,04
25.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.750% 17-Mar-2036	23.144	0,05
20.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.875% 25-Sep-2024	21.308	0,05
100.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025	104.421	0,22

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	AT&T Inc 2.050 % 19-May-2032	89.789	0,19
100.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.625% 25-Jan-2028	89.037	0,19
100.000	AXA SA 'EMTN' 3.750% 12-Oct-2030	107.400	0,23
100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 3.500% 10-Feb-2027	104.379	0,22
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	88.063	0,19
100.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.102% 24-May-2032	82.276	0,18
100.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN' 0.250% 01-Nov-2028	85.634	0,18
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.625% 21-Feb-2031	80.812	0,17
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 04-Nov-2026	98.860	0,21
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.125% 14-Sep-2027	104.280	0,22
100.000	BASF SE 1.500% 17-Mar-2031	90.568	0,20
5.000	BASF SE 1.625% 15-Nov-2037	3.940	0,01
100.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030	87.029	0,19
100.000	Bayer AG 0.050% 12-Jan-2025	99.859	0,22
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026	98.064	0,21
100.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 2.000% 18-Mar-2034	86.235	0,19
10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.500% 06-Feb-2029	9.492	0,02
100.000	BNP Paribas Cardif SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2024	101.214	0,22
50.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2.375% 20-May-2024	52.966	0,11
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	99.382	0,21
100.000	Booking Holdings Inc 1.800% 03-Mar-2027	98.764	0,21
100.000	BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032	97.315	0,21
100.000	BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	96.709	0,21
100.000	BPCE SA FRN 1.625% 02-Mar-2029	93.403	0,20
100.000	CaixaBank SA 'GMTN' FRN 1.625% 13-Apr-2026	100.266	0,22
20.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 4.250% 25-Feb-2030	21.070	0,05
100.000	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	104.531	0,23
100.000	Coca-Cola Co/The 1.625% 09-Mar-2035	86.233	0,19
5.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.625% 28-Aug-2024	5.108	0,01
15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.000% 04-Mar-2026	14.738	0,03
10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.500% 28-Aug-2028	9.522	0,02
15.000	Continental AG 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2025	14.858	0,03
10.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN' 1.375% 03-Feb-2027	9.901	0,02
15.000	Covestro AG 1.750% 25-Sep-2024	15.511	0,03
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.375% 21-Oct-2025	98.587	0,21
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029	92.173	0,20
100.000	Credit Suisse Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	77.377	0,17
100.000	Czech Gas Networks Investments Sarl 0.450% 08-Sep-2029	75.992	0,16
100.000	Danone SA FRN (Perpetual) 1.000% 16-Sep-2026	89.929	0,19
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' 1.625% 20-Jan-2027	94.551	0,20
20.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	20.140	0,04
20.000	Deutsche Boerse AG 1.125% 26-Mar-2028	19.449	0,04
15.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034	12.381	0,03
5.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 25-Mar-2031	4.642	0,01
15.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 09-Dec-2049	10.406	0,02
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 2.250% 29-Mar-2039	8.462	0,02
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.875% 30-Jan-2024	10.477	0,02
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.375% 30-Jan-2027	9.930	0,02
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.500% 03-Apr-2028	4.844	0,01
100.000	DH Europe Finance II Sarl 0.200% 18-Mar-2026	96.654	0,21
100.000	Diageo Finance Plc 'EMTN' 1.000% 22-Apr-2025	101.677	0,22
100.000	Digital Dutch Finco BV 0.625% 15-Jul-2025	95.882	0,21
100.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 1.625% 31-May-2026	101.552	0,22
100.000	DSV Finance BV 'EMTN' 0.875% 17-Sep-2036	68.336	0,15

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
20.000	E.ON International Finance BV 1.000% 13-Apr-2025	20.332	0,04
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027	9.736	0,02
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.500% 31-Jul-2029	9.282	0,02
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 3.000% 17-Jan-2024	10.780	0,02
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033	5.959	0,01
30.000	E.ON SE 'EMTN' 0.000% 18-Dec-2023	31.282	0,07
10.000	E.ON SE 'EMTN' 0.100% 19-Dec-2028	8.678	0,02
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0.250% 24-Oct-2026	4.789	0,01
10.000	E.ON SE 'EMTN' 0.375% 29-Sep-2027	9.370	0,02
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0.750% 18-Dec-2030	4.212	0,01
20.000	E.ON SE 'EMTN' 2.875% 26-Aug-2028	20.467	0,04
100.000	Edenred 1.875% 30-Mar-2027	100.681	0,22
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.875% 17-Jan-2031	82.408	0,18
50.000	Enel SpA 'EMTN' 5.250% 20-May-2024	54.877	0,12
50.000	Enel SpA 'EMTN' 5.625% 21-Jun-2027	57.870	0,12
100.000	Engie SA 'EMTN' 1.750% 27-Mar-2028	96.856	0,21
5.000	Engie SA 'EMTN' 5.950% 16-Mar-2111	5.599	0,01
100.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	89.370	0,19
100.000	Erste Group Bank AG 'EMTN' 1.500% 07-Apr-2026	99.651	0,21
35.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 0.375% 07-Sep-2024	35.746	0,08
10.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.250% 29-Nov-2029	8.324	0,02
20.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.500% 29-May-2030	16.800	0,04
10.000	Fresenius SE & Co KGaA 1.875% 15-Feb-2025	10.286	0,02
20.000	Fresenius SE & Co KGaA 'EMTN' 2.875% 24-May-2030	18.383	0,04
10.000	GE Capital European Funding Unlimited Co 'EMTN' 6.025% 01-Mar-2038	12.528	0,03
30.000	General Electric Co 'EMTN' 4.125% 19-Sep-2035	31.824	0,07
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	15.972	0,03
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.125% 19-Aug-2024	5.082	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.875% 21-Jan-2030	8.462	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.375% 15-May-2024	5.222	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.625% 27-Jul-2026	9.987	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028	9.614	0,02
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.875% 03-Jun-2026	15.654	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.000% 12-Feb-2031	9.697	0,02
100.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 'EMTN' 1.250% 29-Mar-2026	98.803	0,21
60.000	HBOS Plc 'EMTN' FRN 4.500% 18-Mar-2030	61.745	0,13
10.000	HeidelbergCement AG 'EMTN' 2.250% 03-Jun-2024	10.542	0,02
20.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2026	20.123	0,04
100.000	Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 0.750% 06-Sep-2029	72.020	0,16
20.000	Heineken NV 'EMTN' 3.500% 19-Mar-2024	21.590	0,05
20.000	Hella GmbH & Co KGaA 1.000% 17-May-2024	20.644	0,04
15.000	HOCHTIEF AG 'EMTN' 1.750% 03-Jul-2025	15.242	0,03
100.000	Holcim Finance Luxembourg SA 'EMTN' 0.500% 03-Sep-2030	80.666	0,17
100.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.019% 15-Jun-2027	102.052	0,22
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 23-May-2026	101.949	0,22
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 26-May-2031	97.166	0,21
100.000	International Business Machines Corp 1.750% 31-Jan-2031	91.405	0,20
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 19-Nov-2026	95.308	0,21
100.000	JAB Holdings BV 2.500% 17-Apr-2027	101.023	0,22
100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' 1.500% 27-Jan-2025	103.653	0,22

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.638% 18-May-2028	96.326	0,21
100.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 1.625% 18-Sep-2029	99.661	0,21
100.000	Kojamo Oyj 'EMTN' 2.000% 31-Mar-2026	95.235	0,21
20.000	LANXESS AG 'EMTN' 1.125% 16-May-2025	20.317	0,04
100.000	Linde Plc 'EMTN' 1.000% 30-Sep-2051	59.030	0,13
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 15-Oct-2028	89.411	0,19
25.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2033	20.020	0,04
10.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 2.125% 03-Jul-2037	8.770	0,02
15.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 2.375% 22-May-2030	14.870	0,03
10.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 1.375% 26-Jun-2026	10.057	0,02
30.000	Merck KGaA FRN 3.375% 12-Dec-2074	31.707	0,07
100.000	Metropolitan Life Global Funding I 'EMTN' 1.750% 25-May-2025	102.909	0,22
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' 1.750% 30-Jan-2025	103.209	0,22
15.000	MTU Aero Engines AG 3.000% 01-Jul-2025	15.974	0,03
15.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 1.250% 18-May-2026	15.115	0,03
100.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 0.250% 14-Sep-2028	86.028	0,19
100.000	Naturgy Finance BV 'EMTN' 1.250% 15-Jan-2026	98.728	0,21
100.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 0.780% 26-Feb-2030	84.157	0,18
100.000	Nerval SAS 3.625% 20-Jul-2028	97.066	0,21
10.000	Nestle Finance International Ltd 0.375% 03-Dec-2040	6.280	0,01
40.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 0.000% 03-Mar-2033	30.218	0,07
35.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030	33.094	0,07
10.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.750% 02-Nov-2037	8.540	0,02
100.000	Nordea Bank Abp 'EMTN' 2.875% 24-Aug-2032	98.441	0,21
50.000	OMV AG 'EMTN' 1.000% 03-Jul-2034	38.513	0,08
100.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.500% 12-Aug-2025	98.938	0,21
100.000	Orange SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2032	90.126	0,19
20.000	Orange SA 'EMTN' 8.125% 28-Jan-2033	28.053	0,06
100.000	Philip Morris International Inc 'EMTN' 2.875% 03-Mar-2026	103.811	0,22
100.000	PPG Industries Inc 2.750% 01-Jun-2029	99.501	0,21
5.000	PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033	5.865	0,01
100.000	RELX Finance BV 0.500% 10-Mar-2028	90.645	0,20
100.000	Rentokil Initial Plc 'EMTN' 0.875% 30-May-2026	96.477	0,21
10.000	RWE AG 0.625% 11-Jun-2031	8.065	0,02
20.000	RWE AG 2.500% 24-Aug-2025	20.828	0,05
20.000	RWE AG 'EMTN' 0.500% 26-Nov-2028	17.756	0,04
110.000	RWE AG 'EMTN' 1.000% 26-Nov-2033	84.207	0,18
100.000	Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	103.965	0,22
100.000	Sanofi 1.250% 06-Apr-2029	95.215	0,21
100.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'EMTN' 1.750% 11-Apr-2028	90.405	0,19
100.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 1.875% 07-Apr-2032	92.237	0,20
100.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 2.500% 08-Sep-2027	102.934	0,22
100.000	Signify NV 2.000% 11-May-2024	104.480	0,23
100.000	SKF AB 'EMTN' 0.875% 15-Nov-2029	86.136	0,19
100.000	Snam SpA 'EMTN' 0.000% 15-Aug-2025	97.230	0,21
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1.750% 22-Mar-2029	91.372	0,20
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 1.500% 30-May-2025	103.745	0,22
60.000	Stellantis NV 'EMTN' 2.000% 23-Mar-2024	63.161	0,14
100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 'EMTN' 0.303% 28-Oct-2027	89.618	0,19
60.000	Telefonica Europe BV 'EMTN' 5.875% 14-Feb-2033	71.709	0,15
50.000	Telia Co AB 'EMTN' 3.875% 01-Oct-2025	53.990	0,12
100.000	Thales SA 'EMTN' 0.000% 26-Mar-2026	95.099	0,20
100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.125% 01-Mar-2025	99.802	0,21

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Euro Forts.			
100.000	TotalEnergies Capital International SA 'EMTN' 1.535% 31-May-2039	77.612	0,17
100.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025	100.562	0,22
100.000	Toyota Finance Australia Ltd 'EMTN' 0.064% 13-Jan-2025	100.081	0,22
100.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	87.324	0,19
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	80.480	0,17
100.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025	102.528	0,22
100.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 1.750% 16-Nov-2028	98.742	0,21
50.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 5.500% 22-Jul-2024	55.004	0,12
5.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 6.125% 25-Nov-2033	6.201	0,01
100.000	Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026	98.253	0,21
100.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	89.853	0,19
100.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	81.090	0,17
30.000	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 3.750% 02-Mar-2046	30.314	0,07
100.000	Vinci SA 'EMTN' 1.000% 26-Sep-2025	100.907	0,22
20.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0.250% 31-Jan-2025	19.864	0,04
10.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0.875% 31-Jan-2028	8.874	0,02
50.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 1.500% 01-Oct-2024	51.294	0,11
15.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 3.000% 06-Apr-2025	15.689	0,03
20.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 1.625% 16-Jan-2030	18.024	0,04
60.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.500% 20-Mar-2030	52.632	0,11
30.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 4.625% 24-Mar-2026	30.564	0,07
20.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.375% 20-Jul-2026	18.537	0,04
10.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.625% 19-Jul-2029	8.241	0,02
20.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 2.625% 15-Jan-2024	21.293	0,05
100.000	Volvo Treasury AB 'EMTN' 2.625% 20-Feb-2026	103.519	0,22
26.000	Vonovia Finance BV 1.500% 31-Mar-2025	26.697	0,06
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029	78.576	0,17
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 1.375% 26-Oct-2026	96.242	0,21
100.000	Walters Kluwer NV 0.750% 03-Jul-2030	85.679	0,18
20.000	Wurth Finance International BV 'EMTN' 1.000% 26-May-2025	20.422	0,04
Pfund Sterling - 1.834.923			
(31. Dezember 2021: 859.008)		1.834.923	3,94
50.000	Affinity Sutton Capital Markets Plc 'EMTN' 5.981% 17-Sep-2038	62.762	0,13
50.000	AT&T Inc 5.500 % 15-Mar-2027	61.035	0,13
50.000	AT&T Inc 'EMTN' 7.000% 30-Apr-2040	68.119	0,15
10.000	Aviva Plc FRN 6.125% 14-Nov-2036	12.099	0,03
50.000	Bank of America Corp 'EMTN' 7.000% 31-Jul-2028	64.892	0,14
25.000	Barclays Bank Plc 'EMTN' 5.750% 14-Sep-2026	30.345	0,07
100.000	CaixaBank SA FRN 3.500% 06-Apr-2028	107.022	0,23
15.000	Citigroup Inc 'EMTN' 5.150% 21-May-2026	18.156	0,04
5.000	Coöperatieve Rabobank UA 'GMTN' 5.250% 23-May-2041	6.365	0,01
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV 7.625% 15-Jun-2030	7.060	0,02
15.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 8.875% 27-Nov-2028	21.621	0,05
50.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.125% 06-Jul-2039	62.119	0,13
10.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.250% 03-Jun-2030	12.595	0,03
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.375% 07-Jun-2032	6.407	0,01
100.000	East Japan Railway Co 'EMTN' 1.162% 15-Sep-2028	97.285	0,21

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Pfund Sterling Forts.			
20.000	Freshwater Finance Plc 5.182% 20-Apr-2035	22.890	0,05
10.000	General Electric Co 'EMTN' 4.875% 18-Sep-2037	10.580	0,02
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 5.250% 19-Dec-2033	6.322	0,01
60.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.125% 25-Jul-2029	62.613	0,13
5.000	Hammerston Plc 6.000% 23-Feb-2026	5.566	0,01
50.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS' 6.450% 10-Dec-2031	62.273	0,13
5.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP FRN (Perpetual) 5.844% 05-Nov-2031	6.212	0,01
5.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 5.750% 20-Dec-2027	5.972	0,01
50.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 6.000% 29-Mar-2040	55.431	0,12
50.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 8.125% 15-Mar-2024	62.096	0,13
50.000	Johnson & Johnson 5.500% 06-Nov-2024	61.748	0,13
100.000	Just Group Plc FRN 7.000% 15-Apr-2031	117.154	0,25
10.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN' 5.875% 11-Dec-2031	12.852	0,03
5.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 6.500% 17-Sep-2040	6.942	0,02
50.000	London & Quadrant Housing Trust 5.500% 27-Jan-2040	59.092	0,13
100.000	M&G Plc FRN 5.625% 20-Oct-2051	110.043	0,24
8.000	McDonald's Corp 'EMTN' 5.875% 23-Apr-2032	10.375	0,02
10.000	National Grid Electricity Distribution South West Plc 5.875% 25-Mar-2027	12.305	0,03
15.000	Orange SA 'EMTN' 5.625% 23-Jan-2034	18.763	0,04
50.000	Orange SA 'EMTN' 8.125% 20-Nov-2028	69.792	0,15
10.000	Prudential Plc 'EMTN' 6.125% 19-Dec-2031	11.984	0,03
50.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 6.125% 26-Feb-2024	61.078	0,13
5.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 6.250% 07-Jun-2029	6.366	0,01
10.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN' 5.500% 05-Jun-2026	12.242	0,03
9.753	Sunderland SHG Finance Plc 6.380% 31-Mar-2042	12.432	0,03
10.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 6.750% 18-Nov-2028	12.733	0,03
5.000	THFC Funding No 1 Plc 5.125% 21-Dec-2035	5.892	0,01
10.000	TotalEnergies Capital International SA 'EMTN' 1.750% 07-Jul-2025	11.301	0,02
50.000	United Parcel Service Inc 5.125% 12-Feb-2050	64.274	0,14
5.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN' 5.625% 20-Dec-2027	6.215	0,01
100.000	University of Oxford 2.544% 08-Dec-2117	68.369	0,15
30.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2025	33.788	0,07
10.000	Walmart Inc 5.250% 28-Sep-2035	12.802	0,03
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 2.125% 24-Sep-2031	92.528	0,20
5.000	Wessex Water Services Finance Plc 5.375% 10-Mar-2028	6.016	0,01
US-Dollar - 31.269.488			
(31. Dezember 2021: 13.202.095)		31.269.488	67,19
20.000	3M Co 2.375% 26-Aug-2029	17.052	0,04
5.000	3M Co 'MTN' 5.700% 15-Mar-2037	5.154	0,01
25.000	7-Eleven Inc '144A' 0.800% 10-Feb-2024	23.798	0,05
15.000	7-Eleven Inc '144A' 0.950% 10-Feb-2026	13.165	0,03
15.000	7-Eleven Inc '144A' 1.800% 10-Feb-2031	11.501	0,02
20.000	7-Eleven Inc '144A' 2.800% 10-Feb-2051	12.427	0,03
10.000	ABB Finance USA Inc 4.375% 08-May-2042	8.704	0,02
15.000	Abbott Laboratories 3.875% 15-Sep-2025	14.730	0,03
5.000	Abbott Laboratories 4.750% 30-Nov-2036	4.997	0,01
10.000	Abbott Laboratories 6.150% 30-Nov-2037	11.272	0,02
30.000	AbbVie Inc 2.600% 21-Nov-2024	28.735	0,06
20.000	AbbVie Inc 3.200% 14-May-2026	18.924	0,04
20.000	AbbVie Inc 3.200% 21-Nov-2029	18.150	0,04
35.000	AbbVie Inc 3.600% 14-May-2025	33.979	0,07
15.000	AbbVie Inc 3.800% 15-Mar-2025	14.644	0,03
20.000	AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039	17.302	0,04
15.000	AbbVie Inc 4.250% 14-Nov-2028	14.524	0,03
25.000	AbbVie Inc 4.250% 21-Nov-2049	21.202	0,05
15.000	AbbVie Inc 4.400% 06-Nov-2042	13.147	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
5.000	AbbVie Inc 4.450% 14-May-2046	4.349	0,01	
5.000	AbbVie Inc 4.500% 14-May-2035	4.663	0,01	
40.000	AbbVie Inc 4.550% 15-Mar-2035	37.716	0,08	
10.000	AbbVie Inc 4.700% 14-May-2045	9.009	0,02	
10.000	AbbVie Inc 4.850% 15-Jun-2044	9.268	0,02	
5.000	AbbVie Inc 4.875% 14-Nov-2048	4.615	0,01	
10.000	ABN AMRO Bank NV '144A' 4.750% 28-Jul-2025	9.710	0,02	
25.000	ACE Capital Trust II 9.700% 01-Apr-2030	31.117	0,07	
20.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 3.100% 02-Feb-2031	14.746	0,03	
30.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 3.375% 24-Jul-2024	28.540	0,06	
20.000	Advanced Micro Devices Inc 3.924% 01-Jun-2032	18.700	0,04	
15.000	AEP Texas Inc 3.450% 15-Jan-2050	10.749	0,02	
10.000	AEP Transmission Co LLC 3.100% 01-Dec-2026	9.400	0,02	
5.000	AEP Transmission Co LLC 4.500% 15-Jun-2052	4.460	0,01	
15.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 1.650% 29-Oct-2024	13.851	0,03	
20.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.450% 29-Oct-2026	17.535	0,04	
15.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.000% 29-Oct-2028	12.619	0,03	
30.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.300% 30-Jan-2032	23.614	0,05	
25.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.400% 29-Oct-2033	19.102	0,04	
20.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.450% 03-Apr-2026	19.148	0,04	
20.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.875% 16-Jan-2024	19.818	0,04	
10.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 6.500% 15-Jul-2025	10.150	0,02	
25.000	AES Corp/The '144A' 3.300% 15-Jul-2025	23.681	0,05	
5.000	Aetna Inc 4.500% 15-May-2042	4.363	0,01	
5.000	Aetna Inc 6.625% 15-Jun-2036	5.357	0,01	
5.000	Affiliated Managers Group Inc 4.250% 15-Feb-2024	4.942	0,01	
5.000	Ahold Finance USA LLC 6.875% 01-May-2029	5.260	0,01	
40.000	AIA Group Ltd '144A' 3.200% 16-Sep-2040	28.792	0,06	
20.000	AIA Group Ltd '144A' 5.625% 25-Oct-2027	20.447	0,04	
10.000	AIB Group Plc '144A' FRN 7.583% 14-Oct-2026	10.201	0,02	
5.000	AlG SunAmerica Global Financing X '144A' 6.900% 15-Mar-2032	5.352	0,01	
11.928	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030	10.097	0,02	
20.000	Air Lease Corp 1.875% 15-Aug-2026	17.420	0,04	
25.000	Air Lease Corp 2.875% 15-Jan-2032	20.004	0,04	
20.000	Air Lease Corp 4.625% 01-Oct-2028	18.786	0,04	
10.000	Air Lease Corp 'MTN' 2.875% 15-Jan-2026	9.272	0,02	
25.000	Air Products and Chemicals Inc 3.350% 31-Jul-2024	24.456	0,05	
5.000	Aircastle Ltd 4.250% 15-Jun-2026	4.708	0,01	
20.000	Aker BP ASA '144A' 2.000% 15-Jul-2026	17.713	0,04	
10.000	Aker BP ASA '144A' 2.875% 15-Jan-2026	9.261	0,02	
25.000	Albemarle Corp 5.650% 01-Jun-2052	23.013	0,05	
10.000	Alcon Finance Corp '144A' 3.800% 23-Sep-2049	7.704	0,02	
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 1.875% 01-Feb-2033	7.494	0,02	
25.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 2.950% 15-Mar-2034	20.402	0,04	
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 3.000% 18-May-2051	6.419	0,01	
5.000	Alfa SAB de CV 'REGS' 6.875% 25-Mar-2044	4.892	0,01	
10.000	Alibaba Group Holding Ltd 2.700% 09-Feb-2041	6.451	0,01	
10.000	Alibaba Group Holding Ltd 3.400% 06-Dec-2027	9.229	0,02	
70.000	Alibaba Group Holding Ltd 3.600% 28-Nov-2024	67.747	0,15	
5.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.400% 06-Dec-2057	3.874	0,01	
20.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 2.950% 25-Jan-2030	17.043	0,04	
20.000	Allegion US Holding Co Inc 3.200% 01-Oct-2024	19.255	0,04	
5.000	Allstate Corp/The 1.450% 15-Dec-2030	3.854	0,01	
15.000	Allstate Corp/The 3.280% 15-Dec-2026	14.258	0,03	
5.000	Allstate Corp/The FRN 6.500% 15-May-2057	4.887	0,01	
5.000	Ally Financial Inc 3.875% 21-May-2024	4.871	0,01	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
25.000	Ally Financial Inc 5.125% 30-Sep-2024	24.781	0,05	
10.000	Ally Financial Inc 8.000% 01-Nov-2031	10.391	0,02	
15.000	Alphabet Inc 1.100% 15-Aug-2030	11.824	0,03	
10.000	Alphabet Inc 1.998% 15-Aug-2026	9.221	0,02	
15.000	Alphabet Inc 2.250% 15-Aug-2060	8.605	0,02	
10.000	Altria Group Inc 2.450% 04-Feb-2032	7.595	0,02	
3.000	Altria Group Inc 3.700% 04-Feb-2051	1.904	0,00	
5.000	Altria Group Inc 3.875% 16-Sep-2046	3.386	0,01	
10.000	Altria Group Inc 4.000% 04-Feb-2061	6.581	0,01	
10.000	Altria Group Inc 4.250% 09-Aug-2042	7.491	0,02	
20.000	Altria Group Inc 4.800% 14-Feb-2029	19.245	0,04	
5.000	Altria Group Inc 5.375% 31-Jan-2044	4.443	0,01	
25.000	Altria Group Inc 5.800% 14-Feb-2039	23.054	0,05	
10.000	Altria Group Inc 5.950% 14-Feb-2049	8.966	0,02	
15.000	Amazon.com Inc 1.500% 03-Jun-2030	12.120	0,03	
25.000	Amazon.com Inc 2.100% 12-May-2031	20.563	0,04	
5.000	Amazon.com Inc 2.700% 03-Jun-2060	3.066	0,01	
20.000	Amazon.com Inc 2.875% 12-May-2041	15.094	0,03	
25.000	Amazon.com Inc 3.150% 22-Aug-2027	23.587	0,05	
5.000	Amazon.com Inc 3.250% 12-May-2061	3.481	0,01	
30.000	Amazon.com Inc 3.450% 13-Apr-2029	28.159	0,06	
10.000	Amazon.com Inc 3.600% 13-Apr-2032	9.212	0,02	
10.000	Amazon.com Inc 3.875% 22-Aug-2037	8.961	0,02	
10.000	Amazon.com Inc 4.250% 22-Aug-2057	8.675	0,02	
15.000	Amazon.com Inc 4.800% 05-Dec-2034	15.072	0,03	
15.000	Amazon.com Inc 5.200% 03-Dec-2025	15.277	0,03	
10.000	Amercor Finance USA Inc 4.500% 15-May-2028	9.378	0,02	
40.000	Ameren Corp 3.500% 15-Jan-2031	35.557	0,08	
20.000	Ameren Illinois Co 3.850% 01-Sep-2032	18.704	0,04	
25.000	America Movil SAB de CV 4.700% 21-Jul-2032	24.028	0,05	
5.000	America Movil SAB de CV 6.125% 30-Mar-2040	5.195	0,01	
10.000	America Movil SAB de CV 6.375% 01-Mar-2035	10.660	0,02	
10.000	American Express Co 2.550% 04-Mar-2027	9.121	0,02	
10.000	American Express Co 3.300% 03-May-2027	9.388	0,02	
50.000	American Express Co 3.375% 03-May-2024	49.028	0,11	
10.000	American Express Co 3.950% 01-Aug-2025	9.814	0,02	
25.000	American Express Co 4.050% 03-May-2029	23.911	0,05	
20.000	American Express Co FRN 4.989% 26-May-2033	19.348	0,04	
5.000	American Homes 4 Rent LP 4.900% 15-Feb-2029	4.747	0,01	
20.000	American Honda Finance Corp 'GMTN' 2.300% 09-Sep-2026	18.334	0,04	
20.000	American Honda Finance Corp 'MTN' 2.400% 27-Jun-2024	19.288	0,04	
25.000	American International Group Inc 3.400% 30-Jun-2030	22.169	0,05	
5.000	American International Group Inc 4.375% 30-Jun-2050	4.270	0,01	
10.000	American International Group Inc 4.500% 16-Jul-2044	8.774	0,02	
30.000	American Tower Corp 1.300% 15-Sep-2025	27.147	0,06	
10.000	American Tower Corp 1.875% 15-Oct-2030	7.762	0,02	
10.000	American Tower Corp 2.300% 15-Sep-2031	7.826	0,02	
10.000	American Tower Corp 2.400% 15-Mar-2025	9.418	0,02	
10.000	American Tower Corp 2.700% 15-Apr-2031	8.189	0,02	
20.000	American Tower Corp 2.750% 15-Jan-2027	18.184	0,04	
10.000	American Tower Corp 2.950% 15-Jan-2025	9.552	0,02	
15.000	American Tower Corp 3.375% 15-Oct-2026	14.062	0,03	
5.000	American Tower Corp 3.800% 15-Aug-2029	4.559	0,01	
10.000	American Tower Corp 4.000% 01-Jun-2025	9.761	0,02	
10.000	American Tower Corp 4.400% 15-Feb-2026	9.762	0,02	
25.000	American Water Capital Corp 2.300% 01-Jun-2031	20.639	0,04	
10.000	American Water Capital Corp 2.800% 01-May-2030	8.697	0,02	
20.000	American Water Capital Corp 3.400% 01-Mar-2025	19.403	0,04	
5.000	American Water Capital Corp 3.450% 01-Jun-2029	4.588	0,01	
5.000	American Water Capital Corp 4.150% 01-Jun-2049	4.179	0,01	
5.000	AmerisourceBergen Corp 3.400% 15-May-2024	4.882	0,01	
15.000	Amgen Inc 1.900% 21-Feb-2025	14.094	0,03	
25.000	Amgen Inc 2.200% 21-Feb-2027	22.498	0,05	
10.000	Amgen Inc 2.300% 25-Feb-2031	8.197	0,02	
25.000	Amgen Inc 2.450% 21-Feb-2030	21.148	0,05	
20.000	Amgen Inc 3.125% 01-May-2025	19.225	0,04	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
25.000	Amgen Inc 3.150% 21-Feb-2040	18.587	0,04
25.000	Amgen Inc 3.375% 21-Feb-2050	17.627	0,04
10.000	Amgen Inc 4.400% 01-May-2045	8.457	0,02
20.000	Amgen Inc 4.400% 22-Feb-2062	16.157	0,03
10.000	Amgen Inc 4.663% 15-Jun-2051	8.630	0,02
20.000	Amphenol Corp 2.200% 15-Sep-2031	15.951	0,03
5.000	Analog Devices Inc 3.500% 05-Dec-2026	4.784	0,01
30.000	Andrew W Mellon Foundation/The 0.947% 01-Aug-2027	25.655	0,06
35.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.500% 15-Mar-2028	33.221	0,07
5.000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14-May-2025	4.916	0,01
35.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.650% 01-Feb-2026	33.751	0,07
15.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.700% 01-Feb-2036	14.264	0,03
60.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.900% 01-Feb-2046	55.299	0,12
50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.500% 01-Jun-2030	45.773	0,10
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.350% 01-Jun-2040	4.437	0,01
10.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.439% 06-Oct-2048	8.651	0,02
8.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.600% 15-Apr-2048	7.049	0,02
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.900% 23-Jan-2031	20.123	0,04
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.950% 15-Jan-2042	18.971	0,04
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.450% 23-Jan-2039	20.150	0,04
25.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.550% 23-Jan-2049	25.090	0,05
5.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.800% 23-Jan-2059	5.227	0,01
20.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 8.200% 15-Jan-2039	25.061	0,05
10.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 17-Jul-2027	9.305	0,02
5.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 21-Jan-2028	4.604	0,01
5.000	Aon Corp 8.205% 01-Jan-2027	5.155	0,01
25.000	Aon Corp / Aon Global Holdings Plc 3.900% 28-Feb-2052	19.363	0,04
25.000	Aon Global Ltd 3.875% 15-Dec-2025	24.424	0,05
10.000	AP Moller - Maersk A/S '144A' 4.500% 20-Jun-2029	9.541	0,02
15.000	APA Infrastructure Ltd '144A' 4.200% 23-Mar-2025	14.506	0,03
5.000	Apollo Management Holdings LP '144A' 2.650% 05-Jun-2030	4.085	0,01
5.000	Appalachian Power Co 3.300% 01-Jun-2027	4.696	0,01
10.000	Apple Inc 0.700% 08-Feb-2026	8.896	0,02
5.000	Apple Inc 1.650% 08-Feb-2031	4.047	0,01
40.000	Apple Inc 1.700% 05-Aug-2031	32.194	0,07
30.000	Apple Inc 2.375% 08-Feb-2041	21.390	0,05
5.000	Apple Inc 2.550% 20-Aug-2060	3.082	0,01
20.000	Apple Inc 2.750% 13-Jan-2025	19.287	0,04
5.000	Apple Inc 2.800% 08-Feb-2061	3.219	0,01
5.000	Apple Inc 3.000% 13-Nov-2027	4.683	0,01
10.000	Apple Inc 3.200% 13-May-2025	9.679	0,02
5.000	Apple Inc 3.200% 11-May-2027	4.754	0,01
60.000	Apple Inc 3.250% 23-Feb-2026	57.754	0,12
20.000	Apple Inc 3.350% 09-Feb-2027	19.190	0,04
20.000	Apple Inc 3.350% 08-Aug-2032	18.312	0,04
10.000	Apple Inc 4.100% 08-Aug-2062	8.440	0,02
15.000	Aptiv Plc 4.350% 15-Mar-2029	13.952	0,03
20.000	Aptiv Plc / Aptiv Corp 4.150% 01-May-2052	14.583	0,03
10.000	Aquarion Co '144A' 4.000% 15-Aug-2024	9.832	0,02
10.000	Arch Capital Group Ltd 7.350% 01-May-2034	11.134	0,02
10.000	Archer-Daniels-Midland Co 2.700% 15-Sep-2051	6.726	0,01
10.000	Ares Capital Corp 2.875% 15-Jun-2028	8.048	0,02
20.000	Ares Capital Corp 3.875% 15-Jan-2026	18.371	0,04
10.000	Ares Capital Corp 4.250% 01-Mar-2025	9.493	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Ares Finance Co III LLC '144A' FRN 4.125% 30-Jun-2051	7.560	0,02
25.000	ASB Bank Ltd '144A' FRN 5.284% 17-Jun-2032	23.631	0,05
10.000	Ascension Health 4.847% 15-Nov-2053	9.609	0,02
20.000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.250% 01-Nov-2029	18.090	0,04
20.000	Assured Guaranty US Holdings Inc 3.600% 15-Sep-2051	13.199	0,03
20.000	Astrazeneca Finance LLC 1.200% 28-May-2026	17.852	0,04
10.000	Astrazeneca Finance LLC 2.250% 28-May-2031	8.374	0,02
10.000	AstraZeneca Plc 2.125% 06-Aug-2050	5.955	0,01
10.000	AstraZeneca Plc 3.125% 12-Jun-2027	9.422	0,02
15.000	AstraZeneca Plc 3.375% 16-Nov-2025	14.505	0,03
10.000	AstraZeneca Plc 6.450% 15-Sep-2037	11.407	0,02
15.000	AT&T Inc 1.650% 01-Feb-2028	12.716	0,03
15.000	AT&T Inc 1.700% 25-Mar-2026	13.557	0,03
25.000	AT&T Inc 2.250% 01-Feb-2032	19.734	0,04
25.000	AT&T Inc 2.300% 01-Jun-2027	22.317	0,05
30.000	AT&T Inc 2.550% 01-Dec-2033	23.233	0,05
10.000	AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031	8.339	0,02
25.000	AT&T Inc 3.300% 01-Feb-2052	16.866	0,04
15.000	AT&T Inc 3.500% 01-Jun-2041	11.322	0,02
33.000	AT&T Inc 3.500% 15-Sep-2053	22.403	0,05
17.000	AT&T Inc 3.550% 15-Sep-2055	11.472	0,02
15.000	AT&T Inc 3.650% 01-Jun-2051	10.707	0,02
37.000	AT&T Inc 3.650% 15-Sep-2059	25.064	0,05
20.000	AT&T Inc 3.800% 01-Dec-2057	14.003	0,03
15.000	AT&T Inc 4.100% 15-Feb-2028	14.348	0,03
5.000	AT&T Inc 4.250% 01-Mar-2027	4.878	0,01
15.000	AT&T Inc 4.300% 15-Feb-2030	14.206	0,03
5.000	AT&T Inc 4.300% 15-Dec-2042	4.147	0,01
15.000	AT&T Inc 4.350% 01-Mar-2029	14.354	0,03
5.000	AT&T Inc 4.350% 15-Jun-2045	4.080	0,01
5.000	AT&T Inc 4.500% 15-May-2035	4.571	0,01
5.000	AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048	4.111	0,01
5.000	AT&T Inc 4.550% 09-Mar-2049	4.155	0,01
38.000	AT&T Inc 4.650% 01-Jun-2044	32.257	0,07
10.000	AT&T Inc 4.750% 15-May-2046	8.557	0,02
10.000	AT&T Inc 5.350% 01-Sep-2040	9.628	0,02
20.000	Athene Global Funding '144A' 2.514% 08-Mar-2024	19.178	0,04
20.000	Athene Global Funding '144A' 2.750% 25-Jun-2024	19.042	0,04
20.000	Athene Holding Ltd 3.450% 15-May-2052	12.449	0,03
10.000	Athene Holding Ltd 3.500% 15-Jan-2031	8.288	0,02
9.410	Atlantica Transmission Sur SA 'REGS' 6.875% 30-Apr-2043	8.540	0,02
10.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' 4.400% 19-May-2026	9.624	0,02
20.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 2.570% 25-Nov-2035	14.770	0,03
20.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 'MTN' 3.700% 16-Nov-2025	19.453	0,04
10.000	Automatic Data Processing Inc 1.250% 01-Sep-2030	7.864	0,02
25.000	AutoNation Inc 3.500% 15-Nov-2024	24.023	0,05
15.000	AutoZone Inc 3.125% 18-Apr-2024	14.605	0,03
45.000	AvalonBay Communities Inc 'GMTN' 3.450% 01-Jun-2025	43.409	0,09
10.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN' 3.200% 15-Jan-2028	9.175	0,02
15.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 4.375% 30-Jan-2024	14.634	0,03
15.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 4.875% 01-Oct-2025	14.164	0,03
15.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.528% 18-Nov-2027	12.031	0,03
20.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.875% 15-Feb-2025	18.482	0,04
25.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	22.697	0,05
20.000	AXA SA 8.600% 15-Dec-2030	24.182	0,05
10.000	Bacardi Ltd 'REGS' 5.150% 15-May-2038	9.125	0,02
30.000	BAE Systems Holdings Inc '144A' 3.800% 07-Oct-2024	29.328	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	BAE Systems Holdings Inc '144A' 3.850% 15-Dec-2025	19.322	0,04
20.000	BAE Systems Plc '144A' 3.400% 15-Apr-2030	17.737	0,04
5.000	Baker Hughes Holdings LLC 5.125% 15-Sep-2040	4.652	0,01
5.000	Baltimore Gas and Electric Co 4.550% 01-Jun-2052	4.483	0,01
20.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN 3.125% 01-Jul-2030	18.135	0,04
10.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN 3.250% 30-Sep-2031	8.806	0,02
10.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS' 2.875% 14-Oct-2031	8.333	0,02
10.000	Banco Inbursa SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 'REGS' 4.125% 06-Jun-2024	9.787	0,02
10.000	Banco Inbursa SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 'REGS' 4.375% 11-Apr-2027	9.442	0,02
10.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' 3.250% 04-Oct-2026	9.132	0,02
10.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	9.917	0,02
20.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong '144A' 9.025% 15-Mar-2029	22.240	0,05
15.000	Bank of America Corp 3.950% 21-Apr-2025	14.622	0,03
5.000	Bank of America Corp 4.183% 25-Nov-2027	4.758	0,01
35.000	Bank of America Corp 6.110% 29-Jan-2037	35.632	0,08
20.000	Bank of America Corp FRN 0.976% 22-Apr-2025	18.768	0,04
30.000	Bank of America Corp FRN 1.734% 22-Jul-2027	26.336	0,06
20.000	Bank of America Corp FRN 1.843% 04-Feb-2025	19.173	0,04
35.000	Bank of America Corp FRN 2.482% 21-Sep-2036	25.885	0,06
30.000	Bank of America Corp FRN 2.687% 22-Apr-2032	24.162	0,05
50.000	Bank of America Corp FRN 2.972% 04-Feb-2033	40.567	0,09
10.000	Bank of America Corp FRN 2.972% 21-Jul-2052	6.341	0,01
10.000	Bank of America Corp FRN 3.311% 22-Apr-2042	7.423	0,02
5.000	Bank of America Corp FRN 3.366% 23-Jan-2026	4.782	0,01
20.000	Bank of America Corp FRN 3.419% 20-Dec-2028	18.146	0,04
5.000	Bank of America Corp FRN 3.705% 24-Apr-2028	4.641	0,01
50.000	Bank of America Corp FRN 3.841% 25-Apr-2025	48.890	0,10
20.000	Bank of America Corp FRN 3.846% 08-Mar-2037	16.665	0,04
15.000	Bank of America Corp FRN 4.376% 27-Apr-2028	14.389	0,03
30.000	Bank of America Corp FRN 4.571% 27-Apr-2033	27.639	0,06
20.000	Bank of America Corp FRN 5.015% 22-Jul-2033	19.112	0,04
5.000	Bank of America Corp 'GMTN' FRN 3.593% 21-Jul-2028	4.618	0,01
35.000	Bank of America Corp 'MTN' 3.248% 21-Oct-2027	32.406	0,07
15.000	Bank of America Corp 'MTN' 3.875% 01-Aug-2025	14.629	0,03
20.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.000% 22-Jan-2025	19.602	0,04
10.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.200% 26-Aug-2024	9.857	0,02
5.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.250% 22-Oct-2026	4.843	0,01
15.000	Bank of America Corp 'MTN' 4.450% 03-Mar-2026	14.728	0,03
25.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 1.319% 19-Jun-2026	22.581	0,05
75.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.456% 22-Oct-2025	70.950	0,15
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031	4.086	0,01
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.676% 19-Jun-2041	10.214	0,02
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.384% 02-Apr-2026	19.133	0,04
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.458% 15-Mar-2025	9.749	0,02
30.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.559% 23-Apr-2027	28.177	0,06
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.824% 20-Jan-2028	4.678	0,01
5.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.970% 05-Mar-2029	4.630	0,01
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.974% 07-Feb-2030	13.686	0,03
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.078% 23-Apr-2040	8.379	0,02
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029	18.722	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Bank of Ireland Group Plc '144A' FRN 6.253% 16-Sep-2026	9.927	0,02
10.000	Bank of Montreal 3.300% 05-Feb-2024	9.820	0,02
20.000	Bank of Montreal FRN 3.803% 15-Dec-2032	17.671	0,04
5.000	Bank of Montreal 'MTN' 1.250% 15-Sep-2026	4.381	0,01
5.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.500% 28-Jun-2024	4.820	0,01
10.000	Bank of Montreal 'MTN' 2.650% 08-Mar-2027	9.161	0,02
5.000	Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027	4.409	0,01
10.000	Bank of New Zealand '144A' 2.285% 27-Jan-2027	8.932	0,02
15.000	Bank of Nova Scotia/The 1.050% 02-Mar-2026	13.295	0,03
15.000	Bank of Nova Scotia/The 1.300% 11-Jun-2025	13.768	0,03
15.000	Bank of Nova Scotia/The 1.950% 02-Feb-2027	13.393	0,03
35.000	Bank of Nova Scotia/The 3.400% 11-Feb-2024	34.446	0,07
20.000	Bank of Nova Scotia/The 3.450% 11-Apr-2025	19.279	0,04
10.000	Bank of Nova Scotia/The 4.500% 16-Dec-2025	9.821	0,02
10.000	Banner Health 2.913% 01-Jan-2051	6.675	0,01
10.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 0.998% 04-Feb-2025	9.151	0,02
85.000	Barclays Plc 3.650% 16-Mar-2025	81.784	0,18
25.000	Barclays Plc 4.375% 12-Jan-2026	24.246	0,05
10.000	Barclays Plc 4.836% 09-May-2028	9.254	0,02
20.000	Barclays Plc 4.950% 10-Jan-2047	17.234	0,04
10.000	Barclays Plc 5.200% 12-May-2026	9.746	0,02
20.000	Barclays Plc 5.250% 17-Aug-2045	18.110	0,04
10.000	Barclays Plc FRN 3.564% 23-Sep-2035	7.666	0,02
10.000	Barclays Plc FRN 5.088% 20-Jun-2030	9.254	0,02
10.000	Barclays Plc FRN 5.501% 09-Aug-2028	9.717	0,02
15.000	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd 5.950% 15-Oct-2039	15.486	0,03
10.000	BAT Capital Corp 3.215% 06-Sep-2026	9.250	0,02
30.000	BAT Capital Corp 3.222% 15-Aug-2024	28.916	0,06
10.000	BAT Capital Corp 3.462% 06-Sep-2029	8.612	0,02
15.000	BAT Capital Corp 3.557% 15-Aug-2027	13.727	0,03
10.000	BAT Capital Corp 3.734% 25-Sep-2040	6.874	0,01
5.000	BAT Capital Corp 3.984% 25-Sep-2050	3.314	0,01
10.000	BAT Capital Corp 4.390% 15-Aug-2037	7.842	0,02
15.000	BAT Capital Corp 4.540% 15-Aug-2047	10.729	0,02
35.000	BAT Capital Corp 4.758% 06-Sep-2049	25.666	0,06
10.000	BAT Capital Corp 4.906% 02-Apr-2030	9.201	0,02
5.000	BAT International Finance Plc 1.668% 25-Mar-2026	4.436	0,01
40.000	BAT International Finance Plc '144A' 3.950% 15-Jun-2025	38.481	0,08
10.000	Baxter International Inc 1.915% 01-Feb-2027	8.891	0,02
40.000	Baxter International Inc 2.600% 15-Aug-2026	37.043	0,08
25.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.250% 15-Dec-2025	24.277	0,05
15.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.375% 15-Dec-2028	14.172	0,03
10.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.875% 25-Jun-2048	8.740	0,02
10.000	Bayer US Finance LLC '144A' 3.375% 08-Oct-2024	9.674	0,02
10.000	Becton Dickinson and Co 3.363% 06-Jun-2024	9.778	0,02
20.000	Becton Dickinson and Co 3.734% 15-Dec-2024	19.513	0,04
10.000	Becton Dickinson and Co 4.669% 06-Jun-2047	8.909	0,02
15.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 3.200% 15-Feb-2052	10.196	0,02
15.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 3.650% 15-Aug-2052	11.077	0,02
10.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4.464% 01-Apr-2048	8.624	0,02
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.500% 01-Feb-2025	9.824	0,02
5.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3.700% 15-Jul-2030	4.606	0,01
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 01-Apr-2036	10.575	0,02
40.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.450% 15-Oct-2030	32.010	0,07
5.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.850% 12-Mar-2030	4.213	0,01
5.000	Berkshire Hathaway Inc 3.125% 15-Mar-2026	4.803	0,01
20.000	Berry Global Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2026	19.273	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	BG Energy Capital Plc '144A' 5.125% 15-Oct-2041	4.728	0,01
15.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS' 4.375% 10-Jun-2025	14.599	0,03
50.000	BHP Billiton Finance USA Ltd 6.420% 01-Mar-2026	52.309	0,11
10.000	Bimbo Bakeries USA Inc 'REGS' 4.000% 17-May-2051	7.599	0,02
20.000	Biogen Inc 2.250% 01-May-2030	16.344	0,04
20.000	Biogen Inc 3.250% 15-Feb-2051	13.584	0,03
10.000	Biogen Inc 4.050% 15-Sep-2025	9.740	0,02
25.000	Black Hills Corp 1.037% 23-Aug-2024	23.341	0,05
5.000	Black Hills Corp 3.050% 15-Oct-2029	4.264	0,01
10.000	Black Hills Corp 3.150% 15-Jan-2027	9.277	0,02
5.000	BlackRock Inc 2.400% 30-Apr-2030	4.288	0,01
25.000	BlackRock Inc 3.200% 15-Mar-2027	23.700	0,05
20.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A' 1.625% 05-Aug-2028	16.347	0,04
30.000	Blackstone Private Credit Fund 4.000% 15-Jan-2029	24.854	0,05
15.000	Blackstone Secured Lending Fund 2.750% 16-Sep-2026	13.217	0,03
20.000	Blackstone Secured Lending Fund 3.625% 15-Jan-2026	18.426	0,04
10.000	BMW US Capital LLC '144A' 1.950% 12-Aug-2031	7.865	0,02
25.000	BMW US Capital LLC '144A' 3.250% 01-Apr-2025	24.166	0,05
10.000	BMW US Capital LLC '144A' 3.900% 09-Apr-2025	9.800	0,02
10.000	BMW US Capital LLC '144A' 4.150% 09-Apr-2030	9.551	0,02
20.000	BNP Paribas SA '144A' 2.824% 26-Jan-2041	12.414	0,03
20.000	BNP Paribas SA '144A' 3.375% 09-Jan-2025	19.274	0,04
5.000	BNP Paribas SA '144A' 3.800% 10-Jan-2024	4.916	0,01
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 1.323% 13-Jan-2027	4.374	0,01
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.219% 09-Jun-2026	4.599	0,01
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.591% 20-Jan-2028	4.411	0,01
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 2.819% 19-Nov-2025	4.742	0,01
25.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 3.132% 20-Jan-2033	19.870	0,04
5.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 4.705% 10-Jan-2025	4.953	0,01
15.000	BNP Paribas SA '144A' FRN 5.198% 10-Jan-2030	14.318	0,03
20.000	BNSF Funding Trust I FRN 6.613% 15-Dec-2055	18.926	0,04
10.000	Boardwalk Pipelines LP 4.450% 15-Jul-2027	9.541	0,02
50.000	Boeing Co/The 1.433% 04-Feb-2024	47.789	0,10
20.000	Boeing Co/The 1.950% 01-Feb-2024	19.281	0,04
70.000	Boeing Co/The 2.800% 01-Mar-2024	67.931	0,15
5.000	Boeing Co/The 3.200% 01-Mar-2029	4.412	0,01
5.000	Boeing Co/The 3.625% 01-Feb-2031	4.414	0,01
30.000	Boeing Co/The 3.825% 01-Mar-2059	19.410	0,04
10.000	Boeing Co/The 5.705% 01-May-2040	9.579	0,02
35.000	Boeing Co/The 5.805% 01-May-2050	32.766	0,07
10.000	Boeing Co/The 5.930% 01-May-2060	9.223	0,02
25.000	Boeing Co/The 6.125% 15-Feb-2033	25.558	0,05
10.000	Boeing Co/The 6.625% 15-Feb-2038	10.338	0,02
10.000	Booking Holdings Inc 4.625% 13-Apr-2030	9.707	0,02
10.000	BorgWarner Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2025	9.817	0,02
10.000	Boston Properties LP 3.200% 15-Jan-2025	9.579	0,02
20.000	Boston Properties LP 3.250% 30-Jan-2031	16.633	0,04
25.000	Boston Properties LP 3.800% 01-Feb-2024	24.571	0,05
8.000	Boston Scientific Corp 4.550% 01-Mar-2039	7.254	0,02
2.000	Boston Scientific Corp 4.700% 01-Mar-2049	1.811	0,00
20.000	BP Capital Markets America Inc 2.721% 12-Jan-2032	16.869	0,04
25.000	BP Capital Markets America Inc 3.060% 17-Jun-2041	18.716	0,04
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.119% 04-May-2026	4.751	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.379% 08-Feb-2061	3.475	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.410% 11-Feb-2026	4.811	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.633% 06-Apr-2030	4.610	0,01
5.000	BP Capital Markets America Inc 3.937% 21-Sep-2028	4.793	0,01
10.000	BP Capital Markets America Inc 4.234% 06-Nov-2028	9.729	0,02
5.000	BP Capital Markets Plc 3.279% 19-Sep-2027	4.717	0,01
30.000	BPCE SA 4.000% 15-Apr-2024	29.518	0,06

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	BPCE SA '144A' 1.000% 20-Jan-2026	4.393	0,01
30.000	BPCE SA '144A' 2.700% 01-Oct-2029	25.204	0,05
20.000	BPCE SA '144A' 3.250% 11-Jan-2028	18.003	0,04
5.000	BPCE SA '144A' 3.500% 23-Oct-2027	4.510	0,01
20.000	BPCE SA '144A' 4.500% 15-Mar-2025	19.240	0,04
10.000	BPCE SA '144A' 5.150% 21-Jul-2024	9.798	0,02
5.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 10-Jan-2028	4.495	0,01
20.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030	17.072	0,04
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 2.900% 26-Jul-2024	9.717	0,02
25.000	Bristol-Myers Squibb Co 2.950% 15-Mar-2032	21.949	0,05
25.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.250% 01-Aug-2042	19.316	0,04
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.400% 26-Jul-2029	9.316	0,02
5.000	Bristol-Myers Squibb Co 3.900% 15-Mar-2062	3.926	0,01
10.000	Bristol-Myers Squibb Co 4.125% 15-Jun-2039	8.993	0,02
15.000	British Telecommunications Plc 9.625% 15-Dec-2030	18.054	0,04
5.000	British Telecommunications Plc '144A' 3.250% 08-Nov-2029	4.282	0,01
10.000	Brixmor Operating Partnership LP 3.650% 15-Jun-2024	9.702	0,02
25.000	Brixmor Operating Partnership LP 4.125% 15-Jun-2026	23.753	0,05
15.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15-Jan-2027	14.213	0,03
45.000	Broadcom Inc 3.459% 15-Sep-2026	42.509	0,09
10.000	Broadcom Inc 4.300% 15-Nov-2032	8.875	0,02
35.000	Broadcom Inc 4.750% 15-Apr-2029	33.481	0,07
10.000	Broadcom Inc '144A' 1.950% 15-Feb-2028	8.473	0,02
10.000	Broadcom Inc '144A' 2.450% 15-Feb-2031	7.927	0,02
10.000	Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033	7.564	0,02
10.000	Broadcom Inc '144A' 3.137% 15-Nov-2035	7.417	0,02
10.000	Broadcom Inc '144A' 3.187% 15-Nov-2036	7.237	0,02
25.000	Broadcom Inc '144A' 3.419% 15-Apr-2033	20.181	0,04
15.000	Broadcom Inc '144A' 3.469% 15-Apr-2034	12.065	0,03
15.000	Broadcom Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2041	10.838	0,02
5.000	Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051	3.527	0,01
15.000	Broadcom Inc '144A' 4.926% 15-May-2037	13.175	0,03
20.000	Brookfield Finance Inc 4.000% 01-Apr-2024	19.706	0,04
5.000	Brooklyn Union Gas Co/The '144A' 3.407% 10-Mar-2026	4.698	0,01
15.000	Brooklyn Union Gas Co/The '144A' 4.504% 10-Mar-2046	12.103	0,03
20.000	Brooklyn Union Gas Co/The '144A' 4.632% 05-Aug-2027	19.141	0,04
45.000	Brown & Brown Inc 2.375% 15-Mar-2031	34.535	0,07
5.000	Brown & Brown Inc 4.200% 15-Sep-2024	4.912	0,01
5.000	Brown-Forman Corp 3.500% 15-Apr-2025	4.893	0,01
10.000	Bunge Ltd Finance Corp 1.630% 17-Aug-2025	9.129	0,02
15.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.250% 15-Jun-2027	14.228	0,03
5.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.750% 01-Apr-2024	4.924	0,01
15.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 6.150% 01-May-2037	16.392	0,04
15.000	Cabot Corp 4.000% 01-Jul-2029	13.484	0,03
5.000	Camden Property Trust 2.800% 15-May-2030	4.325	0,01
10.000	Cameron LNG LLC '144A' 3.302% 15-Jan-2035	8.127	0,02
10.000	Campbell Soup Co 3.300% 19-Mar-2025	9.633	0,02
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.250% 28-Jan-2025	18.903	0,04
35.000	Canadian National Railway Co 2.750% 01-Mar-2026	33.078	0,07
15.000	Canadian National Railway Co 2.950% 21-Nov-2024	14.480	0,03
10.000	Canadian National Railway Co 6.900% 15-Jul-2028	11.033	0,02
5.000	Canadian Natural Resources Ltd 3.850% 01-Jun-2027	4.728	0,01
10.000	Canadian Natural Resources Ltd 'GMTN' 4.950% 01-Jun-2047	8.784	0,02
10.000	Canadian Pacific Railway Co 1.350% 02-Dec-2024	9.335	0,02
20.000	Canadian Pacific Railway Co 2.900% 01-Feb-2025	19.137	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
15.000	Canadian Pacific Railway Co 6.125% 15-Sep-2115	15.282	0,03
10.000	Capital One Financial Corp 3.200% 05-Feb-2025	9.628	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 3.300% 30-Oct-2024	9.663	0,02
5.000	Capital One Financial Corp 3.750% 24-Apr-2024	4.907	0,01
10.000	Capital One Financial Corp 3.750% 28-Jul-2026	9.439	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 3.750% 09-Mar-2027	9.485	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 3.800% 31-Jan-2028	9.381	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 3.900% 29-Jan-2024	9.882	0,02
10.000	Capital One Financial Corp 4.200% 29-Oct-2025	9.682	0,02
10.000	Capital One Financial Corp FRN 2.636% 03-Mar-2026	9.381	0,02
20.000	Capital One Financial Corp FRN 3.273% 01-Mar-2030	17.175	0,04
15.000	Capital One Financial Corp FRN 4.927% 10-May-2028	14.550	0,03
20.000	Capital One Financial Corp FRN 4.985% 24-Jul-2026	19.623	0,04
10.000	Cardinal Health Inc 3.750% 15-Sep-2025	9.694	0,02
5.000	Cargill Inc '144A' 2.125% 23-Apr-2030	4.141	0,01
20.000	Cargill Inc '144A' 3.625% 22-Apr-2027	19.169	0,04
20.000	Cargill Inc '144A' 4.000% 22-Jun-2032	18.555	0,04
5.000	Carlisle Cos Inc 2.750% 01-Mar-2030	4.187	0,01
15.000	Carlisle Cos Inc 3.500% 01-Dec-2024	14.514	0,03
2.000	Carrier Global Corp 2.242% 15-Feb-2025	1.887	0,00
5.000	Carrier Global Corp 2.700% 15-Feb-2031	4.153	0,01
5.000	Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030	4.230	0,01
10.000	Carrier Global Corp 3.377% 05-Apr-2040	7.673	0,02
5.000	Carrier Global Corp 3.577% 05-Apr-2050	3.613	0,01
25.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN' 3.400% 13-May-2025	24.345	0,05
20.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN' 3.600% 12-Aug-2027	19.147	0,04
2.000	Caterpillar Inc 2.600% 09-Apr-2030	1.747	0,00
5.000	Caterpillar Inc 3.803% 15-Aug-2042	4.310	0,01
15.000	Caterpillar Inc 5.200% 27-May-2041	15.421	0,03
50.000	Choe Global Markets Inc 3.650% 12-Jan-2027	47.885	0,10
10.000	CCL Industries Inc '144A' 3.050% 01-Jun-2030	8.283	0,02
20.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 2.670% 01-Dec-2026	17.794	0,04
10.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 3.250% 15-Feb-2029	8.535	0,02
5.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 4.125% 01-May-2025	4.864	0,01
50.000	Celanese US Holdings LLC 5.900% 05-Jul-2024	50.034	0,11
20.000	Celanese US Holdings LLC 6.330% 15-Jul-2029	19.516	0,04
10.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 3.875% 02-Nov-2027	9.375	0,02
5.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 5.500% 02-Nov-2047	4.467	0,01
5.000	Cencosud SA 'REGS' 6.625% 12-Feb-2045	4.875	0,01
5.000	Cenovus Energy Inc 3.750% 15-Feb-2052	3.559	0,01
10.000	Cenovus Energy Inc 5.400% 15-Jun-2047	9.077	0,02
15.000	Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028	12.677	0,03
15.000	Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031	11.766	0,03
15.000	Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030	12.330	0,03
10.000	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	8.476	0,02
10.000	Centene Corp 4.250% 15-Dec-2027	9.410	0,02
15.000	Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	13.747	0,03
30.000	CenterPoint Energy Resources Corp 1.750% 01-Oct-2030	23.799	0,05
20.000	CF Industries Inc 4.950% 01-Jun-2043	17.262	0,04
15.000	CGI Inc 1.450% 14-Sep-2026	13.302	0,03
5.000	CH Robinson Worldwide Inc 4.200% 15-Apr-2028	4.739	0,01
10.000	Charles Schwab Corp/The 1.950% 01-Dec-2031	7.875	0,02
20.000	Charles Schwab Corp/The 2.300% 13-May-2031	16.458	0,04
10.000	Charles Schwab Corp/The 2.450% 03-Mar-2027	9.146	0,02
10.000	Charles Schwab Corp/The 3.200% 25-Jan-2028	9.351	0,02
20.000	Charles Schwab Corp/The 3.625% 01-Apr-2025	19.501	0,04
45.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.300% 01-Feb-2032	33.352	0,07
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.800% 01-Apr-2031	7.831	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
25.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.400% 01-Dec-2061	16.182	0,03
5.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.500% 01-Feb-2024	4.945	0,01
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.800% 01-Mar-2050	7.319	0,02
15.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23-Jul-2025	14.728	0,03
20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.125% 01-Jul-2049	15.291	0,03
15.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.250% 01-Apr-2053	11.719	0,03
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 01-May-2047	7.926	0,02
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.750% 01-Apr-2048	8.286	0,02
10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.384% 23-Oct-2035	9.823	0,02
40.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 23-Oct-2045	36.397	0,08
10.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3.700% 15-Nov-2029	9.079	0,02
15.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30-Jun-2027	14.864	0,03
10.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31-Mar-2025	10.064	0,02
15.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.000% 30-Jun-2024	15.196	0,03
10.000	Chevron Corp 1.554% 11-May-2025	9.320	0,02
50.000	Chevron Corp 1.995% 11-May-2027	45.050	0,10
20.000	Chevron Corp 2.236% 11-May-2030	17.227	0,04
5.000	Chevron Corp 3.326% 17-Nov-2025	4.845	0,01
5.000	Chevron Phillips Chemical Co LLC / Chevron Phillips Chemical Co LP '144A' 5.125% 01-Apr-2025	5.000	0,01
5.000	Chevron USA Inc 6.000% 01-Mar-2041	5.521	0,01
10.000	Choice Hotels International Inc 3.700% 15-Jan-2031	8.521	0,02
10.000	Chubb INA Holdings Inc 3.350% 03-May-2026	9.588	0,02
20.000	CI Financial Corp 3.200% 17-Dec-2030	15.259	0,03
30.000	Cigna Corp 2.375% 15-Mar-2031	24.705	0,05
10.000	Cigna Corp 2.400% 15-Mar-2030	8.417	0,02
5.000	Cigna Corp 3.400% 01-Mar-2027	4.705	0,01
5.000	Cigna Corp 3.875% 15-Oct-2047	3.928	0,01
20.000	Cigna Corp 4.125% 15-Nov-2025	19.576	0,04
15.000	Cigna Corp 4.375% 15-Oct-2028	14.525	0,03
15.000	Cigna Corp 4.800% 15-Aug-2038	14.027	0,03
10.000	Cigna Corp 4.800% 15-Jul-2046	9.080	0,02
10.000	Cigna Corp 4.900% 15-Dec-2048	9.130	0,02
55.000	Cintas Corp No 2 3.700% 01-Apr-2027	53.180	0,11
5.000	Cisco Systems Inc 5.500% 15-Jan-2040	5.267	0,01
10.000	Cisco Systems Inc 5.900% 15-Feb-2039	10.837	0,02
20.000	Citadel Finance LLC '144A' 3.375% 09-Mar-2026	17.870	0,04
10.000	Citigroup Inc 3.200% 21-Oct-2026	9.275	0,02
20.000	Citigroup Inc 3.300% 27-Apr-2025	19.398	0,04
10.000	Citigroup Inc 4.125% 25-Jul-2028	9.345	0,02
20.000	Citigroup Inc 4.400% 10-Jun-2025	19.665	0,04
20.000	Citigroup Inc 4.450% 29-Sep-2027	19.146	0,04
10.000	Citigroup Inc 4.600% 09-Mar-2026	9.854	0,02
5.000	Citigroup Inc 5.300% 06-May-2044	4.557	0,01
40.000	Citigroup Inc 6.125% 25-Aug-2036	40.395	0,09
5.000	Citigroup Inc 8.125% 15-Jul-2039	6.197	0,01
15.000	Citigroup Inc FRN 1.122% 28-Jan-2027	13.094	0,03
25.000	Citigroup Inc FRN 1.281% 03-Nov-2025	23.064	0,05
10.000	Citigroup Inc FRN 1.462% 09-Jun-2027	8.696	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 2.014% 25-Jan-2026	9.282	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Citigroup Inc FRN 2.520% 03-Nov-2032	15.615	0,03
15.000	Citigroup Inc FRN 2.561% 01-May-2032	11.917	0,03
10.000	Citigroup Inc FRN 2.572% 03-Jun-2031	8.134	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 2.666% 29-Jan-2031	8.247	0,02
5.000	Citigroup Inc FRN 2.976% 05-Nov-2030	4.226	0,01
10.000	Citigroup Inc FRN 3.070% 24-Feb-2028	9.042	0,02
20.000	Citigroup Inc FRN 3.106% 08-Apr-2026	18.929	0,04
10.000	Citigroup Inc FRN 3.352% 24-Apr-2025	9.694	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 3.520% 27-Oct-2028	9.155	0,02
10.000	Citigroup Inc FRN 3.668% 24-Jul-2028	9.222	0,02
25.000	Citigroup Inc FRN 3.785% 17-Mar-2033	21.527	0,05
10.000	Citigroup Inc FRN 3.887% 10-Jan-2028	9.376	0,02
20.000	Citigroup Inc FRN 3.980% 20-Mar-2030	18.123	0,04
10.000	Citigroup Inc FRN 4.075% 23-Apr-2029	9.236	0,02
40.000	Citigroup Inc FRN 4.140% 24-May-2025	39.243	0,08
10.000	Citigroup Inc FRN 4.412% 31-Mar-2031	9.232	0,02
20.000	Citigroup Inc FRN 4.658% 24-May-2028	19.410	0,04
25.000	Citigroup Inc FRN 5.316% 26-Mar-2041	24.048	0,05
15.000	Citigroup Inc FRN 5.610% 29-Sep-2026	15.057	0,03
20.000	Citizens Bank NA/Providence RI 'BKNT' 2.250% 28-Apr-2025	18.662	0,04
5.000	CK Hutchison International 16 Ltd '144A' 2.750% 03-Oct-2026	4.643	0,01
20.000	CK Hutchison International 19 Ltd '144A' 3.625% 11-Apr-2029	18.549	0,04
20.000	CK Hutchison International 21 Ltd '144A' 3.125% 15-Apr-2041	14.822	0,03
10.000	Claremont Mckenna College 3.775% 01-Jan-2122	6.432	0,01
10.000	Cleveland Electric Illuminating Co/The 5.500% 15-Aug-2024	10.068	0,02
15.000	Cleveland Electric Illuminating Co/The 5.950% 15-Dec-2036	15.011	0,03
15.000	Clorox Co/The 3.900% 15-May-2028	14.351	0,03
20.000	Clorox Co/The 4.400% 01-May-2029	19.350	0,04
10.000	CME Group Inc 3.000% 15-Mar-2025	9.678	0,02
10.000	CMS Energy Corp FRN 4.750% 01-Jun-2050	8.675	0,02
25.000	CNH Industrial Capital LLC 4.200% 15-Jan-2024	24.658	0,05
10.000	Coca-Cola Co/The 1.650% 01-Jun-2030	8.230	0,02
5.000	Coca-Cola Co/The 2.125% 06-Sep-2029	4.298	0,01
10.000	Coca-Cola Co/The 2.250% 05-Jan-2032	8.415	0,02
10.000	Coca-Cola Co/The 2.500% 01-Jun-2040	7.375	0,02
10.000	Coca-Cola Co/The 2.900% 25-May-2027	9.436	0,02
20.000	Coca-Cola Co/The 3.375% 25-Mar-2027	19.243	0,04
5.000	Coca-Cola Co/The 3.450% 25-Mar-2030	4.663	0,01
20.000	Coca-Cola Femsas SAB de CV 2.750% 22-Jan-2030	17.272	0,04
10.000	Colgate-Palmolive Co 'MTN' 3.250% 15-Mar-2024	9.841	0,02
10.000	Columbia Pipeline Group Inc 4.500% 01-Jun-2025	9.863	0,02
10.000	Comcast Corp 1.500% 15-Feb-2031	7.832	0,02
10.000	Comcast Corp 1.950% 15-Jan-2031	8.127	0,02
5.000	Comcast Corp 2.650% 01-Feb-2030	4.354	0,01
35.000	Comcast Corp 2.937% 01-Nov-2056	21.974	0,05
10.000	Comcast Corp 2.987% 01-Nov-2063	6.155	0,01
30.000	Comcast Corp 3.150% 01-Mar-2026	28.630	0,06
20.000	Comcast Corp 3.150% 15-Feb-2028	18.520	0,04
5.000	Comcast Corp 3.250% 01-Nov-2039	3.936	0,01
25.000	Comcast Corp 3.300% 01-Feb-2027	23.628	0,05
25.000	Comcast Corp 3.375% 15-Aug-2025	24.159	0,05
10.000	Comcast Corp 3.700% 15-Apr-2024	9.856	0,02
5.000	Comcast Corp 3.750% 01-Apr-2040	4.168	0,01
5.000	Comcast Corp 3.900% 01-Mar-2038	4.350	0,01
10.000	Comcast Corp 3.950% 15-Oct-2025	9.813	0,02
5.000	Comcast Corp 4.049% 01-Nov-2052	4.010	0,01
10.000	Comcast Corp 4.150% 15-Oct-2028	9.628	0,02
10.000	Comcast Corp 4.200% 15-Aug-2034	9.302	0,02
5.000	Comcast Corp 4.250% 15-Oct-2030	4.809	0,01
20.000	Comcast Corp 4.250% 15-Jan-2033	18.939	0,04
10.000	Comcast Corp 4.600% 15-Oct-2038	9.325	0,02
5.000	Comcast Corp 4.950% 15-Oct-2058	4.590	0,01
5.000	Comcast Corp 5.650% 15-Jun-2035	5.280	0,01
5.000	Comcast Corp 6.950% 15-Aug-2037	5.759	0,01
60.000	Comerica Bank 'BKNT' 4.000% 27-Jul-2025	58.282	0,13

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
8.570	Cometa Energia SA de CV 'REGS' 6.375% 24-Apr-2035	8.221	0,02
10.000	CommonSpirit Health 2.760% 01-Oct-2024	9.599	0,02
10.000	CommonSpirit Health 6.073% 01-Nov-2027	10.258	0,02
5.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.625% 06-Sep-2026	4.620	0,01
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.688% 11-Mar-2031	7.732	0,02
5.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.150% 19-Sep-2027	4.637	0,01
15.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.743% 12-Sep-2039	11.109	0,02
20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.900% 16-Mar-2028	19.164	0,04
25.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 4.500% 09-Dec-2025	24.481	0,05
10.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' FRN 3.610% 12-Sep-2034	8.307	0,02
20.000	Commonwealth Edison Co 3.150% 15-Mar-2032	17.594	0,04
25.000	Conagra Brands Inc 1.375% 01-Nov-2027	20.898	0,04
20.000	Conagra Brands Inc 4.600% 01-Nov-2025	19.746	0,04
10.000	ConocoPhillips 6.500% 01-Feb-2039	11.346	0,02
5.000	ConocoPhillips Co 4.025% 15-Mar-2062	4.005	0,01
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 2.400% 15-Jun-2031	8.226	0,02
5.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.125% 15-Nov-2027	4.601	0,01
20.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 4.200% 15-Mar-2042	16.926	0,04
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 01-Dec-2039	9.856	0,02
5.000	Constellation Brands Inc 2.250% 01-Aug-2031	3.998	0,01
30.000	Constellation Brands Inc 3.700% 06-Dec-2026	28.617	0,06
20.000	Constellation Brands Inc 4.400% 15-Nov-2025	19.702	0,04
5.000	Constellation Energy Generation LLC 5.600% 15-Jun-2042	4.846	0,01
10.000	Constellation Energy Generation LLC 5.750% 01-Oct-2041	9.808	0,02
10.000	Constellation Energy Generation LLC 6.250% 01-Oct-2039	10.316	0,02
25.000	Consumers Energy Co 3.800% 15-Nov-2028	23.827	0,05
25.000	Continental Resources Inc/OK '144A' 5.750% 15-Jan-2031	23.329	0,05
15.000	Coöperatieve Rabobank UA 4.375% 04-Aug-2025	14.669	0,03
10.000	Coöperatieve Rabobank UA 5.250% 04-Aug-2045	9.094	0,02
15.000	Coöperatieve Rabobank UA 5.750% 01-Dec-2043	14.488	0,03
10.000	Coöperatieve Rabobank UA '144A' 2.625% 22-Jul-2024	9.601	0,02
20.000	Coöperatieve Rabobank UA '144A' FRN 1.106% 24-Feb-2027	17.513	0,04
10.000	Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 3.750% 21-Jul-2026	9.428	0,02
5.000	Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 5.250% 24-May-2041	5.054	0,01
50.000	Corebridge Financial Inc '144A' 3.900% 05-Apr-2032	44.147	0,09
20.000	Corebridge Global Funding '144A' 0.650% 17-Jun-2024	18.684	0,04
10.000	Corning Inc 5.450% 15-Nov-2079	8.749	0,02
10.000	Corning Inc 5.850% 15-Nov-2068	9.228	0,02
20.000	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV 'REGS' 3.625% 13-May-2031	16.085	0,03
25.000	Corporate Office Properties LP 2.900% 01-Dec-2033	17.875	0,04
8.000	Costco Wholesale Corp 1.600% 20-Apr-2030	6.586	0,01
10.000	Costco Wholesale Corp 1.750% 20-Apr-2032	7.973	0,02
10.000	Cox Communications Inc '144A' 2.600% 15-Jun-2031	8.014	0,02
10.000	Cox Communications Inc '144A' 3.500% 15-Aug-2027	9.315	0,02
10.000	Crane Holdings Co 4.200% 15-Mar-2048	7.157	0,02
5.000	Credit Agricole SA '144A' 3.250% 14-Jan-2030	4.103	0,01
15.000	Credit Agricole SA '144A' 4.375% 17-Mar-2025	14.502	0,03
10.000	Credit Agricole SA '144A' FRN 4.000% 10-Jan-2033	8.743	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Credit Agricole SA/London '144A' 2.375% 22-Jan-2025	18.893	0,04
20.000	Credit Agricole SA/London '144A' FRN 1.907% 16-Jun-2026	18.263	0,04
20.000	Credit Suisse AG/New York NY 1.250% 07-Aug-2026	16.226	0,03
5.000	Credit Suisse AG/New York NY 3.700% 21-Feb-2025	4.617	0,01
20.000	Credit Suisse AG/New York NY 'MTN' 3.625% 09-Sep-2024	18.669	0,04
25.000	Credit Suisse Group AG 3.750% 26-Mar-2025	22.536	0,05
10.000	Credit Suisse Group AG 4.550% 17-Apr-2026	8.840	0,02
15.000	Credit Suisse Group AG 4.875% 15-May-2045	10.365	0,02
5.000	Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028	4.158	0,01
15.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 1.305% 02-Feb-2027	12.018	0,03
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 2.593% 11-Sep-2025	8.850	0,02
15.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 3.091% 14-May-2032	10.440	0,02
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 3.869% 12-Jan-2029	8.043	0,02
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 4.194% 01-Apr-2031	7.803	0,02
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 6.373% 15-Jul-2026	9.405	0,02
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 6.442% 11-Aug-2028	9.135	0,02
10.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 6.537% 12-Aug-2033	8.826	0,02
10.000	CRH America Finance Inc '144A' 3.400% 09-May-2027	9.297	0,02
10.000	CRH America Inc '144A' 3.875% 18-May-2025	9.663	0,02
10.000	Crown Castle Inc 1.050% 15-Jul-2026	8.663	0,02
15.000	Crown Castle Inc 2.100% 01-Apr-2031	11.884	0,03
20.000	Crown Castle Inc 2.900% 15-Mar-2027	18.258	0,04
10.000	Crown Castle Inc 3.200% 01-Sep-2024	9.667	0,02
15.000	Crown Castle Inc 4.150% 01-Jul-2050	11.783	0,03
5.000	Crown Castle Inc 4.300% 15-Feb-2029	4.744	0,01
5.000	Crown Castle Inc 4.450% 15-Feb-2026	4.898	0,01
20.000	CSL Finance Plc '144A' 4.050% 27-Apr-2029	18.936	0,04
10.000	CSL Finance Plc '144A' 4.250% 27-Apr-2032	9.478	0,02
30.000	CSX Corp 2.500% 15-May-2051	18.513	0,04
5.000	CSX Corp 4.250% 01-Nov-2066	3.984	0,01
20.000	CSX Corp 4.650% 01-Mar-2068	17.126	0,04
5.000	CSX Corp 4.750% 15-Nov-2048	4.576	0,01
10.000	CSX Corp 6.000 % 01-Oct-2036	10.585	0,02
10.000	CSX Corp 6.220% 30-Apr-2040	10.917	0,02
10.000	CubeSmart LP 2.500% 15-Feb-2032	7.697	0,02
40.000	Cummins Inc 1.500% 01-Sep-2030	31.543	0,07
20.000	CVS Health Corp 1.300% 21-Aug-2027	16.986	0,04
5.000	CVS Health Corp 1.750% 21-Aug-2030	3.965	0,01
20.000	CVS Health Corp 1.875% 28-Feb-2031	15.796	0,03
20.000	CVS Health Corp 2.625% 15-Aug-2024	19.225	0,04
10.000	CVS Health Corp 2.875% 01-Jun-2026	9.359	0,02
15.000	CVS Health Corp 3.250% 15-Aug-2029	13.487	0,03
5.000	CVS Health Corp 3.750% 01-Apr-2030	4.569	0,01
20.000	CVS Health Corp 3.875% 20-Jul-2025	19.551	0,04
25.000	CVS Health Corp 4.250% 01-Apr-2050	20.166	0,04
20.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	19.415	0,04
30.000	CVS Health Corp 4.780% 25-Mar-2038	27.546	0,06
25.000	CVS Health Corp 5.050% 25-Mar-2048	22.681	0,05
20.000	CVS Health Corp 5.125% 20-Jul-2045	18.245	0,04
20.000	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The '144A' FRN (Perpetual) 4.000% 24-Jul-2026	18.673	0,04
20.000	Daimler Trucks Finance North America LLC '144A' 2.000% 14-Dec-2026	17.671	0,04
10.000	Daimler Trucks Finance North America LLC '144A' 2.500% 14-Dec-2031	7.815	0,02
25.000	Danaher Corp 2.800% 10-Dec-2051	16.812	0,04
15.000	Danaher Corp 3.350% 15-Sep-2025	14.466	0,03
20.000	Danone SA '144A' 2.947% 02-Nov-2026	18.640	0,04
20.000	Danske Bank A/S '144A' 1.226% 22-Jun-2024	18.690	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
15.000	Danske Bank A/S '144A' FRN 4.298% 01-Apr-2028	13.844	0,03
10.000	DBS Group Holdings Ltd '144A' 1.194% 15-Mar-2027	8.669	0,02
10.000	DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-Jul-2025	9.923	0,02
10.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037	10.147	0,02
5.000	Deere & Co 3.900% 09-Jun-2042	4.477	0,01
5.000	DENTSPLY SIRONA Inc 3.250% 01-Jun-2030	4.174	0,01
20.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 2.311% 16-Nov-2027	17.009	0,04
20.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 5.882% 08-Jul-2031	17.365	0,04
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 8.750% 15-Jun-2030	11.851	0,03
25.000	Deutsche Telekom International Finance BV 9.250% 01-Jun-2032	31.431	0,07
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 3.600% 19-Jan-2027	9.494	0,02
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 4.375% 21-Jun-2028	4.811	0,01
10.000	Devon Energy Corp 5.000% 15-Jun-2045	8.732	0,02
5.000	DH Europe Finance II Sarl 2.200% 15-Nov-2024	4.764	0,01
5.000	DH Europe Finance II Sarl 2.600% 15-Nov-2029	4.397	0,01
10.000	Diageo Capital Plc 2.375% 24-Oct-2029	8.576	0,02
10.000	Diageo Capital Plc 3.875% 29-Apr-2043	8.306	0,02
10.000	Diageo Investment Corp 7.450% 15-Apr-2035	11.933	0,03
10.000	Diamondback Energy Inc 3.250% 01-Dec-2026	9.329	0,02
25.000	Diamondback Energy Inc 6.250% 15-Mar-2033	25.505	0,05
10.000	Dick's Sporting Goods Inc 4.100% 15-Jan-2052	6.525	0,01
20.000	Digital Realty Trust LP 5.550% 15-Jan-2028	20.200	0,04
10.000	Discover Bank 'BKNT' 3.450% 27-Jul-2026	9.234	0,02
5.000	Discover Bank 'BKNT' 4.650% 13-Sep-2028	4.702	0,01
10.000	Discover Financial Services 3.950% 06-Nov-2024	9.747	0,02
10.000	Discover Financial Services 4.100% 09-Feb-2027	9.426	0,02
40.000	Discovery Communications LLC 4.000% 15-Sep-2055	24.290	0,05
20.000	DNB Bank ASA '144A' FRN 1.127% 16-Sep-2026	17.688	0,04
10.000	DNB Bank ASA '144A' FRN 2.968% 28-Mar-2025	9.654	0,02
5.000	Dollar General Corp 3.500% 03-Apr-2030	4.516	0,01
5.000	Dollar General Corp 3.875% 15-Apr-2027	4.782	0,01
10.000	Dollar General Corp 4.125% 01-May-2028	9.558	0,02
5.000	Dollar General Corp 4.150% 01-Nov-2025	4.895	0,01
10.000	Dollar Tree Inc 3.375% 01-Dec-2051	6.812	0,01
10.000	Dominion Energy Inc 3.300% 15-Mar-2025	9.611	0,02
5.000	Dominion Energy Inc 3.375% 01-Apr-2030	4.430	0,01
10.000	Dominion Energy Inc 3.600% 15-Mar-2027	9.422	0,02
5.000	Dominion Energy Inc 3.900% 01-Oct-2025	4.874	0,01
10.000	Dominion Energy Inc Step-Up Coupon 3.071% 15-Aug-2024	9.646	0,02
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc 5.100% 01-Jun-2065	9.243	0,02
20.000	Dominion Energy South Carolina Inc 5.450% 01-Feb-2041	19.827	0,04
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc 6.050% 15-Jan-2038	10.594	0,02
29.000	Dow Chemical Co/The 4.250% 01-Oct-2034	26.425	0,06
5.000	Dow Chemical Co/The 4.375% 15-Nov-2042	4.186	0,01
5.000	Dow Chemical Co/The 4.625% 01-Oct-2044	4.191	0,01
5.000	Dow Chemical Co/The 4.800% 15-May-2049	4.278	0,01
5.000	Dow Chemical Co/The 5.250% 15-Nov-2041	4.710	0,01
10.000	Dow Chemical Co/The 7.375% 01-Nov-2029	11.164	0,02
10.000	DR Horton Inc 2.600% 15-Oct-2025	9.349	0,02
30.000	DTE Energy Co 2.850% 01-Oct-2026	27.753	0,06
2.000	DTE Energy Co 3.400% 15-Jun-2029	1.786	0,00
10.000	Duke Energy Carolinas LLC 3.950% 15-Nov-2028	9.634	0,02
10.000	Duke Energy Carolinas LLC 5.300% 15-Feb-2040	10.010	0,02
15.000	Duke Energy Corp 2.550% 15-Jun-2031	12.300	0,03
10.000	Duke Energy Corp 2.650% 01-Sep-2026	9.269	0,02
10.000	Duke Energy Corp 3.150% 15-Aug-2027	9.258	0,02
20.000	Duke Energy Corp 3.750% 01-Sep-2046	15.027	0,03
10.000	Duke Energy Corp 4.800% 15-Dec-2045	8.901	0,02
30.000	Duke Energy Corp FRN 3.250% 15-Jan-2082	21.970	0,05
5.000	Duke Energy Florida LLC 2.500% 01-Dec-2029	4.304	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Duke Energy Florida LLC 3.200% 15-Jan-2027	4.738	0,01
5.000	Duke Energy Florida LLC 6.400% 15-Jun-2038	5.530	0,01
5.000	Duke Energy Progress LLC 2.000% 15-Aug-2031	3.977	0,01
10.000	DuPont de Nemours Inc 4.493% 15-Nov-2025	9.853	0,02
15.000	DuPont de Nemours Inc 4.725% 15-Nov-2028	14.850	0,03
10.000	DuPont de Nemours Inc 5.319% 15-Nov-2038	9.685	0,02
5.000	DuPont de Nemours Inc 5.419% 15-Nov-2048	4.823	0,01
5.000	E.ON International Finance BV '144A' 6.650% 30-Apr-2038	5.091	0,01
10.000	Eagle Materials Inc 2.500% 01-Jul-2031	7.895	0,02
10.000	East Ohio Gas Co/The '144A' 1.300% 15-Jun-2025	9.080	0,02
15.000	Eastman Chemical Co 3.800% 15-Mar-2025	14.577	0,03
10.000	Eaton Corp 4.150% 02-Nov-2042	8.630	0,02
10.000	Eaton Vance Corp 3.500% 06-Apr-2027	9.347	0,02
25.000	eBay Inc 1.400% 10-May-2026	22.226	0,05
10.000	eBay Inc 2.700% 11-Mar-2030	8.547	0,02
10.000	eBay Inc 3.450% 01-Aug-2024	9.738	0,02
5.000	Ecolab Inc 2.700% 01-Nov-2026	4.654	0,01
15.000	Edison International 4.125% 15-Mar-2028	13.967	0,03
50.000	Edison International 4.950% 15-Apr-2025	49.254	0,11
10.000	EDP Finance BV '144A' 3.625% 15-Jul-2024	9.659	0,02
5.000	Edwards Lifesciences Corp 4.300% 15-Jun-2028	4.813	0,01
10.000	El Puerto de Liverpool SAB de CV 'REGS' 3.875% 06-Oct-2026	9.473	0,02
15.000	Electronic Arts Inc 1.850% 15-Feb-2031	11.863	0,03
10.000	Element Fleet Management Corp '144A' 3.850% 15-Jun-2025	9.485	0,02
20.000	Elevance Health Inc 2.250% 15-May-2030	16.678	0,04
9.000	Elevance Health Inc 2.375% 15-Jan-2025	8.557	0,02
10.000	Elevance Health Inc 3.350% 01-Dec-2024	9.705	0,02
5.000	Elevance Health Inc 3.500% 15-Aug-2024	4.882	0,01
10.000	Elevance Health Inc 3.650% 01-Dec-2027	9.469	0,02
10.000	Elevance Health Inc 4.375% 01-Dec-2047	8.666	0,02
10.000	Elevance Health Inc 4.550% 01-Mar-2048	8.840	0,02
25.000	Elevance Health Inc 4.625% 15-May-2042	22.993	0,05
5.000	Elevance Health Inc 4.650% 15-Jan-2043	4.583	0,01
5.000	Eli Lilly & Co 2.750% 01-Jun-2025	4.785	0,01
10.000	Eli Lilly & Co 5.500% 15-Mar-2027	10.412	0,02
20.000	EMD Finance LLC '144A' 3.250% 19-Mar-2025	19.197	0,04
10.000	Emera US Finance LP 0.833% 15-Jun-2024	9.343	0,02
1.000	Emera US Finance LP 3.550% 15-Jun-2026	939	0,00
20.000	Emerson Electric Co 2.200% 21-Dec-2031	16.305	0,03
10.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 4.750% 01-Aug-2026	9.667	0,02
35.000	Enbridge Energy Partners LP 5.875% 15-Oct-2025	35.609	0,08
25.000	Enbridge Energy Partners LP 7.375% 15-Oct-2045	28.217	0,06
20.000	Enbridge Inc 2.500% 15-Jan-2025	18.949	0,04
5.000	Enbridge Inc 4.500% 10-Jun-2044	4.183	0,01
10.000	Enbridge Inc 5.500% 01-Dec-2046	9.510	0,02
10.000	Enel Finance America LLC '144A' 7.100% 14-Oct-2027	10.373	0,02
10.000	Enel Finance International NV '144A' 1.375% 12-Jul-2026	8.634	0,02
5.000	Enel Finance International NV '144A' 1.875% 12-Jul-2028	3.985	0,01
5.000	Enel Finance International NV '144A' 2.250% 12-Jul-2031	3.668	0,01
12.000	Enel Finance International NV '144A' 2.650% 10-Sep-2024	11.494	0,02
15.000	Enel Finance International NV '144A' 4.625% 15-Jun-2027	14.233	0,03
5.000	Enel Finance International NV '144A' 4.750% 25-May-2047	3.969	0,01
30.000	Enel Finance International NV '144A' 4.875% 14-Jun-2029	27.765	0,06
20.000	Enel Finance International NV '144A' 6.000% 07-Oct-2039	18.377	0,04
40.000	Enel Generacion Chile SA 4.250% 15-Apr-2024	39.524	0,08
50.000	Energy Transfer LP 3.900% 15-Jul-2026	47.323	0,10
5.000	Energy Transfer LP 4.050% 15-Mar-2025	4.851	0,01
20.000	Energy Transfer LP 4.250% 01-Apr-2024	19.657	0,04
5.000	Energy Transfer LP 5.000% 15-May-2050	4.045	0,01
25.000	Energy Transfer LP 5.150% 01-Feb-2043	20.894	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Energy Transfer LP 5.150% 15-Mar-2045	4.193	0,01
20.000	Energy Transfer LP 5.250% 15-Apr-2029	19.441	0,04
10.000	Energy Transfer LP 5.500% 01-Jun-2027	9.960	0,02
5.000	Energy Transfer LP 6.125% 15-Dec-2045	4.677	0,01
15.000	Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049	14.109	0,03
5.000	Energy Transfer LP 6.500% 01-Feb-2042	4.967	0,01
10.000	Energy Transfer LP 7.500% 01-Jul-2038	10.710	0,02
20.000	Engie Energia Chile SA 'REGS' 3.400% 28-Jan-2030	16.532	0,04
10.000	Eni SpA '144A' 4.750% 12-Sep-2028	9.715	0,02
10.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS' 2.625% 17-Sep-2030	8.142	0,02
20.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS' 4.625% 17-May-2027	19.456	0,04
10.000	Enstar Group Ltd 3.100% 01-Sep-2031	7.350	0,02
10.000	Entegris Escrow Corp '144A' 4.750% 15-Apr-2029	9.140	0,02
60.000	Entergy Corp 2.950% 01-Sep-2026	55.851	0,12
20.000	Entergy Texas Inc 5.000% 15-Sep-2052	18.548	0,04
50.000	Enterprise Products Operating LLC 3.950% 15-Feb-2027	48.118	0,10
15.000	Enterprise Products Operating LLC 3.950% 31-Jan-2060	10.974	0,02
20.000	Enterprise Products Operating LLC 4.200% 31-Jan-2050	15.930	0,03
10.000	Enterprise Products Operating LLC 4.850% 15-Aug-2042	8.929	0,02
10.000	Enterprise Products Operating LLC 5.100% 15-Feb-2045	9.091	0,02
20.000	Enterprise Products Operating LLC 6.875% 01-Mar-2033	22.000	0,05
15.000	Enterprise Products Operating LLC 7.550% 15-Apr-2038	16.894	0,04
5.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.250% 16-Aug-2077	4.035	0,01
5.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5.375% 15-Feb-2078	3.827	0,01
10.000	EPR Properties 3.600% 15-Nov-2031	7.290	0,02
20.000	EPR Properties 4.750% 15-Dec-2026	18.011	0,04
40.000	Equifax Inc 3.100% 15-May-2030	33.842	0,07
20.000	Equinix Inc 1.000% 15-Sep-2025	17.909	0,04
10.000	Equinix Inc 2.500% 15-May-2031	8.086	0,02
20.000	Equinix Inc 2.625% 18-Nov-2024	19.073	0,04
10.000	Equinix Inc 3.200% 18-Nov-2029	8.740	0,02
20.000	Equitable Financial Life Global Funding '144A' 1.400% 07-Jul-2025	18.169	0,04
20.000	Equitable Holdings Inc 4.350% 20-Apr-2028	19.125	0,04
25.000	Equitable Holdings Inc 5.000% 20-Apr-2048	22.158	0,05
20.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 5.625% 15-Mar-2042	19.115	0,04
10.000	ERAC USA Finance LLC '144A' 7.000% 15-Oct-2037	10.954	0,02
35.000	ERP Operating LP 2.850% 01-Nov-2026	32.539	0,07
5.000	ERP Operating LP 3.500% 01-Mar-2028	4.631	0,01
10.000	ERP Operating LP 4.150% 01-Dec-2028	9.369	0,02
10.000	Essential Utilities Inc 3.351% 15-Apr-2050	6.928	0,01
15.000	Essex Portfolio LP 3.875% 01-May-2024	14.700	0,03
5.000	Estee Lauder Cos Inc/The 2.600% 15-Apr-2030	4.322	0,01
40.000	Evergny Inc 2.900% 15-Sep-2029	34.727	0,07
50.000	Eversource Energy 2.900% 01-Mar-2027	46.184	0,10
10.000	Eversource Energy 3.300% 15-Jan-2028	9.242	0,02
15.000	Exelon Corp 4.950% 15-Jun-2035	14.445	0,03
15.000	Exelon Corp 5.100% 15-Jun-2045	14.114	0,03
5.000	Expedia Group Inc '144A' 6.250% 01-May-2025	5.050	0,01
20.000	Extra Space Storage LP 3.900% 01-Apr-2029	18.002	0,04
10.000	Exxon Mobil Corp 2.275% 16-Aug-2026	9.284	0,02
5.000	Exxon Mobil Corp 2.992% 19-Mar-2025	4.825	0,01
10.000	Exxon Mobil Corp 3.043% 01-Mar-2026	9.561	0,02
25.000	Exxon Mobil Corp 3.294% 19-Mar-2027	24.097	0,05
20.000	Exxon Mobil Corp 3.482% 19-Mar-2030	18.731	0,04
10.000	Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040	9.071	0,02
10.000	FactSet Research Systems Inc 2.900% 01-Mar-2027	9.104	0,02
10.000	Falabella SA 'REGS' 3.375% 15-Jan-2032	8.004	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Farmers Insurance Exchange '144A' FRN 4.747% 01-Nov-2057	8.091	0,02
25.000	Federal Realty Investment Trust 1.250% 15-Feb-2026	22.076	0,05
5.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 2.050% 10-Feb-2025	4.667	0,01
20.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 4.400% 23-Aug-2025	19.548	0,04
10.000	FedEx Corp 3.400% 15-Feb-2028	9.272	0,02
5.000	FedEx Corp 4.050% 15-Feb-2048	3.840	0,01
5.000	FedEx Corp 4.550% 01-Apr-2046	4.104	0,01
5.000	FedEx Corp 4.750% 15-Nov-2045	4.267	0,01
20.000	FedEx Corp 5.100% 15-Jan-2044	17.926	0,04
5.000	FedEx Corp 5.250% 15-May-2050	4.612	0,01
20.000	Ferguson Finance Plc '144A' 4.250% 20-Apr-2027	18.970	0,04
5.000	Fidelis Insurance Holdings Ltd '144A' 4.875% 30-Jun-2030	4.218	0,01
40.000	Fidelity National Financial Inc 2.450% 15-Mar-2031	30.811	0,07
20.000	Fidelity National Information Services Inc 4.500% 15-Jul-2025	19.646	0,04
10.000	Fidelity National Information Services Inc 4.500% 15-Aug-2046	7.846	0,02
20.000	Fifth Third Bancorp 2.375% 28-Jan-2025	18.983	0,04
10.000	Fifth Third Bancorp 4.300% 16-Jan-2024	9.902	0,02
25.000	Fifth Third Bancorp FRN 4.337% 25-Apr-2033	22.991	0,05
10.000	Fifth Third Bank NA 'BKNT' 3.950% 28-Jul-2025	9.841	0,02
10.000	Fifth Third Bank NA FRN 5.852% 27-Oct-2025	10.113	0,02
15.000	First American Financial Corp 4.600% 15-Nov-2024	14.771	0,03
25.000	Fiserv Inc 2.750% 01-Jul-2024	24.094	0,05
10.000	Fiserv Inc 3.200% 01-Jul-2026	9.382	0,02
10.000	Fiserv Inc 3.500% 01-Jul-2029	9.044	0,02
10.000	Fiserv Inc 4.400% 01-Jul-2049	8.224	0,02
20.000	Florida Power & Light Co 2.450% 03-Feb-2032	16.770	0,04
25.000	Florida Power & Light Co 5.625% 01-Apr-2034	26.152	0,06
5.000	Florida Power & Light Co 5.950% 01-Feb-2038	5.361	0,01
10.000	FMC Corp 3.450% 01-Oct-2029	8.868	0,02
5.000	FMR LLC '144A' 7.570% 15-Jun-2029	5.427	0,01
16.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 3.500% 16-Jan-2050	11.258	0,02
4.000	Fortis Inc/Canada 3.055% 04-Oct-2026	3.720	0,01
35.000	Fortive Corp 3.150% 15-Jun-2026	32.765	0,07
10.000	Fortune Brands Innovations Inc 3.250% 15-Sep-2029	8.708	0,02
10.000	Fox Corp 4.709% 25-Jan-2029	9.705	0,02
10.000	Fox Corp 5.476% 25-Jan-2039	9.184	0,02
20.000	Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-Aug-2028	18.703	0,04
10.000	Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043	9.043	0,02
5.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 2.375% 16-Feb-2031	3.686	0,01
10.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 3.750% 15-Jun-2029	8.511	0,02
20.000	FS KKR Capital Corp 4.625% 15-Jul-2024	19.393	0,04
25.000	GATX Corp 3.500% 01-Jun-2032	21.062	0,05
10.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.300% 18-Mar-2051	7.021	0,02
25.000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4.418% 15-Nov-2035	23.214	0,05
20.000	GE HealthCare Technologies Inc '144A' 5.550% 15-Nov-2024	20.097	0,04
25.000	GE HealthCare Technologies Inc '144A' 5.905% 22-Nov-2032	26.068	0,06
60.000	General Dynamics Corp 2.125% 15-Aug-2026	55.244	0,12
20.000	General Electric Co 'GMTN' 6.875% 10-Jan-2039	22.193	0,05
15.000	General Mills Inc 3.200% 10-Feb-2027	14.207	0,03
5.000	General Mills Inc 4.000% 17-Apr-2025	4.891	0,01
30.000	General Mills Inc 4.200% 17-Apr-2028	29.101	0,06
10.000	GENM Capital Labuan Ltd 'REGS' 3.882% 19-Apr-2031	7.501	0,02
20.000	Genuine Parts Co 2.750% 01-Feb-2032	16.161	0,03
10.000	Georgia Power Co 3.250% 30-Mar-2027	9.268	0,02
5.000	Georgia Power Co 3.250% 15-Mar-2051	3.491	0,01
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.100% 30-Apr-2027	4.494	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 2.300% 30-Apr-2030	4.175	0,01
20.000	Georgia-Pacific LLC '144A' 3.600% 01-Mar-2025	19.394	0,04
5.000	Gilead Sciences Inc 1.650% 01-Oct-2030	3.989	0,01
20.000	Gilead Sciences Inc 3.650% 01-Mar-2026	19.328	0,04
35.000	Gilead Sciences Inc 4.150% 01-Mar-2047	29.268	0,06
20.000	Gilead Sciences Inc 4.500% 01-Feb-2045	17.825	0,04
10.000	Gilead Sciences Inc 4.600% 01-Sep-2035	9.581	0,02
10.000	Gilead Sciences Inc 4.750% 01-Mar-2046	9.084	0,02
5.000	Gilead Sciences Inc 4.800% 01-Apr-2044	4.634	0,01
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3.625% 15-May-2025	4.890	0,01
5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3.875% 15-May-2028	4.817	0,01
10.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 6.375% 15-May-2038	11.361	0,02
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3.000% 01-Jun-2024	4.868	0,01
5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3.375% 01-Jun-2029	4.631	0,01
20.000	Glencore Funding LLC '144A' 3.875% 27-Oct-2027	18.764	0,04
15.000	Glencore Funding LLC '144A' 3.875% 27-Apr-2051	10.889	0,02
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.125% 12-Mar-2024	9.848	0,02
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.625% 29-Apr-2024	9.887	0,02
10.000	Glencore Funding LLC '144A' 4.875% 12-Mar-2029	9.621	0,02
15.000	Global Atlantic Fin Co '144A' 4.400% 15-Oct-2029	12.618	0,03
10.000	Global Payments Inc 1.200% 01-Mar-2026	8.737	0,02
20.000	Global Payments Inc 2.650% 15-Feb-2025	18.846	0,04
20.000	Global Payments Inc 2.900% 15-May-2030	16.493	0,04
25.000	Global Payments Inc 4.800% 01-Apr-2026	24.402	0,05
20.000	Global Payments Inc 4.950% 15-Aug-2027	19.468	0,04
20.000	Global Payments Inc 5.400% 15-Aug-2032	19.178	0,04
10.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 3.250% 15-Jan-2032	8.008	0,02
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2030	4.388	0,01
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2031	4.298	0,01
5.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.250% 01-Jun-2025	4.920	0,01
10.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.300% 15-Jan-2029	9.480	0,02
15.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026	14.744	0,03
5.765	GNL Quintero SA 'REGS' 4.634% 31-Jul-2029	5.578	0,01
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.600% 07-Feb-2030	4.196	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 23-Jan-2025	9.674	0,02
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 01-Apr-2025	14.445	0,03
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 16-Nov-2026	9.398	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 22-May-2025	9.689	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 25-Feb-2026	9.642	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.800% 15-Mar-2030	9.028	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.850% 26-Jan-2027	9.533	0,02
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.000% 03-Mar-2024	19.746	0,04
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.250% 21-Oct-2025	9.784	0,02
45.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.150% 22-May-2045	40.881	0,09
35.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.125% 15-Feb-2033	36.495	0,08
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.250% 01-Feb-2041	10.543	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.450% 01-May-2036	5.229	0,01
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6.750% 01-Oct-2037	21.361	0,05
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.431% 09-Mar-2027	17.561	0,04
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.542% 10-Sep-2027	8.650	0,02
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.757% 24-Jan-2025	19.152	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.948% 21-Oct-2027	26.306	0,06
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.383% 21-Jul-2032	3.905	0,01
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.615% 22-Apr-2032	32.018	0,07
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.640% 24-Feb-2028	17.849	0,04
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.650% 21-Oct-2032	7.948	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.102% 24-Feb-2033	8.174	0,02
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.210% 22-Apr-2042	10.929	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.272% 29-Sep-2025	4.824	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.615% 15-Mar-2028	9.321	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.691% 05-Jun-2028	4.653	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.814% 23-Apr-2029	9.168	0,02
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.017% 31-Oct-2038	4.149	0,01
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.223% 01-May-2029	14.026	0,03
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.411% 23-Apr-2039	4.362	0,01
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.482% 23-Aug-2028	9.632	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN' 3.850% 08-Jul-2024	9.796	0,02
10.000	Golub Capital BDC Inc 2.050% 15-Feb-2027	8.158	0,02
20.000	Goodman US Finance Five LLC '144A' 4.625% 04-May-2032	18.351	0,04
5.000	Goodman US Finance Three LLC '144A' 3.700% 15-Mar-2028	4.528	0,01
15.000	Grupo Televisa SAB 6.125% 31-Jan-2046	15.025	0,03
20.000	GS Caltex Corp 'REGS' 3.000% 04-Jun-2024	19.296	0,04
10.000	GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc '144A' 3.125% 24-Mar-2025	9.525	0,02
20.000	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC '144A' 3.375% 24-Mar-2027	18.678	0,04
10.000	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC '144A' 3.625% 24-Mar-2032	8.852	0,02
5.000	GTL Trade Finance Inc 'REGS' 7.250% 16-Apr-2044	5.677	0,01
20.000	Guardian Life Global Funding '144A' 1.625% 16-Sep-2028	16.749	0,04
15.000	Halliburton Co 4.500% 15-Nov-2041	12.653	0,03
10.000	Halliburton Co 5.000% 15-Nov-2045	8.937	0,02
10.000	Hana Bank 'REGS' 3.250% 30-Mar-2027	9.329	0,02
35.000	Hanover Insurance Group Inc/The 4.500% 15-Apr-2026	34.326	0,07
10.000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 3.350% 08-Jun-2025	9.336	0,02
10.000	Hartford Financial Services Group Inc/The 4.400% 15-Mar-2048	8.359	0,02
5.000	Hasbro Inc 3.000% 19-Nov-2024	4.799	0,01
10.000	Hasbro Inc 3.900% 19-Nov-2029	8.932	0,02
5.000	Hasbro Inc 5.100% 15-May-2044	4.306	0,01
5.000	HBOS Plc '144A' 6.000% 01-Nov-2033	4.700	0,01
20.000	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	17.349	0,04
5.000	HCA Inc 3.500% 15-Jul-2051	3.253	0,01
20.000	HCA Inc 4.125% 15-Jun-2029	18.346	0,04
10.000	HCA Inc 4.500% 15-Feb-2027	9.666	0,02
10.000	HCA Inc 5.000 % 15-Mar-2024	9.951	0,02
5.000	HCA Inc 5.250% 15-Apr-2025	4.979	0,01
30.000	HCA Inc 5.250% 15-Jun-2026	29.689	0,06
5.000	HCA Inc 5.250% 15-Jun-2049	4.306	0,01
15.000	HCA Inc 5.375% 01-Feb-2025	15.005	0,03
5.000	HCA Inc 5.500% 15-Jun-2047	4.481	0,01
15.000	HCA Inc 5.625% 01-Sep-2028	14.964	0,03
20.000	HCA Inc '144A' 3.125 % 15-Mar-2027	18.267	0,04
20.000	HCA Inc '144A' 3.625 % 15-Mar-2032	17.036	0,04
5.000	HCA Inc '144A' 4.625 % 15-Mar-2052	3.943	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
5.000	Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co '144A' 2.200% 01-Jun-2030	4.044	0,01
10.000	Healthcare Realty Holdings LP 2.000% 15-Mar-2031	7.603	0,02
5.000	Healthcare Realty Holdings LP 3.100% 15-Feb-2030	4.199	0,01
25.000	Healthpeak Properties Inc 2.125% 01-Dec-2028	21.055	0,05
10.000	Healthpeak Properties Inc 3.400% 01-Feb-2025	9.635	0,02
5.000	Heineken NV '144A' 3.500% 29-Jan-2028	4.747	0,01
15.000	Hercules Capital Inc 2.625% 16-Sep-2026	12.685	0,03
50.000	Hess Corp 4.300% 01-Apr-2027	47.902	0,10
10.000	Hess Corp 6.000% 15-Jan-2040	9.904	0,02
10.000	Hewlett Packard Enterprise Co 4.900% 15-Oct-2025	9.924	0,02
5.000	Hewlett Packard Enterprise Co 6.350% 15-Oct-2045	5.022	0,01
40.000	Home Depot Inc/The 1.875% 15-Sep-2031	32.169	0,07
20.000	Home Depot Inc/The 2.700% 15-Apr-2030	17.495	0,04
10.000	Home Depot Inc/The 3.000% 01-Apr-2026	9.540	0,02
15.000	Home Depot Inc/The 3.300% 15-Apr-2040	12.081	0,03
10.000	Home Depot Inc/The 3.350% 15-Sep-2025	9.714	0,02
5.000	Home Depot Inc/The 3.500% 15-Sep-2056	3.784	0,01
10.000	Home Depot Inc/The 5.875% 16-Dec-2036	10.791	0,02
5.000	Home Depot Inc/The 5.950% 01-Apr-2041	5.487	0,01
20.000	Honeywell International Inc 1.350% 01-Jun-2025	18.523	0,04
25.000	Honeywell International Inc 4.850% 01-Nov-2024	25.109	0,05
5.000	Honeywell International Inc 5.700% 15-Mar-2036	5.327	0,01
5.000	Hormel Foods Corp 1.800% 11-Jun-2030	4.087	0,01
10.000	Host Hotels & Resorts LP 3.375% 15-Dec-2029	8.404	0,02
10.000	Host Hotels & Resorts LP 3.500% 15-Sep-2030	8.300	0,02
50.000	Host Hotels & Resorts LP 4.000% 15-Jun-2025	48.129	0,10
25.000	HP Inc 2.650 % 17-Jun-2031	19.601	0,04
10.000	HP Inc 3.400 % 17-Jun-2030	8.528	0,02
10.000	HP Inc 4.750% 15-Jan-2028	9.736	0,02
25.000	HSBC Bank USA NA 'BKNT' 7.000% 15-Jan-2039	27.266	0,06
20.000	HSBC Bank USA NA/New York NY 'BKNT' 5.875% 01-Nov-2034	19.495	0,04
10.000	HSBC Holdings Plc 3.900% 25-May-2026	9.548	0,02
10.000	HSBC Holdings Plc 4.250% 14-Mar-2024	9.830	0,02
10.000	HSBC Holdings Plc 4.250% 18-Aug-2025	9.637	0,02
35.000	HSBC Holdings Plc 4.300% 08-Mar-2026	33.944	0,07
10.000	HSBC Holdings Plc 4.375% 23-Nov-2026	9.635	0,02
20.000	HSBC Holdings Plc 4.950% 31-Mar-2030	19.170	0,04
20.000	HSBC Holdings Plc 6.800% 01-Jun-2038	20.269	0,04
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.251% 22-Nov-2027	17.370	0,04
30.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.633% 07-Nov-2025	28.235	0,06
30.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.871% 22-Nov-2032	23.097	0,05
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.803% 11-Mar-2025	9.729	0,02
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.973% 22-May-2030	17.596	0,04
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.041% 13-Mar-2028	9.243	0,02
5.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.292% 12-Sep-2026	4.797	0,01
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.755% 09-Jun-2028	18.963	0,04
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 4.762% 29-Mar-2033	8.721	0,02
10.000	HSBC Holdings Plc FRN 5.210% 11-Aug-2028	9.678	0,02
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 7.390% 03-Nov-2028	21.025	0,05
20.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.113% 03-Nov-2033	21.288	0,05
25.000	HSBC USA Inc 3.750% 24-May-2024	24.543	0,05
14.000	Hubbell Inc 3.150% 15-Aug-2027	12.771	0,03
5.000	Hubbell Inc 3.350% 01-Mar-2026	4.760	0,01
20.000	Humana Inc 1.350% 03-Feb-2027	17.334	0,04
5.000	Humana Inc 3.850% 01-Oct-2024	4.906	0,01
60.000	Humana Inc 3.950% 15-Mar-2027	57.690	0,12
25.000	Huntington National Bank/The FRN 4.552% 17-May-2028	24.186	0,05
5.000	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033	5.846	0,01
10.000	Hyatt Hotels Corp 4.850% 15-Mar-2026	9.846	0,02
10.000	Hyundai Capital America '144A' 0.800% 08-Jan-2024	9.520	0,02
10.000	Hyundai Capital America '144A' 1.000% 17-Sep-2024	9.250	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	Hyundai Capital America '144A' 2.375% 15-Oct-2027	34.332	0,07
15.000	Hyundai Capital America '144A' 5.875% 07-Apr-2025	15.082	0,03
10.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS' 3.625% 29-Aug-2027	9.043	0,02
5.000	Illinois Tool Works Inc 2.650% 15-Nov-2026	4.657	0,01
15.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 3.125% 26-Jul-2024	14.355	0,03
10.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 4.250% 21-Jul-2025	9.570	0,02
20.000	Imperial Brands Finance Plc '144A' 6.125% 27-Jul-2027	19.965	0,04
10.000	ING Groep NV 3.950% 29-Mar-2027	9.500	0,02
5.000	ING Groep NV '144A' 4.625% 06-Jan-2026	4.893	0,01
10.000	ING Groep NV '144A' FRN 1.400% 01-Jul-2026	9.006	0,02
25.000	ING Groep NV FRN 4.252% 28-Mar-2033	22.153	0,05
10.000	Intact Financial Corp '144A' 5.459% 22-Sep-2032	9.930	0,02
10.000	Intel Corp 2.000% 12-Aug-2031	7.974	0,02
25.000	Intel Corp 2.875% 11-May-2024	24.375	0,05
5.000	Intel Corp 3.100% 15-Feb-2060	3.136	0,01
10.000	Intel Corp 4.150% 05-Aug-2032	9.410	0,02
15.000	Intel Corp 4.800% 01-Oct-2041	14.004	0,03
5.000	Intel Corp 4.950% 25-Mar-2060	4.506	0,01
5.000	Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032	3.769	0,01
5.000	Intercontinental Exchange Inc 3.000% 15-Sep-2060	3.155	0,01
5.000	Intercontinental Exchange Inc 3.100% 15-Sep-2027	4.629	0,01
10.000	Intercontinental Exchange Inc 3.750% 21-Sep-2028	9.459	0,02
20.000	Intercontinental Exchange Inc 4.600% 15-Mar-2033	19.161	0,04
10.000	Intercorp Financial Services Inc 'REGS' 4.125% 19-Oct-2027	8.844	0,02
10.000	International Business Machines Corp 1.700% 15-May-2027	8.813	0,02
35.000	International Business Machines Corp 3.300% 15-May-2026	33.370	0,07
55.000	International Business Machines Corp 3.500% 15-May-2029	50.721	0,11
15.000	International Business Machines Corp 4.150% 15-May-2039	13.067	0,03
25.000	International Business Machines Corp 6.500% 15-Jan-2028	26.812	0,06
10.000	International Flavors & Fragrances Inc 4.375% 01-Jun-2047	7.869	0,02
20.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A' 1.832% 15-Oct-2027	16.843	0,04
20.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A' 2.300% 01-Nov-2030	15.963	0,03
20.000	International Paper Co 6.000% 15-Nov-2041	20.133	0,04
10.000	Interpublic Group of Cos Inc/The 4.750% 30-Mar-2030	9.484	0,02
5.000	Interstate Power and Light Co 3.250% 01-Dec-2024	4.829	0,01
5.000	Interstate Power and Light Co 3.600% 01-Apr-2029	4.586	0,01
25.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.250% 23-Sep-2024	23.739	0,05
10.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.875% 14-Jul-2027	8.943	0,02
5.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 4.700% 23-Sep-2049	3.560	0,01
15.000	Intuit Inc 0.950% 15-Jul-2025	13.675	0,03
5.000	Intuit Inc 1.650% 15-Jul-2030	4.036	0,01
10.000	Inversiones CMPC SA 'REGS' 4.750% 15-Sep-2024	9.855	0,02
10.000	Invitation Homes Operating Partnership LP 2.300% 15-Nov-2028	8.304	0,02
10.000	ITC Holdings Corp 3.350% 15-Nov-2027	9.240	0,02
10.000	ITC Holdings Corp '144A' 2.950% 14-May-2030	8.482	0,02
10.000	J M Smucker Co/The 2.375% 15-Mar-2030	8.329	0,02
10.000	J M Smucker Co/The 3.550% 15-Mar-2050	6.943	0,01
20.000	JAB Holdings BV '144A' 4.500% 08-Apr-2052	13.735	0,03
10.000	Jackson National Life Global Funding '144A' 3.875% 11-Jun-2025	9.618	0,02
10.000	JBS USA Food Co '144A' 2.500% 15-Jan-2027	8.761	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 2.500% 15-Jan-2027	8.761	0,02
10.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 5.500% 15-Jan-2030	9.539	0,02
10.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2033	9.563	0,02
20.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 6.500% 01-Dec-2052	19.072	0,04
10.000	JDE Peet's NV '144A' 0.800% 24-Sep-2024	9.144	0,02
15.000	Jefferies Financial Group Inc 2.625% 15-Oct-2031	11.500	0,02
15.000	Jefferies Financial Group Inc 4.150% 23-Jan-2030	13.404	0,03
5.000	Jefferies Financial Group Inc 6.500% 20-Jan-2043	4.920	0,01
20.000	Jersey Central Power & Light Co '144A' 4.700% 01-Apr-2024	19.736	0,04
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 2.000% 17-Jun-2031	8.132	0,02
25.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 3.050% 06-Jan-2028	23.436	0,05
10.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 3.400% 06-Jun-2025	9.720	0,02
20.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 3.900% 07-Jun-2032	18.796	0,04
20.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 4.150% 15-Sep-2027	19.643	0,04
20.000	John Deere Capital Corp 'MTN' 4.850% 11-Oct-2029	20.117	0,04
10.000	John Hancock Life Insurance Co '144A' 7.375% 15-Feb-2024	10.198	0,02
10.000	Johns Hopkins University 2.813% 01-Jan-2060	6.352	0,01
30.000	Johnson & Johnson 2.450% 01-Mar-2026	28.257	0,06
5.000	Johnson & Johnson 3.400% 15-Jan-2038	4.299	0,01
5.000	Johnson & Johnson 3.550% 01-Mar-2036	4.470	0,01
5.000	Johnson & Johnson 3.625% 03-Mar-2037	4.453	0,01
10.000	Johnson & Johnson 5.850% 15-Jul-2038	11.201	0,02
15.000	Johnson & Johnson 5.950% 15-Aug-2037	16.834	0,04
25.000	Johnson & Johnson 6.950% 01-Sep-2029	29.892	0,06
10.000	Johnson Controls International plc 3.900% 14-Feb-2026	9.733	0,02
25.000	Johnson Controls International plc Step-Up Coupon 4.950% 02-Jul-2064	21.044	0,05
50.000	JPMorgan Chase & Co 3.300% 01-Apr-2026	47.506	0,10
10.000	JPMorgan Chase & Co 3.875% 10-Sep-2024	9.799	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co 4.125% 15-Dec-2026	9.687	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co 4.250% 01-Oct-2027	9.653	0,02
15.000	JPMorgan Chase & Co 5.400% 06-Jan-2042	14.862	0,03
10.000	JPMorgan Chase & Co 5.500% 15-Oct-2040	9.890	0,02
20.000	JPMorgan Chase & Co 6.400% 15-May-2038	21.813	0,05
5.000	JPMorgan Chase & Co 8.750% 01-Sep-2030	5.858	0,01
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.040% 04-Feb-2027	8.733	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.045% 19-Nov-2026	8.818	0,02
25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.470% 22-Sep-2027	21.684	0,05
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.561% 10-Dec-2025	9.270	0,02
30.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.578% 22-Apr-2027	26.439	0,06
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032	7.698	0,02
80.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	74.294	0,16
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.182% 01-Jun-2028	13.158	0,03
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.739% 15-Oct-2030	16.860	0,04
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.963% 25-Jan-2033	16.363	0,04
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.157% 22-Apr-2042	14.662	0,03
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.220% 01-Mar-2025	14.584	0,03
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.328% 22-Apr-2052	13.778	0,03
5.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.509% 23-Jan-2029	4.554	0,01
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.540% 01-May-2028	13.898	0,03
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030	9.012	0,02
5.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.782% 01-Feb-2028	4.685	0,01
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.845% 14-Jun-2025	19.573	0,04
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.882% 24-Jul-2038	8.377	0,02
30.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.005% 23-Apr-2029	27.762	0,06
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.080% 26-Apr-2026	48.682	0,10
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.493% 24-Mar-2031	18.778	0,04
25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.565% 14-Jun-2030	23.636	0,05
15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.851% 25-Jul-2028	14.682	0,03
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.912% 25-Jul-2033	19.194	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 5.717% 14-Sep-2033	9.864	0,02
5.000	Kaiser Foundation Hospitals 3.150% 01-May-2027	4.694	0,01
5.000	Kansas City Southern/Old 4.200% 15-Nov-2069	3.751	0,01
10.000	Kansas City Southern/Old 4.300% 15-May-2043	8.320	0,02
15.000	Kellogg Co 4.300% 15-May-2028	14.603	0,03
5.000	Kellogg Co 4.500% 01-Apr-2046	4.319	0,01
40.000	Keurig Dr Pepper Inc 3.200% 01-May-2030	35.042	0,08
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4.420% 15-Dec-2046	8.296	0,02
80.000	KeyBank NA/Cleveland OH 'BKNT' 3.400% 20-May-2026	75.216	0,16
25.000	KeyBank NA/Cleveland OH 'BKNT' 4.390% 14-Dec-2027	24.127	0,05
35.000	Keysight Technologies Inc 3.000% 30-Oct-2029	30.540	0,07
5.000	Keysight Technologies Inc 4.550% 30-Oct-2024	4.929	0,01
20.000	Kia Corp 'REGS' 1.000% 16-Apr-2024	18.843	0,04
10.000	Kilroy Realty LP 3.450% 15-Dec-2024	9.586	0,02
15.000	Kilroy Realty LP 4.750% 15-Dec-2028	13.699	0,03
5.000	Kimberly-Clark Corp 3.100% 26-Mar-2030	4.523	0,01
10.000	Kimberly-Clark Corp 6.625% 01-Aug-2037	11.550	0,02
25.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.000% 01-Mar-2043	21.586	0,05
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.500% 01-Mar-2044	4.573	0,01
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 6.550% 15-Sep-2040	5.060	0,01
5.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 'MTN' 6.950% 15-Jan-2038	5.355	0,01
45.000	Kinder Morgan Inc 1.750% 15-Nov-2026	39.837	0,09
5.000	Kinder Morgan Inc 4.300% 01-Jun-2025	4.912	0,01
5.000	Kinder Morgan Inc 5.050% 15-Feb-2046	4.302	0,01
5.000	Kinder Morgan Inc 5.550% 01-Jun-2045	4.602	0,01
5.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN' 7.750% 15-Jan-2032	5.642	0,01
20.000	KKR Group Finance Co XII LLC '144A' 4.850% 17-May-2032	18.793	0,04
6.000	KLA Corp 4.650% 01-Nov-2024	5.989	0,01
20.000	KLA Corp 4.650% 15-Jul-2032	19.690	0,04
30.000	Koninklijke KPN NV 8.375% 01-Oct-2030	33.694	0,07
5.000	Koninklijke Philips NV 6.875% 11-Mar-2038	5.354	0,01
10.000	Kookmin Bank 'REGS' 1.750% 04-May-2025	9.250	0,02
10.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Perpetual) 4.350% 02-Jul-2024	9.365	0,02
15.000	Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026	14.075	0,03
20.000	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	20.580	0,04
20.000	Kraft Heinz Foods Co 4.625% 30-Jan-2029	19.855	0,04
20.000	Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042	18.309	0,04
5.000	Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045	4.659	0,01
25.000	KRC Interim Corp 3.200% 01-Apr-2032	20.829	0,04
5.000	KRC Interim Corp 3.700% 01-Oct-2049	3.462	0,01
5.000	KRC Interim Corp 4.125% 01-Dec-2046	3.709	0,01
5.000	KRC Interim Corp 4.450% 01-Sep-2047	3.902	0,01
5.000	Kroger Co/The 2.200% 01-May-2030	4.081	0,01
20.000	Kroger Co/The 3.700% 01-Aug-2027	18.966	0,04
5.000	Kroger Co/The 3.950% 15-Jan-2050	3.934	0,01
5.000	Kroger Co/The 4.450% 01-Feb-2047	4.252	0,01
25.000	Kroger Co/The 7.500% 01-Apr-2031	28.413	0,06
25.000	Kyndryl Holdings Inc 2.050% 15-Oct-2026	20.653	0,04
10.000	L3Harris Technologies Inc 3.832% 27-Apr-2025	9.728	0,02
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.400% 15-Jun-2028	9.603	0,02
10.000	L3Harris Technologies Inc 4.854% 27-Apr-2035	9.393	0,02
30.000	Laboratory Corp of America Holdings 1.550% 01-Jun-2026	26.631	0,06
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 2.950% 01-Dec-2029	4.329	0,01
5.000	Laboratory Corp of America Holdings 4.700% 01-Feb-2045	4.344	0,01
10.000	Lazard Group LLC 3.625% 01-Mar-2027	9.262	0,02
5.000	Lazard Group LLC 3.750% 13-Feb-2025	4.838	0,01
5.000	LBJ Infrastructure Group LLC '144A' 3.797% 31-Dec-2057	3.208	0,01
20.000	LeasePlan Corp NV '144A' 2.875% 24-Oct-2024	18.777	0,04
5.000	Legg Mason Inc 4.750% 15-Mar-2026	5.021	0,01
10.000	Leggett & Platt Inc 3.800% 15-Nov-2024	9.726	0,02
5.000	Leidos Inc 2.300% 15-Feb-2031	3.854	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Leland Stanford Junior University/The 1.289% 01-Jun-2027	8.710	0,02
20.000	Lennar Corp 4.500% 30-Apr-2024	19.750	0,04
20.000	Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027	19.306	0,04
20.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 5.831% 27-Jan-2028	19.353	0,04
10.000	LG Chem Ltd 'REGS' 2.375% 07-Jul-2031	7.907	0,02
10.000	LG Chem Ltd 'REGS' 3.250% 15-Oct-2024	9.603	0,02
20.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 3.950% 15-May-2060	13.266	0,03
15.000	Life Storage LP 3.875% 15-Dec-2027	13.927	0,03
20.000	Lloyds Banking Group Plc 4.582% 10-Dec-2025	19.354	0,04
10.000	Lloyds Banking Group Plc 4.650% 24-Mar-2026	9.588	0,02
10.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.369% 14-Dec-2046	6.557	0,01
20.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.511% 18-Mar-2026	19.031	0,04
45.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.574% 07-Nov-2028	40.664	0,09
20.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 3.870% 09-Jul-2025	19.377	0,04
10.000	Lloyds Banking Group Plc FRN 4.976% 11-Aug-2033	9.238	0,02
10.000	Lockheed Martin Corp 3.550% 15-Jan-2026	9.735	0,02
5.000	Lockheed Martin Corp 4.090% 15-Sep-2052	4.250	0,01
10.000	Lockheed Martin Corp 5.100% 15-Nov-2027	10.251	0,02
5.000	Lockheed Martin Corp 5.250% 15-Jan-2033	5.181	0,01
5.000	Lockheed Martin Corp 5.700% 15-Nov-2054	5.330	0,01
25.000	Lockheed Martin Corp 5.900% 15-Nov-2063	27.256	0,06
25.000	Lowe's Cos Inc 2.500% 15-Apr-2026	23.358	0,05
15.000	Lowe's Cos Inc 2.625% 01-Apr-2031	12.495	0,03
20.000	Lowe's Cos Inc 3.100% 03-May-2027	18.685	0,04
15.000	Lowe's Cos Inc 3.700% 15-Apr-2046	11.251	0,02
15.000	Lowe's Cos Inc 4.000% 15-Apr-2025	14.731	0,03
15.000	Lowe's Cos Inc 4.450% 01-Apr-2062	11.837	0,03
10.000	Lowe's Cos Inc 5.625% 15-Apr-2053	9.565	0,02
20.000	Lowe's Cos Inc 5.800% 15-Sep-2062	19.463	0,04
10.000	Lowe's Cos Inc 6.500% 15-Mar-2029	10.769	0,02
25.000	LSEGA Financing Plc '144A' 2.500% 06-Apr-2031	20.825	0,04
10.000	LYB Finance Co BV '144A' 8.100% 15-Mar-2027	10.925	0,02
20.000	LYB International Finance III LLC 3.375% 01-Oct-2040	14.383	0,03
10.000	LyondellBasell Industries NV 4.625% 26-Feb-2055	7.886	0,02
35.000	Macquarie Bank Ltd '144A' 2.300% 22-Jan-2025	33.163	0,07
5.000	Macquarie Bank Ltd '144A' 3.624% 03-Jun-2030	4.069	0,01
10.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 2.691% 23-Jun-2032	7.722	0,02
35.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN 3.763% 28-Nov-2028	32.108	0,07
5.000	Magellan Midstream Partners LP 3.950% 01-Mar-2050	3.708	0,01
5.000	Magellan Midstream Partners LP 4.200% 03-Oct-2047	3.798	0,01
50.000	Magellan Midstream Partners LP 5.000% 01-Mar-2026	49.781	0,11
25.000	Marathon Oil Corp 6.800% 15-Mar-2032	25.884	0,06
2.000	Marathon Petroleum Corp 4.500% 01-Apr-2048	1.618	0,00
22.000	Marathon Petroleum Corp 6.500% 01-Mar-2041	22.835	0,05
20.000	Markele Corp 5.000% 05-Apr-2046	17.492	0,04
10.000	Marriott International Inc/MD 2.750% 15-Oct-2033	7.689	0,02
5.000	Marriott International Inc/MD 2.850% 15-Apr-2031	4.059	0,01
20.000	Marriott International Inc/MD 3.600% 15-Apr-2024	19.616	0,04
5.000	Marriott International Inc/MD 4.650% 01-Dec-2028	4.820	0,01
2.000	Marriott International Inc/MD 5.750% 01-May-2025	2.020	0,00
15.000	Mars Inc '144A' 3.200% 01-Apr-2030	13.473	0,03
5.000	Mars Inc '144A' 4.200% 01-Apr-2059	4.094	0,01
5.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.875% 15-Mar-2024	4.935	0,01
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15-Mar-2029	9.713	0,02
10.000	Martin Marietta Materials Inc 4.250% 02-Jul-2024	9.876	0,02
10.000	Massachusetts Electric Co '144A' 5.900% 15-Nov-2039	10.012	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Massachusetts Institute of Technology 3.885% 01-Jul-2116	7.315	0,02
5.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 3.729% 15-Oct-2070	3.329	0,01
20.000	MassMutual Global Funding II '144A' 1.550% 09-Oct-2030	15.451	0,03
20.000	Mastercard Inc 1.900% 15-Mar-2031	16.358	0,04
15.000	McCormick & Co Inc/MD 0.900% 15-Feb-2026	13.167	0,03
15.000	McCormick & Co Inc/MD 1.850% 15-Feb-2031	11.670	0,03
20.000	McDonald's Corp 4.600% 09-Sep-2032	19.690	0,04
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 1.450% 01-Sep-2025	4.594	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.375% 26-May-2025	4.844	0,01
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.500% 01-Mar-2027	19.098	0,04
10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.700% 30-Jan-2026	9.745	0,02
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3.800% 01-Apr-2028	4.802	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050	4.218	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.450% 01-Sep-2048	4.408	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.600% 26-May-2045	4.514	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.700% 09-Dec-2035	4.820	0,01
20.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.875% 15-Jul-2040	18.889	0,04
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 4.875% 09-Dec-2045	4.680	0,01
5.000	McDonald's Corp 'MTN' 6.300% 15-Oct-2037	5.483	0,01
5.000	Medtronic Inc 4.375% 15-Mar-2035	4.763	0,01
10.000	Meiji Yasuda Life Insurance Co '144A' FRN 5.200% 20-Oct-2045	9.697	0,02
30.000	Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030	23.260	0,05
10.000	Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 2.955% 01-Jan-2050	6.725	0,01
10.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC 8.500% 18-Jan-2031	12.395	0,03
20.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A' 3.500% 03-Aug-2025	19.264	0,04
10.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A' 3.650% 22-Feb-2024	9.835	0,02
10.000	Merck & Co Inc 1.700% 10-Jun-2027	8.894	0,02
10.000	Merck & Co Inc 2.150% 10-Dec-2031	8.223	0,02
15.000	Merck & Co Inc 2.750% 10-Feb-2025	14.398	0,03
5.000	Merck & Co Inc 2.900% 07-Mar-2024	4.895	0,01
10.000	Merck & Co Inc 3.400% 07-Mar-2029	9.360	0,02
15.000	Merck & Co Inc 3.900% 07-Mar-2039	13.301	0,03
25.000	Met Tower Global Funding '144A' 3.700% 13-Jun-2025	24.285	0,05
20.000	Meta Platforms Inc 3.500% 15-Aug-2027	18.705	0,04
5.000	Meta Platforms Inc 4.650% 15-Aug-2062	4.031	0,01
10.000	Meta Platforms Inc '144A' 3.850% 15-Aug-2032	8.895	0,02
30.000	MetLife Inc 5.700% 15-Jun-2035	31.619	0,07
5.000	MetLife Inc 10.750% 01-Aug-2039	6.654	0,01
20.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 2.800% 21-Mar-2025	19.206	0,04
5.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 2.950% 09-Apr-2030	4.383	0,01
15.000	Microchip Technology Inc 0.972% 15-Feb-2024	14.272	0,03
2.000	Micron Technology Inc 3.366% 01-Nov-2041	1.351	0,00
20.000	Micron Technology Inc 4.185% 15-Feb-2027	18.995	0,04
14.000	Microsoft Corp 2.675% 01-Jun-2060	9.040	0,02
5.000	Microsoft Corp 3.041% 17-Mar-2062	3.521	0,01
55.000	Microsoft Corp 3.300% 06-Feb-2027	53.144	0,11
5.000	Microsoft Corp 3.450% 08-Aug-2036	4.467	0,01
15.000	Microsoft Corp 3.500% 12-Feb-2035	13.680	0,03
5.000	Microsoft Corp 4.200% 03-Nov-2035	4.888	0,01
10.000	Microsoft Corp 4.250% 06-Feb-2047	9.454	0,02
15.000	Microsoft Corp 5.300% 08-Feb-2041	16.198	0,03
15.000	Mid-America Apartments LP 3.750% 15-Jun-2024	14.703	0,03
5.000	MidAmerican Energy Co 3.650% 15-Apr-2029	4.700	0,01
5.000	Midwest Connector Capital Co LLC '144A' 3.900% 01-Apr-2024	4.845	0,01
10.000	Minejasa Capital BV 'REGS' 4.625% 10-Aug-2030	8.802	0,02
10.000	Minejasa Capital BV 'REGS' 5.625% 10-Aug-2037	7.803	0,02
10.000	Mississippi Power Co 3.950% 30-Mar-2028	9.428	0,02
10.000	Mitsubishi Corp '144A' 1.125% 15-Jul-2026	8.781	0,02
20.000	Mitsubishi HC Capital Inc '144A' 3.559% 28-Feb-2024	19.550	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Mitsubishi HC Capital Inc '144A' 3.637% 13-Apr-2025	9.607	0,02
15.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 1.412% 17-Jul-2025	13.647	0,03
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.193% 25-Feb-2025	9.374	0,02
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.559% 25-Feb-2030	8.321	0,02
15.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.407% 07-Mar-2024	14.698	0,03
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.850% 01-Mar-2026	19.178	0,04
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 0.953% 19-Jul-2025	18.603	0,04
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1.538% 20-Jul-2027	8.692	0,02
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 2.309% 20-Jul-2032	15.493	0,03
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 2.494% 13-Oct-2032	7.843	0,02
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 4.080% 19-Apr-2028	9.457	0,02
20.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 4.315% 19-Apr-2033	18.269	0,04
15.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 5.063% 12-Sep-2025	14.911	0,03
20.000	Mitsui Fudosan Co Ltd '144A' 2.572% 21-Jan-2032	16.281	0,03
15.000	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd '144A' FRN (Perpetual) 4.950% 06-Mar-2029	14.013	0,03
35.000	Mizuho Financial Group Inc 4.018% 05-Mar-2028	32.950	0,07
5.000	Mizuho Financial Group Inc '144A' 3.477% 12-Apr-2026	4.701	0,01
20.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 2.226% 25-May-2026	18.401	0,04
15.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 3.153% 16-Jul-2030	12.907	0,03
15.000	Molson Coors Beverage Co 3.000% 15-Jul-2026	13.957	0,03
15.000	Molson Coors Beverage Co 5.000% 01-May-2042	13.447	0,03
20.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV '144A' 2.250% 19-Sep-2024	19.041	0,04
10.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV '144A' 4.250% 15-Sep-2025	9.877	0,02
15.000	Mondelez International Inc 2.750% 13-Apr-2030	12.991	0,03
5.000	Montefiore Obligated Group 5.246% 01-Nov-2048	3.777	0,01
25.000	Moody's Corp 3.750% 25-Feb-2052	19.315	0,04
5.000	Moody's Corp 4.250% 01-Feb-2029	4.806	0,01
5.000	Morgan Stanley 3.625% 20-Jan-2027	4.728	0,01
15.000	Morgan Stanley 3.875% 29-Apr-2024	14.780	0,03
10.000	Morgan Stanley 3.950% 23-Apr-2027	9.475	0,02
25.000	Morgan Stanley 7.250% 01-Apr-2032	28.322	0,06
20.000	Morgan Stanley Domestic Holdings Inc 4.500% 20-Jun-2028	19.521	0,04
20.000	Morgan Stanley FRN 1.593% 04-May-2027	17.589	0,04
20.000	Morgan Stanley FRN 2.188% 28-Apr-2026	18.617	0,04
10.000	Morgan Stanley FRN 2.484% 16-Sep-2036	7.299	0,02
40.000	Morgan Stanley FRN 2.630% 18-Feb-2026	37.626	0,08
20.000	Morgan Stanley FRN 2.943% 21-Jan-2033	16.288	0,03
15.000	Morgan Stanley FRN 3.217% 22-Apr-2042	11.183	0,02
10.000	Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028	9.226	0,02
40.000	Morgan Stanley FRN 3.620% 17-Apr-2025	39.066	0,08
10.000	Morgan Stanley FRN 3.971% 22-Jul-2038	8.481	0,02
25.000	Morgan Stanley FRN 5.297% 20-Apr-2037	23.002	0,05
20.000	Morgan Stanley FRN 6.342% 18-Oct-2033	21.067	0,05
20.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3.700% 23-Oct-2024	19.544	0,04
5.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3.875% 27-Jan-2026	4.843	0,01
5.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4.000% 23-Jul-2025	4.894	0,01
20.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4.350% 08-Sep-2026	19.463	0,04
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031	8.308	0,02
40.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 3.772% 24-Jan-2029	36.761	0,08
10.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 4.431% 23-Jan-2030	9.379	0,02
5.000	Morgan Stanley 'MTN' 3.125% 27-Jul-2026	4.677	0,01
25.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 1.164% 21-Oct-2025	22.995	0,05
15.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 1.928% 28-Apr-2032	11.391	0,02
15.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 2.720% 22-Jul-2025	14.355	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN 3.622% 01-Apr-2031	17.555	0,04
10.000	Motorola Solutions Inc 2.750% 24-May-2031	8.046	0,02
12.000	Motorola Solutions Inc 4.000% 01-Sep-2024	11.792	0,03
10.000	Motorola Solutions Inc 4.600% 23-May-2029	9.562	0,02
20.000	Mount Nittany Medical Center Obligated Group 3.799% 15-Nov-2052	15.305	0,03
35.000	MPLX LP 1.750% 01-Mar-2026	31.281	0,07
5.000	MPLX LP 4.500% 15-Apr-2038	4.253	0,01
40.000	MPLX LP 4.875% 01-Jun-2025	39.454	0,08
20.000	MPLX LP 4.950% 14-Mar-2052	16.547	0,04
5.000	MPLX LP 5.200% 01-Mar-2047	4.290	0,01
5.000	MPLX LP 5.500% 15-Feb-2049	4.451	0,01
10.000	MUFG Bank Ltd '144A' 4.700% 10-Mar-2044	8.935	0,02
20.000	Mutual of Omaha Insurance Co '144A' FRN 4.297% 15-Jul-2054	19.064	0,04
10.000	Narragansett Electric Co/The '144A' 5.638% 15-Mar-2040	9.706	0,02
10.000	Nasdaq Inc 3.850% 30-Jun-2026	9.679	0,02
20.000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.332% 21-Aug-2030	15.269	0,03
10.000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.990% 21-May-2031	7.876	0,02
20.000	National Australia Bank Ltd '144A' 3.500% 10-Jan-2027	18.972	0,04
10.000	National Australia Bank Ltd '144A' FRN 3.933% 02-Aug-2034	8.460	0,02
20.000	National Australia Bank Ltd/New York 'BKNT' 2.500% 12-Jul-2026	18.470	0,04
10.000	National Bank of Canada 0.750% 06-Aug-2024	9.311	0,02
15.000	National Fuel Gas Co 2.950% 01-Mar-2031	11.826	0,03
5.000	National Fuel Gas Co 3.950% 15-Sep-2027	4.630	0,01
5.000	National Fuel Gas Co 5.200% 15-Jul-2025	4.983	0,01
25.000	National Retail Properties Inc 3.500% 15-Oct-2027	22.751	0,05
10.000	National Retail Properties Inc 3.900% 15-Jun-2024	9.772	0,02
20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 2.950% 07-Feb-2024	19.558	0,04
10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 4.023% 01-Nov-2032	9.153	0,02
20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp FRN 5.250% 20-Apr-2046	18.025	0,04
20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 'MTN' 3.450% 15-Jun-2025	19.327	0,04
10.000	National Securities Clearing Corp '144A' 0.750% 07-Dec-2025	8.880	0,02
10.000	National Securities Clearing Corp '144A' 5.050% 21-Nov-2024	9.996	0,02
35.000	Nationwide Building Society '144A' 3.900% 21-Jul-2025	33.718	0,07
10.000	Nationwide Building Society '144A' FRN 4.125% 18-Oct-2032	8.891	0,02
5.000	Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 9.375% 15-Aug-2039	6.487	0,01
20.000	NatWest Group Plc 4.800% 05-Apr-2026	19.546	0,04
10.000	NatWest Group Plc FRN 3.032% 28-Nov-2035	7.402	0,02
10.000	NatWest Group Plc FRN 5.076% 27-Jan-2030	9.462	0,02
20.000	NatWest Group Plc FRN 5.516% 30-Sep-2028	19.834	0,04
10.000	NatWest Markets Plc '144A' 3.479% 22-Mar-2025	9.578	0,02
20.000	Nestle Holdings Inc '144A' 0.606% 14-Sep-2024	18.667	0,04
20.000	Nestle Holdings Inc '144A' 1.000% 15-Sep-2027	16.996	0,04
5.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.500% 24-Sep-2025	4.860	0,01
5.000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.900% 24-Sep-2038	4.492	0,01
20.000	Nestle Holdings Inc '144A' 4.300% 01-Oct-2032	19.732	0,04
10.000	Nevada Power Co 6.750% 01-Jul-2037	11.076	0,02
20.000	New England Power Co '144A' 2.807% 06-Oct-2050	12.280	0,03
5.000	New York and Presbyterian Hospital/The 3.954% 01-Aug-2119	3.510	0,01
30.000	New York Life Global Funding '144A' 0.950% 24-Jun-2025	27.214	0,06
5.000	New York Life Global Funding '144A' 2.000% 22-Jan-2025	4.710	0,01
15.000	New York Life Insurance Co '144A' 6.750% 15-Nov-2039	16.873	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	New York State Electric & Gas Corp '144A' 2.150% 01-Oct-2031	7.846	0,02
10.000	New York State Electric & Gas Corp '144A' 3.250% 01-Dec-2026	9.437	0,02
25.000	Newmont Corp 2.600% 15-Jul-2032	20.047	0,04
5.000	Newmont Corp 2.800% 01-Oct-2029	4.271	0,01
5.000	Newmont Corp 4.875% 15-Mar-2042	4.594	0,01
5.000	Newmont Corp 6.250% 01-Oct-2039	5.269	0,01
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 2.750% 01-Nov-2029	4.347	0,01
60.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.550% 01-May-2027	56.703	0,12
20.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 4.200% 20-Jun-2024	19.756	0,04
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 4.255% 01-Sep-2024	9.886	0,02
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 4.625% 15-Jul-2027	9.865	0,02
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc '144A' 5.110% 29-Sep-2057	10.001	0,02
10.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 3.800% 15-Mar-2082	8.172	0,02
5.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 4.800% 01-Dec-2077	4.098	0,01
10.000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15-Aug-2027	9.529	0,02
20.000	NIKE Inc 2.850% 27-Mar-2030	17.967	0,04
20.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 4.700% 20-Jan-2046	19.252	0,04
10.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 5.100% 16-Oct-2044	9.784	0,02
20.000	NiSource Inc 0.950% 15-Aug-2025	18.065	0,04
10.000	NiSource Inc 1.700% 15-Feb-2031	7.678	0,02
5.000	NiSource Inc 4.375% 15-May-2047	4.236	0,01
10.000	NiSource Inc 5.000% 15-Jun-2052	9.194	0,02
15.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 3.522% 17-Sep-2025	13.960	0,03
20.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.345% 17-Sep-2027	18.186	0,04
10.000	Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.810% 17-Sep-2030	8.533	0,02
10.000	Nordea Bank Abp '144A' 0.750% 28-Aug-2025	8.940	0,02
10.000	Nordea Bank Abp '144A' FRN 4.625% 13-Sep-2033	9.230	0,02
15.000	Norfolk Southern Corp 2.550% 01-Nov-2029	12.922	0,03
10.000	Norfolk Southern Corp 3.700% 15-Mar-2053	7.623	0,02
5.000	Norfolk Southern Corp 3.850% 15-Jan-2024	4.953	0,01
10.000	Norfolk Southern Corp 3.942% 01-Nov-2047	8.114	0,02
15.000	Norfolk Southern Corp 4.050% 15-Aug-2052	12.191	0,03
10.000	Norfolk Southern Corp 4.550% 01-Jun-2053	8.817	0,02
10.000	Norfolk Southern Corp 4.650% 15-Jan-2046	8.952	0,02
5.000	Norfolk Southern Corp 4.837% 01-Oct-2041	4.644	0,01
10.000	Norinchukin Bank/The '144A' 2.080% 22-Sep-2031	7.773	0,02
25.000	Northern Trust Corp 4.000% 10-May-2027	24.484	0,05
10.000	Northrop Grumman Corp 2.930% 15-Jan-2025	9.605	0,02
15.000	Northrop Grumman Corp 3.250% 15-Jan-2028	13.884	0,03
5.000	Northrop Grumman Corp 4.030% 15-Oct-2047	4.190	0,01
5.000	Northrop Grumman Corp 4.750% 01-Jun-2043	4.675	0,01
25.000	Northrop Grumman Corp 5.150% 01-May-2040	24.484	0,05
10.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 3.625% 30-Sep-2059	6.989	0,01
10.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 6.063% 30-Mar-2040	10.322	0,02
10.000	Novartis Capital Corp 2.000% 14-Feb-2027	9.122	0,02
20.000	Novartis Capital Corp 3.000% 20-Nov-2025	19.211	0,04
10.000	Novartis Capital Corp 3.400% 06-May-2024	9.806	0,02
10.000	NRG Energy Inc '144A' 2.450% 02-Dec-2027	8.312	0,02
20.000	NTT Finance Corp '144A' 1.162% 03-Apr-2026	17.725	0,04
10.000	Nucor Corp 5.200% 01-Aug-2043	9.542	0,02
15.000	Nutrien Ltd 5.875% 01-Dec-2036	15.384	0,03
25.000	Nuveen LLC '144A' 4.000% 01-Nov-2028	23.312	0,05
25.000	NVIDIA Corp 1.550% 15-Jun-2028	21.434	0,05
5.000	NVIDIA Corp 2.850% 01-Apr-2030	4.378	0,01
15.000	NVR Inc 3.000% 15-May-2030	12.663	0,03
50.000	NXP BV / NXP Funding LLC 4.875% 01-Mar-2024	49.656	0,11
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 2.500% 11-May-2031	16.032	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 2.650% 15-Feb-2032	15.758	0,03
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 3.150% 01-May-2027	18.176	0,04
10.000	Oglethorpe Power Corp '144A' 6.191% 01-Jan-2031	10.100	0,02
10.000	Omega Healthcare Investors Inc 3.375% 01-Feb-2031	7.742	0,02
15.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 15-Jan-2025	14.596	0,03
10.000	Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 01-Apr-2027	9.408	0,02
25.000	Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc 3.600% 15-Apr-2026	24.052	0,05
18.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 5.250% 30-Sep-2040	18.033	0,04
5.000	ONEOK Inc 4.950% 13-Jul-2047	4.074	0,01
50.000	ONEOK Inc 5.850% 15-Jan-2026	50.707	0,11
5.000	ONEOK Inc 7.150% 15-Jan-2051	5.138	0,01
5.000	ONEOK Partners LP 6.125% 01-Feb-2041	4.762	0,01
5.000	ONEOK Partners LP 6.200% 15-Sep-2043	4.796	0,01
5.000	ONEOK Partners LP 6.850% 15-Oct-2037	5.076	0,01
55.000	Oracle Corp 1.650% 25-Mar-2026	49.408	0,11
15.000	Oracle Corp 2.300% 25-Mar-2028	13.042	0,03
20.000	Oracle Corp 2.500% 01-Apr-2025	18.865	0,04
20.000	Oracle Corp 2.650% 15-Jul-2026	18.430	0,04
10.000	Oracle Corp 2.800% 01-Apr-2027	9.144	0,02
10.000	Oracle Corp 2.875% 25-Mar-2031	8.345	0,02
25.000	Oracle Corp 2.950% 15-Nov-2024	24.108	0,05
30.000	Oracle Corp 2.950% 15-May-2025	28.511	0,06
20.000	Oracle Corp 3.250% 15-Nov-2027	18.432	0,04
25.000	Oracle Corp 3.400% 08-Jul-2024	24.392	0,05
10.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2040	7.470	0,02
10.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2050	6.822	0,01
15.000	Oracle Corp 3.650% 25-Mar-2041	11.181	0,02
10.000	Oracle Corp 3.800% 15-Nov-2037	7.992	0,02
10.000	Oracle Corp 3.850% 15-Jul-2036	8.255	0,02
30.000	Oracle Corp 3.850% 01-Apr-2060	20.225	0,04
10.000	Oracle Corp 3.900% 15-May-2035	8.436	0,02
10.000	Oracle Corp 3.950% 25-Mar-2051	7.214	0,02
10.000	Oracle Corp 4.000% 15-Jul-2046	7.384	0,02
10.000	Oracle Corp 4.000% 15-Nov-2047	7.406	0,02
5.000	Oracle Corp 4.100% 25-Mar-2061	3.516	0,01
15.000	Oracle Corp 4.125% 15-May-2045	11.443	0,02
35.000	Oracle Corp 4.375% 15-May-2055	27.143	0,06
15.000	Oracle Corp 5.375% 15-Jul-2040	13.950	0,03
10.000	Oracle Corp 6.500% 15-Apr-2038	10.454	0,02
20.000	Orange SA 5.375% 13-Jan-2042	19.537	0,04
10.000	Orange SA 9.000% 01-Mar-2031	12.299	0,03
10.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044	8.687	0,02
15.000	O'Reilly Automotive Inc 3.900% 01-Jun-2029	14.033	0,03
10.000	O'Reilly Automotive Inc 4.350% 01-Jun-2028	9.744	0,02
40.000	ORIX Corp 2.250% 09-Mar-2031	31.531	0,07
5.000	ORIX Corp 3.250% 04-Dec-2024	4.821	0,01
15.000	ORIX Corp 3.700% 18-Jul-2027	14.076	0,03
5.000	ORIX Corp 4.050% 16-Jan-2024	4.932	0,01
35.000	Otis Worldwide Corp 2.293% 05-Apr-2027	31.424	0,07
10.000	Otis Worldwide Corp 2.565% 15-Feb-2030	8.447	0,02
10.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd '144A' FRN 1.832% 10-Sep-2030	8.987	0,02
20.000	Owl Rock Capital Corp 3.750% 22-Jul-2025	18.512	0,04
10.000	OWL Rock Core Income Corp 3.125% 23-Sep-2026	8.534	0,02
20.000	Pacific Gas and Electric Co 2.500% 01-Feb-2031	15.674	0,03
25.000	Pacific Gas and Electric Co 3.250% 16-Feb-2024	24.420	0,05
40.000	Pacific Gas and Electric Co 3.300% 01-Aug-2040	27.373	0,06
5.000	Pacific Gas and Electric Co 3.500% 01-Aug-2050	3.179	0,01
15.000	Pacific Gas and Electric Co 4.500% 01-Jul-2040	11.837	0,03
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.550% 01-Jul-2030	9.117	0,02
10.000	Pacific Gas and Electric Co 4.600% 15-Jun-2043	7.636	0,02
25.000	Pacific Gas and Electric Co 4.950% 08-Jun-2025	24.657	0,05
20.000	Pacific Gas and Electric Co 4.950% 01-Jul-2050	15.678	0,03
20.000	Pacific Gas and Electric Co 5.250% 01-Mar-2052	16.384	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Pacific Gas and Electric Co 5.900% 15-Jun-2032	19.655	0,04
10.000	Pacific LifeCorp '144A' 3.350% 15-Sep-2050	6.884	0,01
25.000	PacifiCorp 2.900% 15-Jun-2052	16.577	0,04
5.000	PacifiCorp 3.600% 01-Apr-2024	4.916	0,01
10.000	PacifiCorp 7.700% 15-Nov-2031	11.736	0,03
10.000	Packaging Corp of America 3.000% 15-Dec-2029	8.603	0,02
15.000	Packaging Corp of America 3.650% 15-Sep-2024	14.630	0,03
15.000	Panasonic Holdings Corp '144A' 2.679% 19-Jul-2024	14.376	0,03
15.000	Paramount Global 4.950% 19-May-2050	11.042	0,02
15.000	Paramount Global 5.850% 01-Sep-2043	12.576	0,03
10.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.500% 15-Feb-2024	9.877	0,02
50.000	Parker-Hannifin Corp 3.250% 01-Mar-2027	46.851	0,10
5.000	Parker-Hannifin Corp 4.100% 01-Mar-2047	4.038	0,01
10.000	PartnerRe Finance B LLC 3.700% 02-Jul-2029	9.066	0,02
5.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.700% 01-Nov-2024	4.719	0,01
15.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.350% 01-Nov-2029	12.696	0,03
25.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 4.400% 01-Jul-2027	23.797	0,05
15.000	Pentair Finance Sarl 4.500% 01-Jul-2029	13.954	0,03
10.000	PepsiCo Inc 1.950% 21-Oct-2031	8.134	0,02
20.000	PepsiCo Inc 2.250% 19-Mar-2025	19.046	0,04
10.000	PepsiCo Inc 2.750% 19-Mar-2030	8.886	0,02
15.000	PepsiCo Inc 3.500% 17-Jul-2025	14.628	0,03
15.000	PepsiCo Inc 3.500% 19-Mar-2040	12.643	0,03
15.000	PepsiCo Inc 3.900% 18-Jul-2032	14.232	0,03
40.000	PerkinElmer Inc 3.300% 15-Sep-2029	34.992	0,08
20.000	Pernod Ricard International Finance LLC '144A' 2.750% 01-Oct-2050	12.882	0,03
20.000	Pfizer Inc 0.800% 28-May-2025	18.302	0,04
25.000	Pfizer Inc 2.550% 28-May-2040	18.342	0,04
50.000	Pfizer Inc 3.600% 15-Sep-2028	48.006	0,10
10.000	Pfizer Inc 7.200% 15-Mar-2039	12.207	0,03
50.000	Philip Morris International Inc 0.875% 01-May-2026	44.065	0,09
5.000	Philip Morris International Inc 1.750% 01-Nov-2030	3.938	0,01
10.000	Philip Morris International Inc 2.100% 01-May-2030	8.137	0,02
5.000	Philip Morris International Inc 3.125% 17-Aug-2027	4.644	0,01
5.000	Philip Morris International Inc 3.375% 11-Aug-2025	4.811	0,01
5.000	Philip Morris International Inc 3.375% 15-Aug-2029	4.526	0,01
15.000	Philip Morris International Inc 4.500% 20-Mar-2042	12.790	0,03
5.000	Philip Morris International Inc 6.375% 16-May-2038	5.364	0,01
5.000	Phillips 66 4.875% 15-Nov-2044	4.624	0,01
10.000	Phillips 66 5.875% 01-May-2042	10.356	0,02
20.000	Phillips 66 Co '144A' 4.900% 01-Oct-2046	17.921	0,04
5.000	Physicians Realty LP 3.950% 15-Jan-2028	4.583	0,01
20.000	Piedmont Natural Gas Co Inc 3.500% 01-Jun-2029	18.410	0,04
10.000	Piedmont Natural Gas Co Inc 3.640% 01-Nov-2046	7.235	0,02
20.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 5.875% 30-Sep-2027	19.434	0,04
20.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 3.600% 01-Nov-2024	19.360	0,04
10.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 3.800% 15-Sep-2030	8.739	0,02
5.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.900% 15-Feb-2045	3.942	0,01
85.000	PNC Bank NA 'BKNT' 4.200% 01-Nov-2025	82.990	0,18
10.000	PNC Financial Services Group Inc/The 2.550% 22-Jan-2030	8.534	0,02
20.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN 4.626% 06-Jun-2033	18.597	0,04
19.578	Polar Tankers Inc '144A' 5.951% 10-May-2037	19.909	0,04
20.000	POSCO 'REGS' 4.500% 04-Aug-2027	18.838	0,04
20.000	PPG Industries Inc 2.400% 15-Aug-2024	19.154	0,04
50.000	PPL Capital Funding Inc 3.100% 15-May-2026	46.847	0,10

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Precision Castparts Corp 3.250% 15-Jun-2025	9.655	0,02
10.000	President and Fellows of Harvard College 2.517% 15-Oct-2050	6.598	0,01
10.000	Principal Financial Group Inc 3.700% 15-May-2029	9.316	0,02
10.000	Principal Life Global Funding II '144A' 1.375% 10-Jan-2025	9.264	0,02
15.000	Principal Life Global Funding II '144A' 2.250% 21-Nov-2024	14.185	0,03
40.000	Procter & Gamble Co/The 1.950% 23-Apr-2031	33.497	0,07
5.000	Procter & Gamble Co/The 2.700% 02-Feb-2026	4.750	0,01
5.000	Procter & Gamble Co/The 5.550% 05-Mar-2037	5.429	0,01
10.000	Progress Energy Inc 7.000% 30-Oct-2031	10.971	0,02
10.000	Progress Energy Inc 7.750% 01-Mar-2031	11.390	0,02
5.000	Progressive Corp/The 4.000% 01-Mar-2029	4.817	0,01
10.000	Prologis LP 1.750% 01-Feb-2031	7.896	0,02
10.000	Prologis LP 4.375% 01-Feb-2029	9.570	0,02
15.000	Prospect Capital Corp 3.364% 15-Nov-2026	12.469	0,03
5.000	Prospect Capital Corp 3.437% 15-Oct-2028	3.844	0,01
20.000	Prospect Capital Corp 3.706% 22-Jan-2026	17.543	0,04
30.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	24.993	0,05
20.000	Prosus NV 'REGS' 4.987% 19-Jan-2052	14.534	0,03
10.000	Protective Life Corp '144A' 5.350% 10-Aug-2052	8.918	0,02
10.000	Protective Life Global Funding '144A' 1.303% 20-Sep-2026	8.681	0,02
10.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.700% 01-Oct-2051	5.993	0,01
30.000	Prudential Financial Inc FRN 3.700% 01-Oct-2050	25.357	0,05
10.000	Prudential Financial Inc FRN 5.200% 15-Mar-2044	9.520	0,02
10.000	Prudential Financial Inc FRN 5.375% 15-May-2045	9.683	0,02
5.000	Prudential Financial Inc FRN 5.700% 15-Sep-2048	4.782	0,01
5.000	Prudential Financial Inc FRN 6.000% 01-Sep-2052	4.865	0,01
5.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 2.100% 10-Mar-2030	4.168	0,01
10.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	8.752	0,02
40.000	Prudential Plc 3.625% 24-Mar-2032	35.150	0,08
10.000	Public Service Co of Colorado 1.875% 15-Jun-2031	8.019	0,02
25.000	Public Service Co of Colorado 3.700% 15-Jun-2028	23.883	0,05
15.000	Public Service Co of Colorado 4.500% 01-Jun-2052	13.630	0,03
30.000	Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 3.650% 01-Sep-2042	24.159	0,05
10.000	Public Service Enterprise Group Inc 2.875% 15-Jun-2024	9.667	0,02
10.000	Public Storage 3.385% 01-May-2029	9.121	0,02
5.000	Puget Energy Inc 3.650% 15-May-2025	4.764	0,01
10.000	Puget Energy Inc 4.100% 15-Jun-2030	8.972	0,02
25.000	PulteGroup Inc 5.500% 01-Mar-2026	25.135	0,05
20.000	QBE Insurance Group Ltd '144A' FRN (Perpetual) 5.875% 12-May-2025	18.907	0,04
20.000	Qorvo Inc 4.375% 15-Oct-2029	17.721	0,04
20.000	QUALCOMM Inc 4.250% 20-May-2032	19.370	0,04
40.000	Quanta Services Inc 2.350% 15-Jan-2032	30.581	0,07
40.000	Quest Diagnostics Inc 2.800% 30-Jun-2031	33.700	0,07
5.000	Quest Diagnostics Inc 2.950% 30-Jun-2030	4.337	0,01
35.000	Raymond James Financial Inc 4.650% 01-Apr-2030	33.890	0,07
5.000	Raytheon Technologies Corp 3.030% 15-Mar-2052	3.441	0,01
25.000	Raytheon Technologies Corp 3.200% 15-Mar-2024	24.533	0,05
10.000	Raytheon Technologies Corp 3.500% 15-Mar-2027	9.552	0,02
5.000	Raytheon Technologies Corp 3.950% 16-Aug-2025	4.895	0,01
10.000	Raytheon Technologies Corp 4.125% 16-Nov-2028	9.611	0,02
5.000	Raytheon Technologies Corp 4.150% 15-May-2045	4.220	0,01
30.000	Raytheon Technologies Corp 4.450% 16-Nov-2038	27.521	0,06
10.000	Raytheon Technologies Corp 4.500% 01-Jun-2042	9.112	0,02
20.000	Raytheon Technologies Corp 4.625% 16-Nov-2048	18.266	0,04
5.000	Raytheon Technologies Corp 4.875% 15-Oct-2040	4.714	0,01
15.000	Raytheon Technologies Corp 5.700% 15-Apr-2040	15.416	0,03
10.000	Realty Income Corp 3.650% 15-Jan-2028	9.360	0,02
10.000	Realty Income Corp 3.875% 15-Jul-2024	9.827	0,02
20.000	Realty Income Corp 4.125% 15-Oct-2026	19.507	0,04
10.000	Realty Income Corp 4.875% 01-Jun-2026	9.970	0,02
20.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc '144A' 2.750% 26-Jun-2024	19.344	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc '144A' 3.000% 26-Jun-2027	9.289	0,02
10.000	Regency Centers LP 3.700% 15-Jun-2030	8.772	0,02
15.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 1.750% 15-Sep-2030	11.688	0,03
5.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 2.800% 15-Sep-2050	3.149	0,01
20.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 2.875% 12-Jan-2032	16.290	0,03
5.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 3.625% 12-Jan-2052	3.316	0,01
15.000	Reliance Industries Ltd 'REGS' 4.125% 28-Jan-2025	14.580	0,03
5.000	RELX Capital Inc 4.000% 18-Mar-2029	4.653	0,01
20.000	RELX Capital Inc 4.750% 20-May-2032	19.349	0,04
5.000	Republic Services Inc 2.300% 01-Mar-2030	4.216	0,01
50.000	Republic Services Inc 2.900% 01-Jul-2026	46.696	0,10
15.000	Republic Services Inc 3.375% 15-Nov-2027	14.024	0,03
50.000	Reynolds American Inc 4.450% 12-Jun-2025	48.988	0,11
5.000	Reynolds American Inc 5.850% 15-Aug-2045	4.304	0,01
5.000	Reynolds American Inc 6.150% 15-Sep-2043	4.505	0,01
10.000	RGA Global Funding '144A' 2.000% 30-Nov-2026	8.874	0,02
20.000	Rio Tinto Alcan Inc 5.750% 01-Jun-2035	20.551	0,04
5.000	Rio Tinto Finance USA Ltd 5.200% 02-Nov-2040	5.035	0,01
5.000	Roche Holdings Inc '144A' 0.991% 05-Mar-2026	4.463	0,01
5.000	Roche Holdings Inc '144A' 1.930% 13-Dec-2028	4.290	0,01
35.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.076% 13-Dec-2031	28.671	0,06
20.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.314% 10-Mar-2027	18.269	0,04
35.000	Rogers Communications Inc 2.900% 15-Nov-2026	32.184	0,07
20.000	Rogers Communications Inc 4.300% 15-Feb-2048	15.272	0,03
20.000	Rogers Communications Inc 5.450% 01-Oct-2043	18.237	0,04
15.000	Rogers Communications Inc '144A' 3.800% 15-Mar-2032	12.909	0,03
20.000	Rogers Communications Inc '144A' FRN 5.250% 15-Mar-2082	17.675	0,04
20.000	Roper Technologies Inc 1.750% 15-Feb-2031	15.505	0,03
40.000	Roper Technologies Inc 2.950% 15-Sep-2029	34.825	0,07
10.000	Royal Bank of Canada 1.200% 27-Apr-2026	8.914	0,02
20.000	Royal Bank of Canada 3.375% 14-Apr-2025	19.358	0,04
10.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2.250% 01-Nov-2024	9.544	0,02
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.240% 03-Aug-2027	48.796	0,10
20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.650% 27-Jan-2026	19.777	0,04
15.000	Royal Bank of Canada 'MTN' 1.150% 10-Jun-2025	13.755	0,03
20.000	Royalty Pharma Plc 1.200% 02-Sep-2025	17.933	0,04
10.000	Royalty Pharma Plc 2.200% 02-Sep-2030	7.865	0,02
35.000	RPM International Inc 4.550% 01-Mar-2029	32.550	0,07
10.000	Ryder System Inc 'MTN' 3.650% 18-Mar-2024	9.803	0,02
10.000	S&P Global Inc 2.950% 22-Jan-2027	9.383	0,02
5.000	S&P Global Inc '144A' 2.700% 01-Mar-2029	4.421	0,01
10.000	S&P Global Inc '144A' 2.900% 01-Mar-2032	8.586	0,02
35.000	S&P Global Inc '144A' 4.750% 01-Aug-2028	34.716	0,07
10.000	Sabal Trail Transmission LLC '144A' 4.682% 01-May-2038	9.039	0,02
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.200% 15-Mar-2028	9.434	0,02
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.500% 15-May-2030	9.318	0,02
20.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.000% 15-Mar-2027	19.665	0,04
20.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01-Mar-2025	20.052	0,04
10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.750% 15-May-2024	10.017	0,02
5.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30-Jun-2026	5.065	0,01
5.000	Salesforce Inc 1.950% 15-Jul-2031	4.011	0,01
15.000	Salesforce Inc 2.700% 15-Jul-2041	10.836	0,02
5.000	Salesforce Inc 3.700% 11-Apr-2028	4.815	0,01
4.000	San Diego Gas & Electric Co 1.700% 01-Oct-2030	3.182	0,01
20.000	Santander Holdings USA Inc 3.450% 02-Jun-2025	19.102	0,04
5.000	Santander Holdings USA Inc 3.500% 07-Jun-2024	4.862	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
10.000	Santander Holdings USA Inc 4.400% 13-Jul-2027	9.567	0,02	
10.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 1.089% 15-Mar-2025	9.351	0,02	
10.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 1.673% 14-Jun-2027	8.526	0,02	
25.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 2.896% 15-Mar-2032	19.436	0,04	
10.000	Santander UK Plc 2.875% 18-Jun-2024	9.666	0,02	
5.000	Santander UK Plc 4.000% 13-Mar-2024	4.925	0,01	
5.000	SBL Holdings Inc '144A' 5.125% 13-Nov-2026	4.393	0,01	
20.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A' 4.375% 28-May-2030	17.779	0,04	
10.000	Scentre Group Trust 2 '144A' FRN 4.750% 24-Sep-2080	8.968	0,02	
20.000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.900% 17-May-2028	18.705	0,04	
10.000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 4.300% 01-May-2029	9.435	0,02	
5.000	Schlumberger Investment SA 2.650% 26-Jun-2030	4.316	0,01	
10.000	Sealed Air Corp '144A' 1.573% 15-Oct-2026	8.659	0,02	
10.000	Sempra Energy 3.250% 15-Jun-2027	9.277	0,02	
5.000	Sempra Energy 6.000% 15-Oct-2039	5.112	0,01	
20.000	Sempra Energy FRN 4.125% 01-Apr-2052	15.705	0,03	
30.000	Sempra Global '144A' 3.250% 15-Jan-2032	24.085	0,05	
10.000	SES GLOBAL Americas Holdings Inc '144A' 5.300% 25-Mar-2044	7.737	0,02	
5.000	Shell International Finance BV 2.500% 12-Sep-2026	4.648	0,01	
50.000	Shell International Finance BV 3.250% 11-May-2025	48.531	0,10	
20.000	Shell International Finance BV 3.250% 06-Apr-2050	14.551	0,03	
20.000	Shell International Finance BV 4.125% 11-May-2035	18.699	0,04	
20.000	Shell International Finance BV 6.375% 15-Dec-2038	22.208	0,05	
20.000	Sherwin-Williams Co/The 2.950% 15-Aug-2029	17.598	0,04	
5.000	Sherwin-Williams Co/The 3.800% 15-Aug-2049	3.755	0,01	
10.000	Sherwin-Williams Co/The 4.050% 08-Aug-2024	9.869	0,02	
5.000	Sherwin-Williams Co/The 4.550% 01-Aug-2045	4.263	0,01	
10.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 3.750% 20-Sep-2027	9.088	0,02	
30.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.200% 23-Sep-2026	28.220	0,06	
35.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 1.200% 11-Mar-2026	31.265	0,07	
20.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.150% 11-Mar-2031	16.382	0,04	
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.350% 15-Oct-2026	9.106	0,02	
5.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.875% 11-Mar-2041	3.728	0,01	
5.000	Sigma Alimentos SA de CV 'REGS' 4.125% 02-May-2026	4.746	0,01	
20.000	Simon Property Group LP 2.450% 13-Sep-2029	16.768	0,04	
20.000	Simon Property Group LP 3.500% 01-Sep-2025	19.187	0,04	
20.000	Simon Property Group LP 6.750% 01-Feb-2040	21.794	0,05	
5.000	Sirius International Group Ltd '144A' 4.600% 01-Nov-2026	4.314	0,01	
20.000	SK Hynix Inc 'REGS' 1.000% 19-Jan-2024	19.010	0,04	
10.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB '144A' 1.200% 09-Sep-2026	8.729	0,02	
20.000	SMBC Aviation Capital Finance DAC '144A' 3.550% 15-Apr-2024	19.350	0,04	
10.000	Smithfield Foods Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2027	9.236	0,02	
35.000	Snap-on Inc 3.250% 01-Mar-2027	33.167	0,07	
10.000	Societe Generale SA '144A' 2.625% 16-Oct-2024	9.474	0,02	
10.000	Societe Generale SA '144A' 2.625% 22-Jan-2025	9.415	0,02	
10.000	Societe Generale SA '144A' 3.875% 28-Mar-2024	9.775	0,02	
15.000	Societe Generale SA '144A' 4.250% 14-Apr-2025	14.407	0,03	
10.000	Societe Generale SA '144A' 4.250% 19-Aug-2026	9.343	0,02	
25.000	Societe Generale SA '144A' 4.677% 15-Jun-2027	24.384	0,05	
12.000	Societe Generale SA '144A' 4.750% 14-Sep-2028	11.384	0,02	
10.000	Societe Generale SA '144A' 5.625% 24-Nov-2045	8.345	0,02	
10.000	Societe Generale SA '144A' FRN 1.488% 14-Dec-2026	8.710	0,02	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
5.000	Societe Generale SA '144A' FRN 2.226% 21-Jan-2026	4.605	0,01	
5.000	Societe Generale SA '144A' FRN 3.337% 21-Jan-2033	3.964	0,01	
5.000	Societe Generale SA '144A' FRN 6.221% 15-Jun-2033	4.708	0,01	
10.000	Sodexo Inc '144A' 2.718% 16-Apr-2031	8.032	0,02	
8.180	Solar Star Funding LLC '144A' 5.375% 30-Jun-2035	7.996	0,02	
40.000	Sonoco Products Co 3.125% 01-May-2030	34.559	0,07	
20.000	Southern California Edison Co 4.200% 01-Jun-2025	19.664	0,04	
10.000	Southern California Edison Co 5.950% 01-Feb-2038	10.184	0,02	
5.000	Southern California Gas Co 2.550% 01-Feb-2030	4.279	0,01	
10.000	Southern Co Gas Capital Corp 1.750% 15-Jan-2031	7.717	0,02	
5.000	Southern Co Gas Capital Corp 4.400% 01-Jun-2043	4.131	0,01	
10.000	Southern Co/The 1.750% 15-Mar-2028	8.453	0,02	
75.000	Southern Co/The 3.250% 01-Jul-2026	70.698	0,15	
25.000	Southern Co/The 4.400% 01-Jul-2046	21.092	0,05	
25.000	Southern Co/The FRN 3.750% 15-Sep-2051	20.249	0,04	
15.000	Southern Co/The FRN 4.000% 15-Jan-2051	13.688	0,03	
10.000	Southern Copper Corp 3.875% 23-Apr-2025	9.667	0,02	
5.000	Southern Copper Corp 5.875% 23-Apr-2045	5.124	0,01	
5.000	Southern Copper Corp 6.750% 16-Apr-2040	5.592	0,01	
10.000	Southwest Airlines Co 5.125% 15-Jun-2027	9.903	0,02	
5.000	Southwest Airlines Co 5.250% 04-May-2025	5.026	0,01	
35.000	Southwest Gas Corp 4.050% 15-Mar-2032	30.932	0,07	
50.000	Southwestern Electric Power Co 1.650% 15-Mar-2026	44.827	0,10	
5.000	Southwestern Electric Power Co 3.900% 01-Apr-2045	3.850	0,01	
10.000	Southwestern Electric Power Co 6.200% 15-Mar-2040	10.249	0,02	
5.000	Spectra Energy Partners LP 4.500% 15-Mar-2045	4.172	0,01	
25.000	Spirit Realty LP 3.200% 15-Jan-2027	22.238	0,05	
9.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20-Mar-2025	8.902	0,02	
10.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 5.152% 20-Mar-2028	9.874	0,02	
10.000	St Marys Cement Inc Canada '144A' 5.750% 28-Jan-2027	10.022	0,02	
5.000	Standard Chartered Bank '144A' 8.000% 30-May-2031	5.258	0,01	
20.000	Standard Chartered Plc '144A' 4.050% 12-Apr-2026	19.348	0,04	
5.000	Standard Chartered Plc '144A' 5.300% 09-Jan-2043	4.231	0,01	
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 1.822% 23-Nov-2025	9.145	0,02	
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.678% 29-Jun-2032	7.565	0,02	
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.819% 30-Jan-2026	18.626	0,04	
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 3.265% 18-Feb-2036	7.439	0,02	
10.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.644% 01-Apr-2031	9.037	0,02	
20.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.866% 15-Mar-2033	17.677	0,04	
10.000	Stanley Black & Decker Inc FRN 4.000% 15-Mar-2060	8.524	0,02	
5.000	Starbucks Corp 2.250% 12-Mar-2030	4.172	0,01	
5.000	Starbucks Corp 2.550% 15-Nov-2030	4.229	0,01	
5.000	Starbucks Corp 3.500% 01-Mar-2028	4.704	0,01	
5.000	Starbucks Corp 3.750% 01-Dec-2047	3.840	0,01	
15.000	Starbucks Corp 3.800% 15-Aug-2025	14.692	0,03	
5.000	Starbucks Corp 4.300% 15-Jun-2045	4.280	0,01	
10.000	Starbucks Corp 4.500% 15-Nov-2048	8.687	0,02	
20.000	State Street Corp FRN 2.901% 30-Mar-2026	19.030	0,04	
20.000	State Street Corp FRN 3.031% 01-Nov-2034	16.915	0,04	
25.000	Steel Dynamics Inc 5.000% 15-Dec-2026	25.032	0,05	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 1.711% 29-Jan-2027	17.209	0,04
5.000	Stryker Corp 3.375% 01-Nov-2025	4.832	0,01
5.000	Stryker Corp 3.500% 15-Mar-2026	4.810	0,01
20.000	Stryker Corp 3.650% 07-Mar-2028	19.085	0,04
40.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.402% 17-Sep-2026	34.930	0,07
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.474% 08-Jul-2025	9.128	0,02
10.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.130% 08-Jul-2030	7.952	0,02
35.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.472% 14-Jan-2029	29.609	0,06
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.632% 14-Jul-2026	4.590	0,01
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.696% 16-Jul-2024	4.800	0,01
6.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.724% 27-Sep-2029	5.091	0,01
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.750% 15-Jan-2030	4.218	0,01
13.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.040% 16-Jul-2029	11.300	0,02
20.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.364% 12-Jul-2027	18.500	0,04
5.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.944% 19-Jul-2028	4.718	0,01
5.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A' 0.850% 25-Mar-2024	4.733	0,01
20.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A' 1.050% 12-Sep-2025	17.870	0,04
20.000	Summa Health 3.511% 15-Nov-2051	13.654	0,03
25.000	Summit Digital Infrastructure Ltd 'REGS' 2.875% 12-Aug-2031	19.300	0,04
10.000	Suncor Energy Inc 6.500% 15-Jun-2038	10.346	0,02
10.000	Sutter Health 1.321% 15-Aug-2025	9.097	0,02
40.000	Suzano Austria GmbH 2.500% 15-Sep-2028	33.712	0,07
7.000	Suzano Austria GmbH 3.750% 15-Jan-2031	5.891	0,01
20.000	Suzano Austria GmbH 6.000% 15-Jan-2029	19.936	0,04
5.000	SVB Financial Group 3.500% 29-Jan-2025	4.808	0,01
25.000	SVB Financial Group FRN 4.570% 29-Apr-2033	22.262	0,05
20.000	Svenska Handelsbanken AB '144A' 3.950% 10-Jun-2027	19.220	0,04
10.000	Swedbank AB '144A' 3.356% 04-Apr-2025	9.620	0,02
10.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd '144A' 3.375% 30-Apr-2025	9.496	0,02
10.000	Synchrony Financial 2.875% 28-Oct-2031	7.545	0,02
10.000	Synchrony Financial 4.250% 15-Aug-2024	9.781	0,02
20.000	Synchrony Financial 4.500% 23-Jul-2025	19.217	0,04
20.000	Synchrony Financial 5.150% 19-Mar-2029	19.014	0,04
20.000	Sysco Corp 3.300% 15-Jul-2026	18.914	0,04
10.000	Sysco Corp 4.500% 01-Apr-2046	8.491	0,02
25.000	Sysco Corp 5.375% 21-Sep-2035	24.548	0,05
10.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.050% 31-Mar-2030	8.211	0,02
15.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.025% 09-Jul-2040	11.131	0,02
15.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.375% 09-Jul-2060	10.192	0,02
10.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 5.000% 26-Nov-2028	9.956	0,02
15.000	Take-Two Interactive Software Inc 3.300% 28-Mar-2024	14.656	0,03
20.000	Take-Two Interactive Software Inc 3.700% 14-Apr-2027	18.879	0,04
20.000	Take-Two Interactive Software Inc 4.000% 14-Apr-2032	17.823	0,04
10.000	Tampa Electric Co 3.875% 12-Jul-2024	9.813	0,02
20.000	Targa Resources Corp 5.200% 01-Jul-2027	19.664	0,04
20.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.000% 15-Jan-2032	16.824	0,04
10.000	Target Corp 2.950% 15-Jan-2052	6.972	0,01
20.000	Target Corp 3.375% 15-Apr-2029	18.606	0,04
10.000	TC PipeLines LP 4.375% 13-Mar-2025	9.800	0,02
10.000	Teck Resources Ltd 5.400% 01-Feb-2043	8.975	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
20.000	Teledyne Technologies Inc 2.750% 01-Apr-2031	16.452	0,04
5.000	Telstra Corp Ltd '144A' 3.125% 07-Apr-2025	4.823	0,01
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2.390% 03-Jun-2030	8.178	0,02
70.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.280% 11-Apr-2024	68.356	0,15
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.290% 03-Jun-2060	6.065	0,01
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.595% 19-Jan-2028	9.198	0,02
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.925% 19-Jan-2038	8.027	0,02
10.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	9.247	0,02
30.000	Tennessee Gas Pipeline Co LLC 7.625% 01-Apr-2037	32.905	0,07
5.000	Tennessee Gas Pipeline Co LLC '144A' 2.900% 01-Mar-2030	4.212	0,01
5.000	Texas Eastern Transmission LP 7.000% 15-Jul-2032	5.492	0,01
5.000	Texas Instruments Inc 1.750% 04-May-2030	4.137	0,01
10.000	Texas Instruments Inc 3.875% 15-Mar-2039	8.901	0,02
10.000	Texas Instruments Inc 4.100% 16-Aug-2052	9.028	0,02
10.000	Textron Inc 3.375% 01-Mar-2028	9.131	0,02
20.000	Thailand Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.500% 18-Jun-2030	15.670	0,03
30.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.215% 18-Oct-2024	28.189	0,06
15.000	Thermo Fisher Scientific Inc 5.300% 01-Feb-2044	15.257	0,03
5.000	Thomson Reuters Corp 5.500% 15-Aug-2035	4.785	0,01
5.000	Thomson Reuters Corp 5.850% 15-Apr-2040	4.870	0,01
30.000	Time Warner Cable LLC 4.500% 15-Sep-2042	22.180	0,05
5.000	Time Warner Cable LLC 5.500% 01-Sep-2041	4.183	0,01
5.000	Time Warner Cable LLC 5.875% 15-Nov-2040	4.397	0,01
5.000	Time Warner Cable LLC 6.550% 01-May-2037	4.798	0,01
5.000	Time Warner Cable LLC 7.300% 01-Jul-2038	4.993	0,01
5.000	Timken Co/The 3.875% 01-Sep-2024	4.880	0,01
40.000	T-Mobile USA Inc 1.500% 15-Feb-2026	35.916	0,08
20.000	T-Mobile USA Inc 2.050% 15-Feb-2028	17.244	0,04
20.000	T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026	18.224	0,04
10.000	T-Mobile USA Inc 2.550% 15-Feb-2031	8.224	0,02
20.000	T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Feb-2029	16.965	0,04
30.000	T-Mobile USA Inc 3.000% 15-Feb-2041	21.315	0,05
10.000	T-Mobile USA Inc 3.300% 15-Feb-2051	6.722	0,01
55.000	T-Mobile USA Inc 3.400% 15-Oct-2052	37.457	0,08
25.000	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2025	24.080	0,05
10.000	T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027	9.447	0,02
15.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	13.659	0,03
10.000	T-Mobile USA Inc 4.375% 15-Apr-2040	8.623	0,02
10.000	T-Mobile USA Inc 4.500% 15-Apr-2050	8.286	0,02
60.000	Toronto-Dominion Bank/The 0.550% 04-Mar-2024	57.026	0,12
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 1.250% 13-Dec-2024	9.317	0,02
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 3.766% 06-Jun-2025	4.856	0,01
15.000	Toronto-Dominion Bank/The 4.108% 08-Jun-2027	14.516	0,03
50.000	Toronto-Dominion Bank/The FRN 3.625% 15-Sep-2031	46.176	0,10
19.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 2.650% 12-Jun-2024	18.398	0,04
20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 3.200% 10-Mar-2032	17.336	0,04
5.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 4.285% 13-Sep-2024	4.947	0,01
5.000	TotalEnergies Capital International SA 2.829% 10-Jan-2030	4.438	0,01
5.000	TotalEnergies Capital International SA 3.455% 19-Feb-2029	4.659	0,01
15.000	Toyota Motor Corp 3.669% 20-Jul-2028	14.269	0,03
25.000	Toyota Motor Credit Corp 0.625% 13-Sep-2024	23.292	0,05
40.000	Toyota Motor Credit Corp 1.900% 12-Sep-2031	31.802	0,07
5.000	Toyota Motor Credit Corp 3.350% 08-Jan-2024	4.937	0,01
5.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 1.150% 13-Aug-2027	4.268	0,01
50.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 2.400% 13-Jan-2032	41.294	0,09
5.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3.000% 01-Apr-2025	4.809	0,01
5.000	Trane Technologies Global Holding Co Ltd 5.750% 15-Jun-2043	4.967	0,01
10.000	Trans-Allegheny Interstate Line Co '144A' 3.850% 01-Jun-2025	9.670	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.625% 01-Mar-2034	9.182	0,02
5.000	TransCanada PipeLines Ltd 4.750% 15-May-2038	4.496	0,01
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 5.850% 15-Mar-2036	9.910	0,02
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 7.625% 15-Jan-2039	11.549	0,02
60.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.850% 01-Feb-2026	64.164	0,14
10.000	Transurban Finance Co Pty Ltd '144A' 3.375% 22-Mar-2027	9.182	0,02
10.000	Travelers Cos Inc/The 'MTN' 6.250% 15-Jun-2037	10.889	0,02
50.000	Trinity Acquisition Plc 4.400% 15-Mar-2026	48.616	0,10
5.000	Tri-State Generation and Transmission Association Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2040	4.565	0,01
20.000	Triton Container International Ltd '144A' 2.050% 15-Apr-2026	17.411	0,04
10.000	Truist Bank 3.200% 01-Apr-2024	9.771	0,02
5.000	Truist Bank 'BKNT' 2.250% 11-Mar-2030	4.065	0,01
25.000	Truist Bank 'BKNT' FRN 2.636% 17-Sep-2029	23.406	0,05
15.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 4.123% 06-Jun-2028	14.362	0,03
5.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 4.260% 28-Jul-2026	4.922	0,01
10.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN 6.123% 28-Oct-2033	10.591	0,02
10.000	Trust Fibrá Uno 'REGS' 6.390% 15-Jan-2050	8.088	0,02
5.000	Trust Fibrá Uno 'REGS' 6.950% 30-Jan-2044	4.349	0,01
5.000	TSMC Arizona Corp 2.500% 25-Oct-2031	4.144	0,01
5.000	TSMC Arizona Corp 3.125% 25-Oct-2041	3.934	0,01
20.000	TSMC Arizona Corp 3.875% 22-Apr-2027	19.285	0,04
20.000	TSMC Arizona Corp 4.125% 22-Apr-2029	19.082	0,04
20.000	TSMC Arizona Corp 4.250% 22-Apr-2032	19.525	0,04
20.000	Tucson Electric Power Co 1.500% 01-Aug-2030	15.398	0,03
35.000	Tyco Electronics Group SA 3.700% 15-Feb-2026	33.751	0,07
5.000	Tyson Foods Inc 3.550% 02-Jun-2027	4.702	0,01
5.000	Tyson Foods Inc 3.950% 15-Aug-2024	4.924	0,01
10.000	Tyson Foods Inc 4.550% 02-Jun-2047	8.668	0,02
5.000	Tyson Foods Inc 5.100% 28-Sep-2048	4.672	0,01
20.000	UBS AG/London '144A' 1.250% 01-Jun-2026	17.523	0,04
20.000	UBS Group AG '144A' 4.125% 24-Sep-2025	19.484	0,04
5.000	UBS Group AG '144A' 4.125% 15-Apr-2026	4.808	0,01
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 1.494% 10-Aug-2027	17.254	0,04
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 2.095% 11-Feb-2032	15.086	0,03
10.000	UBS Group AG '144A' FRN 2.746% 11-Feb-2033	7.781	0,02
15.000	UBS Group AG '144A' FRN 3.179% 11-Feb-2043	10.423	0,02
5.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.490% 05-Aug-2025	4.920	0,01
5.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.703% 05-Aug-2027	4.845	0,01
15.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.751% 12-May-2028	14.399	0,03
20.000	UBS Group AG '144A' FRN 4.988% 05-Aug-2033	18.638	0,04
5.000	UDR Inc 3.100% 01-Nov-2034	3.819	0,01
25.000	UDR Inc 'MTN' 2.950% 01-Sep-2026	23.013	0,05
10.000	UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	8.004	0,02
20.000	UMass Memorial Health Care Obligated Group 5.363% 01-Jul-2052	18.676	0,04
10.000	UniCredit SpA '144A' 4.625% 12-Apr-2027	9.386	0,02
10.000	UniCredit SpA '144A' FRN 1.982% 03-Jun-2027	8.565	0,02
10.000	UniCredit SpA '144A' FRN 2.569% 22-Sep-2026	8.872	0,02
20.000	Unilever Capital Corp 1.375% 14-Sep-2030	15.724	0,03
10.000	Unilever Capital Corp 1.750% 12-Aug-2031	7.912	0,02
10.000	Unilever Capital Corp 2.125% 06-Sep-2029	8.508	0,02
5.000	Unilever Capital Corp 3.500% 22-Mar-2028	4.717	0,01
10.000	Union Electric Co 8.450% 15-Mar-2039	12.788	0,03
5.000	Union Pacific Corp 2.400% 05-Feb-2030	4.300	0,01
15.000	Union Pacific Corp 2.973% 16-Sep-2062	9.805	0,02
5.000	Union Pacific Corp 3.150% 01-Mar-2024	4.902	0,01
5.000	Union Pacific Corp 3.250% 15-Jan-2025	4.864	0,01
10.000	Union Pacific Corp 3.646% 15-Feb-2024	9.853	0,02
5.000	Union Pacific Corp 3.750% 15-Mar-2024	4.923	0,01
35.000	Union Pacific Corp 3.750% 15-Jul-2025	34.070	0,07
5.000	Union Pacific Corp 3.750% 05-Feb-2070	3.695	0,01
25.000	Union Pacific Corp 3.850% 14-Feb-2072	18.716	0,04
15.000	Union Pacific Corp 4.100% 15-Sep-2067	11.879	0,03
5.000	Union Pacific Corp 'MTN' 3.550% 15-Aug-2039	4.172	0,01

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
8.845	United Airlines 2019-2 Class AA Pass Through Trust 2.700% 01-May-2032	7.177	0,02
27.663	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15-Oct-2027	27.334	0,06
20.000	United Overseas Bank Ltd '144A' FRN 3.863% 07-Oct-2032	18.491	0,04
20.000	United Parcel Service Inc 5.200% 01-Apr-2040	20.196	0,04
5.000	United Parcel Service Inc 6.200% 15-Jan-2038	5.555	0,01
25.000	UnitedHealth Group Inc 1.150% 15-May-2026	22.389	0,05
10.000	UnitedHealth Group Inc 2.300% 15-May-2031	8.377	0,02
10.000	UnitedHealth Group Inc 2.375% 15-Aug-2024	9.627	0,02
4.000	UnitedHealth Group Inc 2.950% 15-Oct-2027	3.709	0,01
20.000	UnitedHealth Group Inc 3.050% 15-May-2041	15.204	0,03
20.000	UnitedHealth Group Inc 3.450% 15-Jan-2027	19.083	0,04
5.000	UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Feb-2024	4.923	0,01
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Aug-2039	8.257	0,02
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.750% 15-Jul-2025	9.793	0,02
10.000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15-Aug-2059	7.928	0,02
20.000	UnitedHealth Group Inc 5.800% 15-Mar-2036	21.256	0,05
20.000	UnitedHealth Group Inc 6.050% 15-Feb-2063	22.005	0,05
15.000	UnitedHealth Group Inc 6.875% 15-Feb-2038	17.750	0,04
10.000	Universal Health Services Inc '144A' 1.650% 01-Sep-2026	8.612	0,02
10.000	Universal Health Services Inc '144A' 2.650% 15-Jan-2032	7.689	0,02
15.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	8.848	0,02
20.000	Unum Group 5.750% 15-Aug-2042	18.160	0,04
25.000	US Bancorp FRN 4.548% 22-Jul-2028	24.454	0,05
20.000	US Bancorp FRN 4.967% 22-Jul-2033	19.099	0,04
20.000	US Bancorp FRN 5.850% 21-Oct-2033	20.898	0,04
20.000	US Bancorp 'MTN' 3.600% 11-Sep-2024	19.604	0,04
25.000	USAA Capital Corp '144A' 3.375% 01-May-2025	24.155	0,05
10.000	Utah Acquisition Sub Inc 3.950% 15-Jun-2026	9.372	0,02
5.000	Vale Overseas Ltd 6.875% 21-Nov-2036	5.290	0,01
15.000	Valero Energy Corp 4.900% 15-Mar-2045	13.471	0,03
5.000	Ventas Realty LP 4.000% 01-Mar-2028	4.641	0,01
35.000	Ventas Realty LP 4.125% 15-Jan-2026	34.022	0,07
35.000	VeriSign Inc 5.250% 01-Apr-2025	34.966	0,08
20.000	Verisk Analytics Inc 4.000% 15-Jun-2025	19.473	0,04
10.000	Verizon Communications Inc 1.750% 20-Jan-2031	7.807	0,02
30.000	Verizon Communications Inc 2.100% 22-Mar-2028	26.137	0,06
30.000	Verizon Communications Inc 2.550% 21-Mar-2031	24.787	0,05
10.000	Verizon Communications Inc 2.625% 15-Aug-2026	9.253	0,02
15.000	Verizon Communications Inc 2.650% 20-Nov-2040	10.249	0,02
10.000	Verizon Communications Inc 2.875% 20-Nov-2050	6.328	0,01
20.000	Verizon Communications Inc 2.987% 30-Oct-2056	12.373	0,03
10.000	Verizon Communications Inc 3.000% 20-Nov-2060	6.040	0,01
20.000	Verizon Communications Inc 3.150% 22-Mar-2030	17.736	0,04
15.000	Verizon Communications Inc 3.376% 15-Feb-2025	14.557	0,03
15.000	Verizon Communications Inc 3.400% 22-Mar-2041	11.387	0,02
15.000	Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051	10.792	0,02
20.000	Verizon Communications Inc 3.700% 22-Mar-2061	14.172	0,03
15.000	Verizon Communications Inc 4.125% 16-Mar-2027	14.653	0,03
5.000	Verizon Communications Inc 4.125% 15-Aug-2046	4.020	0,01
20.000	Verizon Communications Inc 4.272% 15-Jan-2036	18.079	0,04
20.000	Verizon Communications Inc 4.329% 21-Sep-2028	19.306	0,04
15.000	Verizon Communications Inc 4.400% 01-Nov-2034	13.845	0,03
20.000	Verizon Communications Inc 4.812% 15-Mar-2039	18.469	0,04
10.000	Verizon Communications Inc 4.862% 21-Aug-2046	9.078	0,02
45.000	Verizon Communications Inc 6.550% 15-Sep-2043	49.470	0,11
20.000	Viatrix Inc 2.700% 22-Jun-2030	15.721	0,03
10.000	Viatrix Inc 3.850% 22-Jun-2040	6.766	0,01
5.000	Viatrix Inc 4.000% 22-Jun-2050	3.115	0,01
60.000	VICI Properties LP 4.375% 15-May-2025	58.312	0,13
20.000	VICI Properties LP 5.125% 15-May-2032	18.558	0,04
20.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.250% 01-Dec-2026	18.671	0,04
15.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 5.625% 01-May-2024	14.919	0,03
5.000	Vinci SA '144A' 3.750% 10-Apr-2029	4.618	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
40.000	Virginia Electric and Power Co 2.400% 30-Mar-2032	32.586	0,07
5.000	Visa Inc 2.750% 15-Sep-2027	4.640	0,01
20.000	Visa Inc 3.150% 14-Dec-2025	19.306	0,04
5.000	Visa Inc 4.150% 14-Dec-2035	4.758	0,01
15.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 3.550% 15-Jul-2024	14.401	0,03
10.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.125% 13-May-2025	9.797	0,02
10.000	Viterra Finance BV '144A' 2.000% 21-Apr-2026	8.693	0,02
5.000	VMware Inc 1.400% 15-Aug-2026	4.371	0,01
10.000	VMware Inc 3.900% 21-Aug-2027	9.363	0,02
40.000	VMware Inc 4.500% 15-May-2025	39.290	0,08
10.000	Vodafone Group Plc 5.125% 19-Jun-2059	8.631	0,02
25.000	Vodafone Group Plc 5.250% 30-May-2048	22.275	0,05
20.000	Vodafone Group Plc 6.150% 27-Feb-2037	20.427	0,04
20.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 3.950% 06-Jun-2025	19.389	0,04
10.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.350% 08-Jun-2027	9.615	0,02
20.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.625% 13-Nov-2025	19.712	0,04
10.000	Vontier Corp 2.400% 01-Apr-2028	8.027	0,02
10.000	Votorantim Cimentos International SA 'REGS' 7.250% 05-Apr-2041	10.876	0,02
15.000	Vulcan Materials Co 3.900% 01-Apr-2027	14.330	0,03
5.000	Vulcan Materials Co 4.500% 15-Jun-2047	4.201	0,01
10.000	W R Berkley Corp 4.750% 01-Aug-2044	8.795	0,02
20.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.200% 15-Apr-2030	17.410	0,04
5.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.450% 01-Jun-2026	4.765	0,01
10.000	Walmart Inc 3.700% 26-Jun-2028	9.700	0,02
25.000	Walmart Inc 3.900% 09-Sep-2025	24.646	0,05
10.000	Walmart Inc 3.950% 28-Jun-2038	9.245	0,02
15.000	Walmart Inc 5.625% 15-Apr-2041	16.360	0,04
25.000	Walmart Inc 7.550% 15-Feb-2030	29.560	0,06
15.000	Walt Disney Co/The 1.750% 13-Jan-2026	13.760	0,03
20.000	Walt Disney Co/The 2.000% 01-Sep-2029	16.857	0,04
10.000	Walt Disney Co/The 2.650% 13-Jan-2031	8.580	0,02
25.000	Walt Disney Co/The 3.350% 24-Mar-2025	24.251	0,05
5.000	Walt Disney Co/The 3.500% 13-May-2040	4.044	0,01
15.000	Walt Disney Co/The 3.600% 13-Jan-2051	11.567	0,02
5.000	Walt Disney Co/The 3.800% 22-Mar-2030	4.669	0,01
5.000	Walt Disney Co/The 3.800% 13-May-2060	3.876	0,01
5.000	Walt Disney Co/The 6.200% 15-Dec-2034	5.476	0,01
5.000	Walt Disney Co/The 6.400% 15-Dec-2035	5.512	0,01
10.000	Walt Disney Co/The 6.650% 15-Nov-2037	11.325	0,02
25.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 5.050% 15-Mar-2042	19.230	0,04
20.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 5.141% 15-Mar-2052	14.697	0,03
25.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 5.391% 15-Mar-2062	18.531	0,04
10.000	Waste Connections Inc 2.600% 01-Feb-2030	8.575	0,02
20.000	Waste Connections Inc 2.950% 15-Jan-2052	13.332	0,03
10.000	Waste Management Inc 1.500% 15-Mar-2031	7.866	0,02
5.000	Waste Management Inc 3.150% 15-Nov-2027	4.681	0,01
5.000	Waste Management Inc 4.150% 15-Jul-2049	4.387	0,01
20.000	WEA Finance LLC '144A' 2.875% 15-Jan-2027	17.168	0,04
50.000	WEC Energy Group Inc 0.800% 15-Mar-2024	47.408	0,10
10.000	WEC Energy Group Inc 1.375% 15-Oct-2027	8.513	0,02
20.000	Wells Fargo & Co 3.000% 22-Apr-2026	18.735	0,04
25.000	Wells Fargo & Co 3.000% 23-Oct-2026	23.169	0,05
20.000	Wells Fargo & Co 7.950% 15-Nov-2029	22.157	0,05
20.000	Wells Fargo & Co FRN 2.188% 30-Apr-2026	18.645	0,04
15.000	Wells Fargo & Co FRN 3.068% 30-Apr-2041	10.768	0,02
15.000	Wells Fargo & Co 'GMTN' 4.300% 22-Jul-2027	14.484	0,03
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.000% 19-Feb-2025	9.593	0,02
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.550% 29-Sep-2025	9.636	0,02
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3.750% 24-Jan-2024	9.871	0,02
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 4.100% 03-Jun-2026	9.703	0,02
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.164% 11-Feb-2026	9.327	0,02
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.393% 02-Jun-2028	17.709	0,04

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.406% 30-Oct-2025	9.468	0,02
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.879% 30-Oct-2030	25.640	0,06
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.196% 17-Jun-2027	9.285	0,02
25.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.350% 02-Mar-2033	21.202	0,05
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.526% 24-Mar-2028	27.871	0,06
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.584% 22-May-2028	9.314	0,02
10.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.908% 25-Apr-2026	9.694	0,02
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 4.808% 25-Jul-2028	19.562	0,04
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 4.897% 25-Jul-2033	18.997	0,04
30.000	Welltower Inc 2.750% 15-Jan-2032	23.614	0,05
15.000	Welltower Inc 4.000% 01-Jun-2025	14.636	0,03
5.000	West Fraser Timber Co Ltd '144A' 4.350% 15-Oct-2024	4.869	0,01
10.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 3.450% 15-Nov-2026	9.352	0,02
5.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp 4.950% 15-Sep-2028	4.821	0,01
10.000	Westlake Corp 2.875% 15-Aug-2041	6.687	0,01
5.000	Westpac Banking Corp 1.150% 03-Jun-2026	4.426	0,01
5.000	Westpac Banking Corp 2.350% 19-Feb-2025	4.752	0,01
5.000	Westpac Banking Corp 3.350% 08-Mar-2027	4.718	0,01
15.000	Westpac Banking Corp 4.043% 26-Aug-2027	14.716	0,03
10.000	Westpac Banking Corp 4.421% 24-Jul-2039	8.257	0,02
10.000	Westpac Banking Corp FRN 2.668% 15-Nov-2035	7.465	0,02
15.000	Westpac Banking Corp FRN 2.894% 04-Feb-2030	13.772	0,03
25.000	Westpac Banking Corp FRN 3.020% 18-Nov-2036	18.749	0,04
10.000	Westpac Banking Corp FRN 4.110% 24-Jul-2034	8.609	0,02
10.000	Westpac Banking Corp 'GMTN' FRN 4.322% 23-Nov-2031	9.438	0,02
25.000	Weyerhaeuser Co 6.950% 01-Oct-2027	26.852	0,06
5.000	Williams Cos Inc/The 2.600% 15-Mar-2031	4.072	0,01
10.000	Williams Cos Inc/The 3.750% 15-Jun-2027	9.444	0,02
5.000	Williams Cos Inc/The 4.900% 15-Jan-2045	4.302	0,01
15.000	Williams Cos Inc/The 5.300% 15-Aug-2052	13.581	0,03
10.000	Williams Cos Inc/The 5.750% 24-Jun-2044	9.631	0,02
5.000	Williams Cos Inc/The 6.300% 15-Apr-2040	5.157	0,01
5.000	Williams Cos Inc/The 7.500% 15-Jan-2031	5.504	0,01
5.000	Willis North America Inc 2.950% 15-Sep-2029	4.226	0,01
5.000	Willis North America Inc 3.600% 15-May-2024	4.868	0,01
10.000	Willis North America Inc 4.650% 15-Jun-2027	9.686	0,02
10.000	Wisconsin Electric Power Co 2.050% 15-Dec-2024	9.478	0,02
15.000	Woodside Finance Ltd '144A' 3.650% 05-Mar-2025	14.421	0,03
20.000	Woodside Finance Ltd '144A' 4.500% 04-Mar-2029	18.835	0,04
10.000	Woori Bank 'REGS' 2.000% 20-Jan-2027	8.803	0,02
15.000	Workday Inc 3.500% 01-Apr-2027	14.065	0,03
5.000	Workday Inc 3.800% 01-Apr-2032	4.445	0,01
10.000	WP Carey Inc 4.600% 01-Apr-2024	9.919	0,02
35.000	WRKCo Inc 4.650% 15-Mar-2026	34.412	0,07
5.000	Wyeth LLC 5.950% 01-Apr-2037	5.418	0,01
10.000	Xcel Energy Inc 3.350% 01-Dec-2026	9.418	0,02
5.000	Xcel Energy Inc 3.400% 01-Jun-2030	4.487	0,01
2.000	Xcel Energy Inc 3.500% 01-Dec-2049	1.479	0,00
40.000	Xiaomi Best Time International Ltd 'REGS' 2.875% 14-Jul-2031	29.139	0,06
10.000	Yara International ASA '144A' 3.148% 04-Jun-2030	8.064	0,02
40.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.600% 24-Nov-2031	32.616	0,07
5.000	Zions Bancorp NA 3.250% 29-Oct-2029	4.107	0,01
15.000	Zoetis Inc 3.900% 20-Aug-2028	14.302	0,03
5.000	Zoetis Inc 3.950% 12-Sep-2047	4.091	0,01
10.000	Zoetis Inc 4.500% 13-Nov-2025	9.952	0,02

Gesamtanlagen in Anleihen 46.015.986 98,87

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Credit Default Swaps - 36.702			
(31. Dezember 2021: 43.971)			
(4.605.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	36.702	0,08

Credit Default Swaps insgesamt 36.702 0,08

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 21.434				
(31. Dezember 2021: 12.616)				
(1)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(123.905)	3.531	0,01
(2)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(284.590)	14.032	0,03
(2)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(225.694)	2.428	0,00
(11)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.187.226)	1.443	0,00

Offene Terminkontrakte insgesamt 21.434 0,04

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 230.438 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 496.198) 230.438 0,50

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 46.304.560 99,49

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (24.305)				
(31. Dezember 2021: (7.074))				
1	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	78.762	(4.323)	(0,01)
1	SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	72.713	(746)	(0,00)
2	SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	221.685	(3.825)	(0,01)
1	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	112.297	(158)	(0,00)
(4)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(820.313)	(74)	(0,00)
17	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.283.313	(15.179)	(0,03)

Offene Terminkontrakte insgesamt (24.305) (0,05)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (716.228) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (53.875)) (716.228) (1,54)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (740.533) (1,59)

Nettoumlaufvermögen 978.697 2,10

Summe Nettovermögen 46.542.724 100,00

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	97,12
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,05
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,56
Sonstiges Umlaufvermögen	2,27
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	20.000	14.762	13. Jan. 23	Morgan Stanley	10
Euro	US-Dollar	200.000	213.604	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	642
Pfund Sterling	US-Dollar	40.000	48.128	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	244
US-Dollar	Pfund Sterling	109.962	90.000	13. Jan. 23	Morgan Stanley	1.125
US-Dollar	Pfund Sterling	1.842.387	1.497.500	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	31.463
USD						33.484
US-Dollar	Kanadischer Dollar	87.843	120.000	13. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(788)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.528.668	2.085.800	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	(11.881)
US-Dollar	Euro	425.037	400.000	13. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.455)
US-Dollar	Euro	512.607	481.700	13. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(3.404)
US-Dollar	Euro	10.600.760	10.026.000	13. Jan. 23	Morgan Stanley	(139.385)
USD						(158.913)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	3.030	3.218	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26
Euro	US-Dollar	5.951	6.324	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	51
Euro	US-Dollar	115.710	123.574	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	378
Euro	US-Dollar	14.370.291	15.203.199	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	190.677
USD						191.132
EUR						178.553

US-Dollar	Euro	3.220	3.030	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27)
US-Dollar	Euro	140.367	131.815	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(837)
US-Dollar	Euro	15.532	14.607	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(116)
US-Dollar	Euro	17.603	16.583	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(162)
US-Dollar	Euro	11.167	10.502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(83)
US-Dollar	Euro	177.644	167.244	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.512)
US-Dollar	Euro	6.192	5.834	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57)
US-Dollar	Euro	123.207	115.955	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.008)
US-Dollar	Euro	4.691	4.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Euro	1.864	1.765	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)
US-Dollar	Euro	103.314	97.595	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.232)
US-Dollar	Euro	2.368	2.238	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28)
USD						(5.113)
EUR						(4.776)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR X (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	10.000	10.655	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Euro	US-Dollar	86	92	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	10.630	11.246	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	141
USD						198
EUR						185
US-Dollar	Euro	201	189	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	255	240	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	173	163	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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	76	72	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
						USD
						(5)
						EUR
						(5)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	378.126	312.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	275
US-Dollar	Pfund Sterling	254.361	208.762	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.906
US-Dollar	Pfund Sterling	218.156	177.552	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.443
						USD
						5.624
						GBP
						4.652
Pfund Sterling	US-Dollar	668.500	827.151	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18.735)
Pfund Sterling	US-Dollar	210.817	262.153	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.213)
Pfund Sterling	US-Dollar	581.800	712.903	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.333)
Pfund Sterling	US-Dollar	25.566.278	31.432.862	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(515.594)
US-Dollar	Pfund Sterling	282.842	234.982	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.322)
						USD
						(552.197)
						GBP
						(456.757)

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettvermögen %	Summe
Anleihen				
Grundstoffe - 14.347.609				
(31. Dezember 2021: 39.961.439)		14.347.609	1,51	
457.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	456.116	0,05	
3.354.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	2.924.722	0,31	
2.600.000	HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027	2.405.949	0,25	
3.058.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	2.933.130	0,31	
3.933.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	3.496.328	0,37	
2.675.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	2.039.687	0,21	
100.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	91.677	0,01	
Investitionsgüter - 18.481.210				
(31. Dezember 2021: -)		18.481.210	1,95	
19.934.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	18.481.210	1,95	
Kommunikation - 134.123.465				
(31. Dezember 2021: 126.738.429)		134.123.465	14,14	
2.280.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	2.177.400	0,23	
1.637.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	1.600.986	0,17	
6.138.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	2.867.704	0,30	
1.836.000	Frontier Florida LLC 6.860% 01-Feb-2028	1.693.545	0,18	
1.475.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	1.359.581	0,14	
7.170.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	6.082.789	0,64	
7.610.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	6.019.018	0,63	
2.199.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	1.004.185	0,11	
4.035.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	1.987.238	0,21	
7.017.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	4.802.515	0,51	
6.820.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Apr-2042	4.546.823	0,48	
44.000	Qwest Corp 7.250% 15-Sep-2025	44.442	0,01	
18.171.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	18.938.585	2,00	
10.116.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	12.061.863	1,27	
10.779.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	8.163.314	0,86	
10.137.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	8.308.589	0,88	
11.338.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	9.224.143	0,97	
8.688.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	7.225.462	0,76	
3.303.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	2.919.852	0,31	
30.653.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	30.681.570	3,23	
2.280.000	Warner Media LLC 7.625% 15-Apr-2031	2.413.861	0,25	
Zyklische Konsumgüter - 210.071.842				
(31. Dezember 2021: 574.267.939)		210.071.842	22,14	
4.389.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	3.857.956	0,41	
3.705.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	3.136.783	0,33	
5.780.000	Brinker International Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2024	5.580.247	0,59	
2.220.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	1.477.033	0,16	
1.800.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	1.749.087	0,18	
338.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	380.309	0,04	
215.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	204.534	0,02	
3.489.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	2.513.792	0,27	
2.272.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	1.736.625	0,18	
300.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	288.990	0,03	
388.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	384.267	0,04	
120.000	Ford Motor Co 7.125% 15-Nov-2025	123.574	0,01	
730.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	713.046	0,08	
1.060.000	Ford Motor Co 7.450% 16-Jul-2031	1.086.554	0,11	
20.000	Ford Motor Co 7.500% 01-Aug-2026	20.867	0,00	
1.072.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	1.023.381	0,11	
295.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	287.334	0,03	
1.207.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	1.065.660	0,11	
95.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	89.128	0,01	
900.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	815.579	0,09	
765.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	706.191	0,07	
870.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	830.638	0,09	
635.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	576.453	0,06	
1.828.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	1.712.105	0,18	
6.972.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	6.106.459	0,64	
2.770.000	Kohl's Corp 3.625% 01-May-2031	1.942.823	0,20	
8.608.000	Kohl's Corp 5.550% 17-Jul-2045	5.438.534	0,57	
5.010.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	4.613.855	0,49	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettvermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Zyklische Konsumgüter Forts.				
14.534.000	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	13.819.011	1,46	
9.226.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	8.298.361	0,87	
6.017.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	5.118.595	0,54	
3.170.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	1.916.265	0,20	
3.799.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	2.650.828	0,28	
3.854.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	2.525.258	0,27	
2.705.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	2.166.907	0,23	
3.335.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.700% 15-Jul-2034	2.790.595	0,29	
3.950.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	3.500.781	0,37	
2.846.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	2.374.560	0,25	
2.878.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	2.062.288	0,22	
3.638.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	2.741.524	0,29	
9.857.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	6.005.870	0,63	
1.693.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	1.563.909	0,17	
4.732.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	3.870.776	0,41	
3.680.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	2.607.133	0,27	
3.676.000	QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024	3.406.733	0,36	
4.820.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	2.527.126	0,27	
2.804.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	1.390.377	0,15	
6.300.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	4.278.911	0,45	
13.100.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	9.332.085	0,98	
340.000	RiteAid Corp 7.700% 15-Feb-2027	138.550	0,01	
1.023.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	753.521	0,08	
2.239.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	1.908.895	0,20	
7.880.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	8.468.636	0,89	
6.841.000	Sands China Ltd 4.300% 08-Jan-2026	6.322.117	0,67	
5.010.000	Sands China Ltd 4.875% 18-Jun-2030	4.409.501	0,46	
11.208.000	Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	10.750.829	1,13	
15.397.000	Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	14.470.901	1,53	
2.578.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	2.543.638	0,27	
3.178.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	3.021.674	0,32	
1.964.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	1.938.600	0,20	
7.950.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	7.084.881	0,75	
3.961.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	3.283.312	0,35	
4.191.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	4.262.750	0,45	
7.749.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	7.304.340	0,77	
Nicht-zyklische Konsumgüter - 67.640.988				
(31. Dezember 2021: 225.134.980)		67.640.988	7,13	
804.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	771.197	0,08	
3.705.000	Mattel Inc 5.450% 01-Nov-2041	3.021.877	0,32	
1.700.000	Mattel Inc 6.200% 01-Oct-2040	1.470.394	0,16	
121.000	Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024	117.189	0,01	
2.495.000	Newell Brands Inc 4.450% 01-Apr-2026	2.352.773	0,25	
4.085.000	Newell Brands Inc 5.625% 01-Apr-2036	3.514.685	0,37	
7.503.000	Newell Brands Inc 5.750% 01-Apr-2046	5.993.764	0,63	
10.060.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	9.520.382	1,00	
10.837.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	10.067.030	1,06	
6.791.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.400% 15-Jun-2030	5.795.285	0,61	
9.388.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	6.363.214	0,67	
2.779.000	Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	2.507.954	0,26	
1.960.000	Toledo Hospital/The 4.982% 15-Nov-2045	1.227.450	0,13	
8.059.000	Toledo Hospital/The 5.325% 15-Nov-2028	6.325.106	0,67	
12.146.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	8.592.688	0,91	
Elektro - 4.196.732				
(31. Dezember 2021: -)		4.196.732	0,44	
4.415.103	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	4.196.732	0,44	
Energie - 166.524.530				
(31. Dezember 2021: 379.945.923)		166.524.530	17,55	
3.780.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	3.351.657	0,35	
916.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2044	646.442	0,07	
2.876.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	2.597.261	0,27	
3.154.000	Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043	2.385.291	0,25	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	Summe mögen %
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
10.527.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	8.747.595	0,92
3.178.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	2.616.761	0,28
2.818.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	2.282.248	0,24
3.316.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	3.075.192	0,32
1.411.000	Apache Corp 7.375% 15-Aug-2047	1.416.665	0,15
2.092.000	Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029	2.200.998	0,23
1.870.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	1.675.988	0,18
2.435.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	2.134.155	0,22
484.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	468.342	0,05
2.671.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	1.971.254	0,21
4.024.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	3.023.909	0,32
1.301.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	1.195.307	0,13
3.135.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	2.968.118	0,31
4.814.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	4.533.575	0,48
4.570.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	3.471.387	0,37
5.235.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	4.205.866	0,44
3.518.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	2.918.046	0,31
2.040.000	EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024	1.963.888	0,21
418.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	372.596	0,04
520.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	465.896	0,05
5.047.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	3.791.544	0,40
1.605.000	Global Marine Inc 7.000% 01-Jun-2028	1.171.650	0,12
2.244.000	Murphy Oil Corp 6.125% 01-Dec-2042	1.767.330	0,19
2.211.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	2.195.254	0,23
1.336.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	1.283.881	0,13
1.530.000	Occidental Petroleum Corp 3.000% 15-Feb-2027	1.388.128	0,15
1.365.000	Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026	1.289.898	0,14
1.104.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029	985.436	0,10
500.000	Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047	383.325	0,04
570.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	440.945	0,05
1.633.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	1.310.223	0,14
1.015.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	794.537	0,08
890.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049	710.428	0,07
801.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	641.687	0,07
732.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	592.573	0,06
1.990.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	1.985.781	0,21
2.619.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	2.548.840	0,27
5.824.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	5.953.613	0,63
3.563.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	3.674.326	0,39
1.932.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	1.969.133	0,21
1.939.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	2.082.040	0,22
1.290.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	1.422.580	0,15
1.420.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	1.542.440	0,16
3.493.000	Oceanering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	3.341.365	0,35
788.000	Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028	697.617	0,07
468.000	Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029	421.341	0,04
3.675.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	3.476.072	0,37
2.838.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	2.502.380	0,26
4.139.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	3.726.714	0,39
5.729.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	4.827.204	0,51
2.621.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	2.442.916	0,26
4.005.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	3.674.087	0,39
440.000	Southwestern Energy Co 5.700% 23-Jan-2025	433.016	0,04
5.858.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	3.702.977	0,39
4.510.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	3.030.270	0,32
2.059.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	1.396.414	0,15
6.751.000	Western Midstream Operating LP 3.350% 01-Feb-2025	6.402.446	0,67
3.465.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	3.285.790	0,35
4.304.000	Western Midstream Operating LP 4.300% 01-Feb-2030	3.732.756	0,39

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD	Summe mögen %
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
1.428.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	1.317.958	0,14
2.595.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	2.467.274	0,26
2.576.000	Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028	2.374.480	0,25
3.493.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	2.873.102	0,30
4.072.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	3.384.384	0,36
2.261.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048	1.883.385	0,20
5.531.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 01-Feb-2050	4.516.553	0,48
Finanzwerte - 133.532.741			
(31. Dezember 2021: 130.630.248)			
3.158.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	2.864.420	0,30
2.130.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 01-May-2024	1.803.215	0,19
4.055.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	2.312.688	0,24
6.615.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	6.851.122	0,72
1.530.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	1.349.232	0,14
16.822.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	16.186.875	1,71
7.370.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	5.263.469	0,56
11.324.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	8.315.080	0,88
11.829.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	9.190.161	0,97
8.406.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	5.648.709	0,60
10.312.000	Office Properties Income Trust 4.250% 15-May-2024	9.775.096	1,03
17.698.000	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	16.060.400	1,69
8.531.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030	7.877.682	0,83
930.000	Pacific Western Bank FRN 3.250% 01-May-2031	858.131	0,09
300.000	Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038	314.571	0,03
2.852.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	2.029.403	0,21
5.145.000	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	4.685.302	0,49
3.276.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	2.169.807	0,23
2.354.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	2.034.155	0,22
2.221.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	2.124.835	0,22
2.050.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	1.616.486	0,17
1.353.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	1.067.761	0,11
3.482.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	2.412.099	0,26
2.180.000	Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026	1.824.291	0,19
6.707.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	5.921.288	0,62
14.099.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	12.976.463	1,37
Industrie - 79.077.067			
(31. Dezember 2021: 159.825.622)			
637.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	640.185	0,07
6.448.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	6.649.371	0,70
980.000	Fluor Corp 3.500% 15-Dec-2024	942.486	0,10
1.490.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	1.343.642	0,14
9.249.000	Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027	8.620.740	0,91
6.447.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	6.300.895	0,66
3.796.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	3.670.808	0,39
8.075.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	7.991.827	0,84
9.020.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	8.967.053	0,94
5.680.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	5.524.743	0,58
2.679.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	2.719.520	0,29
6.335.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	6.511.113	0,69
10.992.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	10.167.600	1,07
4.128.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	4.098.592	0,43
512.000	Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026	464.155	0,05
3.059.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	2.473.846	0,26
581.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	564.767	0,06
1.602.000	XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034	1.425.724	0,15

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Sonstige Industrie - 12.377.285			
(31. Dezember 2021: -)			
14.186.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	12.377.285	1,31
Technologie - 46.473.988			
(31. Dezember 2021: 127.647.613)			
5.039.000	Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039	4.791.768	0,51
400.000	Pitney Bowes Inc 4.625% 15-Mar-2024	389.380	0,04
4.893.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	4.054.655	0,43
7.772.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	6.077.982	0,64
5.703.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	5.555.977	0,59
8.756.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	8.597.684	0,91
6.232.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	5.819.141	0,61
7.750.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	6.584.827	0,69
102.000	Xerox Corp 3.800% 15-May-2024	98.442	0,01
2.485.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	1.624.124	0,17
3.857.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	2.880.008	0,30
Transport - 16.949.723			
(31. Dezember 2021: -)			
1.119.584	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	973.099	0,10
1.386.361	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	1.200.392	0,13
688.379	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	576.056	0,06
1.160.122	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	949.506	0,10
548.259	American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028	429.620	0,05
2.337.363	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	1.822.494	0,19
732.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	694.674	0,07
181.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	150.772	0,02
827.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	738.514	0,08
6.921.580	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	5.938.158	0,63
1.159.279	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	1.058.266	0,11
2.656.329	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	2.418.172	0,25
Versorger - 22.590.418			
(31. Dezember 2021: 106.782.678)			
687.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	608.534	0,06
1.505.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	1.396.881	0,15
3.706.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	2.948.030	0,31
2.568.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	2.098.351	0,22
5.374.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	3.583.249	0,38
3.759.000	FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027	3.514.251	0,37
4.116.000	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	3.682.024	0,39
2.021.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	2.279.739	0,24
988.523	Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6.000% 15-Mar-2025	1.010.765	0,11
1.591.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	1.468.594	0,15
Gesamtanlagen in Anleihen		926.387.598	97,64

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 63.206				
(31. Dezember 2021: 409.474)				
50	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	10.253.906	2.157	0,00
(32)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(3.453.750)	9.948	0,00
(10)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.253.437)	48.920	0,00

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(87)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.685.188)	2.181	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			63.206	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.226.961 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 14.611.501)				
			1.226.961	0,13
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			927.677.765	97,77

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (110.805)				
(31. Dezember 2021: (1.062.188))				
7	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	786.078	(8.543)	(0,00)
43	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	5.086.094	(102.262)	(0,01)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(110.805)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (3.309.099) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (2.130.766))				
			(3.309.099)	(0,35)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(3.419.904)	(0,36)
Nettoumlaufvermögen			24.556.389	2,59
Summe Nettovermögen			948.814.250	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	94,51
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,01
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,13
Sonstiges Umlaufvermögen	5,35
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	643.867	687.625	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.104
Euro	US-Dollar	71.803.745	75.965.517	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	952.753
					USD	954.857
					EUR	892.014
US-Dollar	Euro	585.080	549.434	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.489)
US-Dollar	Euro	485.307	455.584	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.727)
					USD	(6.216)
					EUR	(5.807)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	25.687	27.406	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	92
Euro	US-Dollar	5.038	5.380	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	565.023	597.772	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7.497
					USD	7.606
					EUR	7.105
US-Dollar	Euro	27.423	25.687	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(93)
US-Dollar	Euro	4.658	4.374	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28)
US-Dollar	Euro	3.855	3.619	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)
					USD	(143)
					EUR	(134)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR N (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	2.251	2.404	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	254.197	268.930	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.373
					USD	3.380
					EUR	3.158
US-Dollar	Euro	2.126	1.996	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Euro	1.755	1.647	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(10)
					USD	(23)
					EUR	(21)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	41.612	44.248	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	329
Euro	US-Dollar	44.731	47.771	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	146
Euro	US-Dollar	102.298	108.005	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.580
Euro	US-Dollar	4.916.002	5.200.935	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	65.230
					USD	67.285
					EUR	62.857
US-Dollar	Euro	39.602	37.189	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(236)
US-Dollar	Euro	96.530	90.784	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(721)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	33.480	31.430	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(188)
US-Dollar	Euro	120.998	113.996	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.118)
US-Dollar	Euro	44.226	41.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(38)
					USD	(2.301)
					EUR	(2.150)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	124.250	132.695	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	406
Euro	US-Dollar	13.903.042	14.708.867	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	184.477
					USD	184.883
					EUR	172.715
US-Dollar	Euro	114.080	107.129	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(680)
US-Dollar	Euro	94.503	88.715	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(531)
					USD	(1.211)
					EUR	(1.131)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Pfund Sterling	92	76	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	79	65	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	-
					GBP	-
Pfund Sterling	US-Dollar	94	116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.547	12.968	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(213)
					USD	(216)
					GBP	(179)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	300	362	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	1.036.720	852.286	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.052
					USD	6.053
					GBP	5.007
US-Dollar	Pfund Sterling	362	300	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	3.800.000	4.624.929	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(29.594)
Pfund Sterling	US-Dollar	5.400	6.682	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(151)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.232.977	1.533.224	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(42.186)
Pfund Sterling	US-Dollar	482	591	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
Pfund Sterling	US-Dollar	138.134.987	169.832.228	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.785.763)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.219.279	1.012.965	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.698)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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	189	157	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(2.863.403)
					GBP	(2.368.504)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	897.529	1.083.401	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.980
US-Dollar	Pfund Sterling	157.109	129.159	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	917
					USD	2.897
					GBP	2.396
US-Dollar	Pfund Sterling	1.083.138	897.529	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.961)
Pfund Sterling	US-Dollar	188.689	234.637	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.456)
Pfund Sterling	US-Dollar	21.139.544	25.990.345	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(426.320)
US-Dollar	Pfund Sterling	181.612	150.881	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(849)
					USD	(435.586)
					GBP	(360.301)

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Anleihen			
Grundstoffe - 67.920.941			
(31. Dezember 2021: 33.447.812)			
575.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	468.016	0,03
15.000	Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025	14.971	0,00
1.170.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025	1.163.039	0,08
867.000	Arconic Corp '144A' 6.000% 15-May-2025	854.512	0,06
969.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	910.846	0,06
355.000	Ashland LLC 6.875% 15-May-2043	350.550	0,02
890.000	Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031	712.364	0,05
563.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 5.250% 30-Sep-2028	453.736	0,03
580.000	ASP Unifrax Holdings Inc '144A' 7.500% 30-Sep-2029	368.880	0,03
367.000	ATI Inc 4.875% 01-Oct-2029	324.797	0,02
647.000	ATI Inc 5.125% 01-Oct-2031	572.886	0,04
410.000	ATI Inc 5.875% 01-Dec-2027	392.712	0,03
782.000	Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025	763.796	0,05
800.000	Avient Corp '144A' 7.125% 01-Aug-2030	783.087	0,06
420.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027	388.899	0,03
1.038.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	857.772	0,06
420.000	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026	398.891	0,03
683.000	Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029	651.924	0,05
615.000	Carpenter Technology Corp 6.375% 15-Jul-2028	585.969	0,04
110.000	Carpenter Technology Corp 7.625% 15-Mar-2030	110.421	0,01
187.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026	170.569	0,01
682.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028	598.232	0,04
755.000	Century Aluminum Co '144A' 7.500% 01-Apr-2028	654.281	0,05
620.000	Cerdia Finanz GmbH '144A' 10.500% 15-Feb-2027	520.896	0,04
527.000	Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027	487.483	0,03
1.110.000	Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029	908.868	0,06
830.000	Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028	746.668	0,05
738.000	Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028	652.742	0,05
100.000	Clearwater Paper Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2025	97.577	0,01
370.000	Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027	354.107	0,03
201.000	Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040	175.274	0,01
220.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029	195.568	0,01
455.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2031	402.418	0,03
1.255.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026	1.260.296	0,09
415.000	Coeur Mining Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2029	324.417	0,02
675.000	Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031	568.500	0,04
50.000	Commercial Metals Co 4.125% 15-Jan-2030	44.474	0,00
470.000	Compass Minerals International Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2024	454.749	0,03
910.000	Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027	875.011	0,06
920.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	783.445	0,06
203.000	Constellium SE '144A' 3.750% 15-Apr-2029	165.184	0,01
578.000	Constellium SE '144A' 5.625% 15-Jun-2028	535.124	0,04
208.000	Constellium SE '144A' 5.875% 15-Feb-2026	198.476	0,01
160.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 6.750% 15-Aug-2024	128.253	0,01
314.000	Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026	321.889	0,02
345.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028	309.898	0,02
1.200.000	Diamond BC BV '144A' 4.625% 01-Oct-2029	964.560	0,07
759.000	Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028	665.695	0,05
1.058.000	Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	900.993	0,06
2.185.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031	1.821.435	0,13
780.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027	720.892	0,05
622.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15-May-2024	612.385	0,04

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Grundstoffe Forts.			
869.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.875% 15-Apr-2030	810.753	0,06
680.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125% 15-Apr-2032	635.151	0,05
300.000	Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029	180.802	0,01
523.000	GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026	446.684	0,03
426.000	GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028	350.467	0,02
533.000	Graphic Packaging International LLC 4.125% 15-Aug-2024	524.485	0,04
482.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028	420.038	0,03
290.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029	248.683	0,02
110.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030	93.714	0,01
270.000	Graphic Packaging International LLC '144A' 4.750% 15-Jul-2027	254.556	0,02
297.000	HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028	263.859	0,02
459.000	Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028	452.657	0,03
705.000	Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028	527.837	0,04
190.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500% 01-Apr-2026	172.816	0,01
308.000	Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029	279.228	0,02
381.000	Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028	319.602	0,02
805.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc '144A' 3.375% 15-Jan-2026	740.596	0,05
360.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2024	349.744	0,02
877.000	Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028	753.732	0,05
228.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028	224.113	0,02
175.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	150.500	0,01
589.000	JW Aluminum Continuous Cast Co '144A' 10.250% 01-Jun-2026	600.577	0,04
545.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031	438.752	0,03
605.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028	528.876	0,04
918.000	Kobe US Midco 2 Inc '144A' 9.250% 01-Nov-2026	647.190	0,05
663.000	Koppers Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2025	630.898	0,04
575.000	LSB Industries Inc '144A' 6.250% 15-Oct-2028	526.829	0,04
815.000	LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029	674.340	0,05
532.000	Mativ Holdings Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026	470.751	0,03
1.299.000	Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029	1.087.887	0,08
460.000	Mercer International Inc 5.500% 15-Jan-2026	436.447	0,03
242.000	Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024	232.118	0,02
870.000	Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027	808.421	0,06
270.000	Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029	240.023	0,02
838.000	Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044	638.975	0,05
747.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.000% 01-Nov-2027	764.861	0,05
907.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027	914.849	0,06
685.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8.500% 01-May-2030	695.272	0,05
686.000	Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028	612.166	0,04
375.000	New Gold Inc '144A' 7.500% 15-Jul-2027	329.675	0,02
870.000	Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026	781.047	0,06
626.000	Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031	511.907	0,04
1.596.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	1.418.557	0,10
385.000	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A' 5.000% 27-Jan-2030	334.118	0,02
292.000	Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030	266.968	0,02
995.000	Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027	941.986	0,07
930.000	Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029	885.151	0,06
633.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028	514.719	0,04
427.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250% 01-Oct-2029	324.607	0,02
620.000	Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025	582.025	0,04
498.000	Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026	181.459	0,01
554.000	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A' 7.250% 01-Apr-2025	511.386	0,04
256.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 5.500% 01-Jun-2024	255.360	0,02
730.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 7.625% 15-Jan-2026	697.187	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Grundstoffe Forts.			
260.000	Resolute Forest Products Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2026	256.827	0,02
1.337.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028	1.146.678	0,08
443.000	SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029	357.403	0,03
1.075.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026	912.406	0,06
155.000	SK Invictus Intermediate II Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029	127.302	0,01
355.000	SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027	305.742	0,02
700.000	SPCM SA '144A' 3.375 % 15-Mar-2030	564.410	0,04
436.000	SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	374.824	0,03
735.000	Sylvamo Corp '144A' 7.000% 01-Sep-2029	700.591	0,05
276.000	Tacora Resources Inc '144A' 8.250% 15-May-2026	200.308	0,01
330.000	Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026	290.594	0,02
437.000	TMS International Corp/DE '144A' 6.250% 15-Apr-2029	313.637	0,02
760.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	493.255	0,03
86.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	70.871	0,01
920.000	Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029	766.475	0,05
200.000	United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037	183.355	0,01
438.000	United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029	425.734	0,03
485.000	Univar Solutions USA Inc/Washington '144A' 5.125% 01-Dec-2027	460.784	0,03
392.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025	134.487	0,01
858.000	Vibrantz Technologies Inc '144A' 9.000% 15-Feb-2030	647.474	0,05
510.000	Warrior Met Coal Inc '144A' 7.875% 01-Dec-2028	503.417	0,04
977.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027	866.970	0,06
585.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 01-Oct-2024	577.038	0,04
996.000	WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	806.531	0,06
Investitionsgüter - 22.613.759			
(31. Dezember 2021: -)		22.613.759	1,60
310.000	Alta Equipment Group Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2026	280.296	0,02
335.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	274.273	0,02
850.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028	759.832	0,05
490.000	BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027	303.389	0,02
297.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2026	277.932	0,02
414.000	BlueLinX Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	344.158	0,02
580.000	Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029	436.870	0,03
663.000	GYP Holdings III Corp '144A' 4.625% 01-May-2029	545.490	0,04
765.000	H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028	652.962	0,05
1.035.000	Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027	967.497	0,07
515.000	Interface Inc '144A' 5.500% 01-Dec-2028	425.924	0,03
460.000	Iris Holding Inc '144A' 10.000% 15-Dec-2028	379.808	0,03
1.260.000	LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029	805.311	0,06
875.000	NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	766.763	0,05
467.000	Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029	311.585	0,02
805.000	Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029	553.554	0,04
525.000	Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029	436.433	0,03
255.000	Patrick Industries Inc '144A' 7.500% 15-Oct-2027	248.507	0,02
393.000	PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029	255.839	0,02
301.000	Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	243.816	0,02
655.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2025	644.664	0,05
1.289.000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026	1.036.420	0,07
555.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	492.696	0,03

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Investitionsgüter Forts.			
985.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	785.196	0,06
833.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029	674.580	0,05
380.000	Titan International Inc 7.000% 30-Apr-2028	359.258	0,03
1.096.000	United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032	895.574	0,06
2.571.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	2.383.626	0,17
1.143.000	United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031	960.743	0,07
1.053.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	901.970	0,06
1.535.000	United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028	1.458.027	0,10
1.060.000	United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030	997.836	0,07
510.000	United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027	504.303	0,04
676.000	Wesco Aircraft Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2024	334.620	0,02
720.000	White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028	623.984	0,04
335.000	White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026	290.023	0,02
Kommunikation - 215.597.841			
(31. Dezember 2021: 122.602.839)		215.597.841	15,21
475.000	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	362.891	0,03
745.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028	306.627	0,02
1.335.000	Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028	1.077.545	0,08
2.040.000	Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029	1.608.413	0,11
2.120.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	1.255.976	0,09
1.845.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	1.410.779	0,10
794.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jan-2029	598.316	0,04
2.804.000	Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029	2.107.285	0,15
1.416.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	1.111.942	0,08
2.031.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	1.552.324	0,11
1.635.000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 01-Feb-2027	1.492.657	0,11
675.000	AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029	421.583	0,03
816.000	AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025	621.588	0,04
267.000	AMC Networks Inc 5.000% 01-Apr-2024	250.112	0,02
615.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.500% 01-May-2027	116.680	0,01
453.000	Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029	79.050	0,01
661.000	Banjay Entertainment SASU '144A' 5.375% 01-Mar-2025	625.689	0,04
230.000	Beasley Mezzanine Holdings LLC '144A' 8.625% 01-Feb-2026	138.863	0,01
105.000	Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027	100.275	0,01
200.000	Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027	195.600	0,01
201.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	175.690	0,01
789.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081	664.707	0,05
1.175.000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.875% 23-Nov-2081	926.022	0,07
665.000	Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030	522.651	0,04
784.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027	649.907	0,05
466.000	Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028	347.043	0,02
3.007.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032	2.401.315	0,17
3.285.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031	2.636.213	0,19
2.400.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034	1.776.000	0,13
2.620.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	2.170.434	0,15
2.050.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033	1.576.952	0,11

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
3.136.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	2.680.778	0,19
1.240.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Feb-2032	1.007.804	0,07
2.541.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	2.302.032	0,16
3.012.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	2.801.250	0,20
1.553.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	1.402.048	0,10
1.101.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026	1.067.477	0,08
1.700.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 6.375% 01-Sep-2029	1.600.831	0,11
1.225.000	CellNex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041	839.670	0,06
745.000	Cengage Learning Inc '144A' 9.500% 15-Jun-2024	711.650	0,05
875.000	Cimpress Plc '144A' 7.000% 15-Jun-2026	606.270	0,04
236.000	Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025	225.565	0,02
1.151.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	997.733	0,07
725.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029	533.705	0,04
990.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	723.991	0,05
800.000	CMG Media Corp '144A' 8.875% 15-Dec-2027	603.424	0,04
390.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026	354.778	0,02
445.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	436.624	0,03
2.803.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	2.603.481	0,18
254.000	Consolidated Communications Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2028	187.647	0,01
180.000	Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028	140.321	0,01
660.000	CSC Holdings LLC 5.250% 01-Jun-2024	615.450	0,04
590.000	CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031	385.724	0,03
683.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030	484.230	0,03
1.549.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031	1.077.622	0,08
2.415.000	CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030	1.339.747	0,09
600.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Nov-2031	336.000	0,02
610.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	492.776	0,03
366.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027	307.816	0,02
2.305.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030	1.305.079	0,09
985.000	CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029	807.321	0,06
1.203.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	817.679	0,06
610.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026	513.364	0,04
800.000	Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029	659.040	0,05
5.093.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	4.566.180	0,32
2.339.000	DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	1.513.508	0,11
2.592.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	2.413.914	0,17
1.935.000	DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028	1.372.157	0,10
2.760.000	DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026	2.236.318	0,16
3.435.000	DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026	2.899.861	0,20
3.577.000	DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028	2.861.600	0,20
2.550.000	DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	2.629.433	0,19
1.532.000	Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	715.758	0,05
835.000	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	647.105	0,05
1.246.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028	1.084.406	0,08
1.354.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	1.260.263	0,09
1.330.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	1.046.541	0,07
955.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029	791.342	0,06
1.115.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750% 15-May-2030	1.135.844	0,08
548.000	Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028	505.119	0,04
815.000	Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026	665.264	0,05
325.000	GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028	273.558	0,02

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
335.000	Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027	331.196	0,02
485.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	406.669	0,03
886.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	840.088	0,06
695.000	Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026	683.939	0,05
1.440.000	Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031	1.040.306	0,07
623.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	443.349	0,03
360.000	Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026	321.300	0,02
395.000	Gray Television Inc '144A' 7.000% 15-May-2027	350.916	0,02
5.000	Historic TW Inc Step-Up Coupon 8.300% 15-Jan-2036	5.714	0,00
632.000	Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026	607.301	0,04
739.000	Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026	690.588	0,05
1.522.332	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	1.402.951	0,10
1.414.886	iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027	1.205.748	0,08
679.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	554.010	0,04
940.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	797.744	0,06
1.425.000	Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026	1.324.087	0,09
1.367.000	Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028	1.237.299	0,09
150.000	INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026	107.909	0,01
2.811.000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	2.520.033	0,18
880.000	Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025	771.390	0,05
430.000	Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031	356.052	0,03
410.000	Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028	367.641	0,03
620.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	542.981	0,04
686.000	Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029	632.421	0,04
1.004.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	833.198	0,06
1.284.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027	1.203.519	0,08
1.435.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027	1.217.406	0,09
1.550.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	1.137.547	0,08
1.465.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029	1.055.826	0,07
1.485.000	Level 3 Financing Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2029	1.174.539	0,08
1.539.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028	1.215.779	0,09
1.752.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027	1.461.606	0,10
325.000	Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030	148.413	0,01
844.000	Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029	415.670	0,03
217.500	Ligado Networks LLC '144A' 17.500% 01-May-2024	22.499	0,00
740.000	Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028	615.772	0,04
700.000	Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039	479.088	0,03
299.000	Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042	199.340	0,01
1.150.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027	977.135	0,07
1.134.000	Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029	784.226	0,06
200.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	174.181	0,01
685.000	Lumen Technologies Inc '144A' 5.375% 15-Jun-2029	494.071	0,03
758.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028	638.111	0,04
780.000	McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029	646.049	0,05
630.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5.375% 15-Aug-2027	571.388	0,04
623.000	Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026	399.531	0,03
255.000	National CineMedia LLC '144A' 5.875% 15-Apr-2028	59.064	0,00
394.000	Netflix Inc 4.375% 15-Nov-2026	382.180	0,03
1.713.000	Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028	1.657.904	0,12
765.000	Netflix Inc 5.875% 15-Feb-2025	775.886	0,05
2.103.000	Netflix Inc 5.875% 15-Nov-2028	2.136.711	0,15
1.078.000	Netflix Inc 6.375% 15-May-2029	1.111.383	0,08
1.025.000	Netflix Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2025	985.461	0,07
835.000	Netflix Inc '144A' 4.875% 15-Jun-2030	770.780	0,05
861.000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029	836.698	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen	Summe Nettovermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
1.409.000	News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029	1.224.189	0,09
1.240.000	News Corp '144A' 5.125% 15-Feb-2032	1.130.192	0,08
1.360.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	1.178.454	0,08
1.876.000	Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	1.724.771	0,12
150.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027	132.167	0,01
478.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	370.705	0,03
100.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028	93.546	0,01
224.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2029	186.145	0,01
501.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030	415.293	0,03
741.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	668.231	0,05
225.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.250% 15-Jun-2025	223.255	0,02
990.000	Paramount Global FRN 6.250% 28-Feb-2057	799.660	0,06
1.071.000	Paramount Global FRN 6.375% 30-Mar-2062	876.984	0,06
601.000	Playtika Holding Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	472.536	0,03
167.000	Qwest Corp 7.250% 15-Sep-2025	168.676	0,01
1.185.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	872.492	0,06
1.460.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028	608.272	0,04
1.408.000	ROBLOX Corp '144A' 3.875% 01-May-2030	1.111.616	0,08
250.000	RR Donnelley & Sons Co '144A' 6.125% 01-Nov-2026	233.750	0,02
375.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	301.489	0,02
470.000	Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2031	377.320	0,03
905.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027	809.142	0,06
682.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030	512.203	0,04
292.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2027	238.620	0,02
240.000	Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030	168.208	0,01
566.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026	503.279	0,04
2.567.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031	2.007.636	0,14
2.440.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	2.128.217	0,15
1.850.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	1.530.810	0,11
2.276.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027	2.109.070	0,15
2.202.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029	2.014.907	0,14
100.000	Skillz Inc '144A' 10.250% 15-Dec-2026	66.500	0,00
3.588.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	3.739.565	0,26
2.581.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	3.077.468	0,22
2.979.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	3.045.211	0,21
2.570.000	Sprint LLC 7.625% 15-Feb-2025	2.659.297	0,19
2.233.000	Sprint LLC 7.625% 01-Mar-2026	2.354.433	0,17
1.015.000	Stagwell Global LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029	838.852	0,06
634.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	515.245	0,04
597.000	TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028	567.132	0,04
684.000	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	650.522	0,05
150.000	TEGNA Inc '144A' 4.750% 15-Mar-2026	145.706	0,01
1.178.000	Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034	892.141	0,06
774.000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033	634.394	0,04
1.095.000	Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036	890.848	0,06
1.173.000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038	975.537	0,07
1.997.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	1.896.152	0,13
1.600.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028	1.456.000	0,10
115.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027	51.830	0,00
598.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026	275.841	0,02
470.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027	136.691	0,01
782.000	Townsquare Media Inc '144A' 6.875% 01-Feb-2026	695.004	0,05
550.000	United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033	486.200	0,03
1.303.000	Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029	1.092.090	0,08

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen	Summe Nettovermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.			
1.420.000	Univision Communications Inc '144A' 5.125% 15-Feb-2025	1.355.277	0,10
2.018.000	Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027	1.951.275	0,14
1.070.000	Univision Communications Inc '144A' 7.375% 30-Jun-2030	1.027.200	0,07
1.286.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	1.082.831	0,08
749.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	665.921	0,05
365.000	Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028	308.994	0,02
825.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	766.728	0,05
583.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027	530.588	0,04
375.000	Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028	281.943	0,02
1.165.000	Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029	983.514	0,07
1.295.000	Videotron Ltd '144A' 5.125% 15-Apr-2027	1.225.394	0,09
1.055.000	Videotron Ltd '144A' 5.375% 15-Jun-2024	1.043.532	0,07
776.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030	622.983	0,04
1.422.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030	1.190.498	0,08
2.036.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029	1.828.460	0,13
555.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028	486.274	0,03
1.555.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031	1.262.302	0,09
1.600.000	Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031	1.308.544	0,09
560.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	468.306	0,03
1.800.000	Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081	1.338.485	0,09
1.575.000	Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081	1.149.419	0,08
2.779.000	Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	2.781.590	0,20
1.382.000	VZ Secured Financing BV '144A' 5.000% 15-Jan-2032	1.125.544	0,08
1.105.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	902.995	0,06
1.175.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.000% 15-Feb-2031	940.817	0,07
945.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	813.929	0,06
785.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.875% 15-Jul-2030	677.553	0,05
989.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027	735.737	0,05
1.934.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028	1.100.888	0,08
801.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030	648.117	0,05
673.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	627.236	0,04
1.240.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	1.039.653	0,07
Zyklische Konsumgüter - 304.667.076			
(31. Dezember 2021: 145.277.820)		304.667.076	21,49
1.177.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	1.011.118	0,07
1.847.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	1.656.298	0,12
2.182.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030	1.770.137	0,13
1.149.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028	1.030.499	0,07
602.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025	598.339	0,04
344.000	AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2024	332.407	0,02
630.000	Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025	618.416	0,04
680.000	Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027	651.988	0,05
672.000	Adams Homes Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2025	573.433	0,04
407.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026	379.503	0,03
882.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029	751.293	0,05
873.000	ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032	743.450	0,05
200.000	Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027	169.818	0,01
1.106.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	804.128	0,06
1.788.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	1.639.703	0,12
1.161.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027	1.012.566	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
794.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	644.762	0,05
1.160.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	960.248	0,07
1.866.000	Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031	1.537.117	0,11
684.000	Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027	635.452	0,04
950.000	Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	893.831	0,06
710.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Feb-2029	386.950	0,03
1.171.000	AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Jun-2026	489.302	0,03
518.000	American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029	419.127	0,03
40.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.250% 15-Mar-2026	37.496	0,00
430.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.500% 01-Apr-2027	388.625	0,03
225.000	American Axle & Manufacturing Inc 6.875% 01-Jul-2028	200.964	0,01
857.000	ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028	637.364	0,05
930.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	771.082	0,05
725.000	APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027	698.973	0,05
705.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	552.326	0,04
890.000	Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028	715.422	0,05
273.000	Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029	214.715	0,02
428.000	Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028	377.353	0,03
240.000	Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030	201.047	0,01
1.170.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	987.269	0,07
765.000	Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032	630.360	0,04
937.000	ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028	849.831	0,06
126.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029	101.090	0,01
190.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030	152.650	0,01
409.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028	361.810	0,03
1.510.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025	1.404.960	0,10
587.000	At Home Group Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2028	414.595	0,03
450.000	At Home Group Inc '144A' 7.125% 15-Jul-2029	261.630	0,02
605.000	Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028	562.789	0,04
376.000	Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027	374.269	0,03
1.000.000	Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036	880.700	0,06
1.408.000	Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035	1.254.106	0,09
480.000	Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033	421.923	0,03
461.000	Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029	455.929	0,03
209.000	Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037	176.947	0,01
1.246.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	1.171.381	0,08
455.000	Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025	486.595	0,03
775.000	BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027	695.973	0,05
200.000	Beazer Homes USA Inc 5.875% 15-Oct-2027	175.258	0,01
121.000	Beazer Homes USA Inc 6.750% 15-Mar-2025	117.134	0,01
15.000	Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029	13.367	0,00
324.000	Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029	272.938	0,02
895.000	Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027	834.892	0,06
807.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031	703.042	0,05
220.000	Boyer USA Inc '144A' 4.750% 15-May-2029	194.990	0,01
70.000	Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027	64.170	0,00
498.000	Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025	489.807	0,03
508.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	396.902	0,03
590.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 5.000% 15-Jun-2029	463.188	0,03
284.000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027	252.669	0,02
1.405.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	1.145.911	0,08

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
2.038.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025	1.986.313	0,14
1.799.000	Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027	1.771.313	0,13
1.490.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025	1.460.745	0,10
140.000	Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028	93.146	0,01
1.650.000	Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028	1.348.644	0,10
4.377.000	Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	3.132.925	0,22
2.755.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	1.841.048	0,13
1.160.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	921.463	0,07
955.000	Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027	904.056	0,06
298.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Feb-2026	298.097	0,02
1.755.000	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	1.429.887	0,10
1.410.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	1.450.023	0,10
179.000	Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027	173.937	0,01
316.000	Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029	251.212	0,02
200.000	Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029	140.432	0,01
266.000	Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028	236.773	0,02
510.000	Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029	197.146	0,01
840.000	Carvana Co '144A' 5.500% 15-Apr-2027	333.844	0,02
505.000	Carvana Co '144A' 5.625% 01-Oct-2025	227.712	0,02
605.000	Carvana Co '144A' 5.875% 01-Oct-2028	237.105	0,02
2.835.000	Carvana Co '144A' 10.250% 01-May-2030	1.337.421	0,09
185.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	174.568	0,01
2.174.000	CDI Escrow Issuer Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2030	1.952.652	0,14
300.000	CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026	279.375	0,02
315.000	Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029	283.391	0,02
820.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027	783.072	0,06
318.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 6.500% 01-Oct-2028	308.069	0,02
1.063.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025	1.049.733	0,07
739.000	Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027	707.023	0,05
645.000	Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029	507.970	0,04
1.250.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	1.120.688	0,08
835.000	Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027	792.503	0,06
500.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	371.897	0,03
713.000	Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026	594.790	0,04
82.000	Cinemark USA Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	83.023	0,01
1.112.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026	1.088.191	0,08
2.170.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	2.130.993	0,15
420.000	Clarios Global LP '144A' 6.750% 15-May-2025	421.175	0,03
475.000	Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	420.152	0,03
300.000	Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 5.625% 15-Nov-2026	129.474	0,01
413.000	CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027	359.111	0,03
944.000	CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026	969.384	0,07
743.000	Crocs Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2031	606.455	0,04
150.000	Crocs Inc '144A' 4.250% 15-Mar-2029	127.256	0,01
707.000	CWT Travel Group Inc '144A' 8.500% 19-Nov-2026	601.021	0,04
525.000	Dana Financing Luxembourg Sarl '144A' 5.750% 15-Apr-2025	514.401	0,04
105.000	Dana Inc 4.250% 01-Sep-2030	84.744	0,01
295.000	Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032	236.382	0,02
306.000	Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027	284.377	0,02
390.000	Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028	355.326	0,03
446.000	Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025	448.881	0,03
730.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	643.461	0,05
614.000	Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029	431.523	0,03
965.000	eG Global Finance Plc '144A' 6.750% 07-Feb-2025	843.999	0,06
630.000	eG Global Finance Plc '144A' 8.500% 30-Oct-2025	587.918	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettöver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
224.000	Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025	202.812	0,01
1.070.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 4.625% 15-Jan-2029	906.862	0,06
1.590.000	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	1.285.475	0,09
500.000	Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029	390.250	0,03
305.000	Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030	343.178	0,02
2.493.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	1.874.313	0,13
1.012.000	Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026	962.737	0,07
2.180.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	1.570.670	0,11
1.454.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	1.111.379	0,08
1.915.000	Ford Motor Co 6.100% 19-Aug-2032	1.775.299	0,13
240.000	Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029	231.192	0,02
343.000	Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028	339.700	0,02
10.000	Ford Motor Co 7.125% 15-Nov-2025	10.298	0,00
725.000	Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046	708.162	0,05
1.225.000	Ford Motor Co 7.450% 16-Jul-2031	1.255.687	0,09
404.000	Ford Motor Co 9.625 % 22-Apr-2030	457.734	0,03
800.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.300 % 10-Feb-2025	723.900	0,05
1.534.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.700% 10-Aug-2026	1.334.166	0,09
575.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028	475.608	0,03
900.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	720.031	0,05
2.160.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-Nov-2025	1.956.491	0,14
1.305.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.625% 17-Jun-2031	1.027.801	0,07
690.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024	658.706	0,05
843.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	821.093	0,06
816.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027	720.446	0,05
1.890.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	1.555.101	0,11
1.195.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024	1.150.614	0,08
1.335.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	1.197.889	0,08
1.328.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025	1.245.917	0,09
1.329.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	1.204.338	0,09
660.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026	609.263	0,04
702.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025	670.239	0,05
1.573.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.950 % 28-May-2027	1.470.393	0,10
1.741.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029	1.580.480	0,11
1.795.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16-Jun-2025	1.728.964	0,12
1.516.000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024	1.499.400	0,11
2.040.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 04-Nov-2027	2.095.488	0,15
884.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026	827.954	0,06
570.000	Forestar Group Inc '144A' 3.850% 15-May-2026	500.523	0,04
636.000	Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028	546.778	0,04
155.000	Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028	137.417	0,01
1.479.000	Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029	1.045.254	0,07
395.000	Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031	276.139	0,02
630.000	Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027	557.361	0,04
275.000	Garda World Security Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029	223.808	0,02
675.000	Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027	651.106	0,05
1.145.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026	1.002.854	0,07
645.000	GEO Group Inc/The 10.500% 30-Jun-2028	655.588	0,05
355.000	GEO Group Inc/The '144A' 9.500% 31-Dec-2028	341.488	0,02
501.000	G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025	468.088	0,03
421.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	415.610	0,03
636.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027	582.697	0,04
729.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026	688.684	0,05
590.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 15-Jul-2029	492.915	0,03
175.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250 % 30-Apr-2031	144.745	0,01
510.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.250% 15-Jul-2031	417.812	0,03
585.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033	478.512	0,03

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettöver- mögen %
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
95.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000% 15-Mar-2028	94.050	0,01
200.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025	205.834	0,01
475.000	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2028	301.221	0,02
1.085.000	Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028	920.200	0,07
395.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027	286.663	0,02
681.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.625% 15-May-2024	660.677	0,05
897.000	Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026	803.103	0,06
1.053.000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030	956.008	0,07
2.227.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032	1.787.346	0,13
1.743.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029	1.510.031	0,11
2.029.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	1.701.702	0,12
827.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025	820.637	0,06
443.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028	430.492	0,03
758.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 4.875% 01-Jul-2031	619.629	0,04
527.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029	453.892	0,03
510.000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027	486.309	0,03
388.000	IAA Inc '144A' 5.500% 15-Jun-2027	379.105	0,03
475.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4.750% 15-Sep-2026	411.798	0,03
395.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.000% 15-May-2027	347.293	0,02
632.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	535.324	0,04
804.000	International Game Technology Plc '144A' 4.125% 15-Apr-2026	750.899	0,05
710.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	662.813	0,05
603.000	International Game Technology Plc '144A' 6.250% 15-Jan-2027	599.460	0,04
622.000	IRB Holding Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	621.409	0,04
364.000	Jacobs Entertainment Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2029	329.031	0,02
650.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4.500% 01-Oct-2027	496.140	0,04
670.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029	475.467	0,03
805.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028	612.965	0,04
825.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7.750% 15-Oct-2025	760.303	0,05
374.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 7.125% 15-Apr-2026	361.501	0,03
343.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 7.750% 15-Feb-2026	331.475	0,02
536.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5.125% 01-Jun-2025	524.470	0,04
228.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	183.568	0,01
170.000	KB Home 4.800% 15-Nov-2029	148.103	0,01
348.000	KB Home 6.875% 15-Jun-2027	350.669	0,02
660.000	KB Home 7.250% 15-Jul-2030	642.140	0,05
410.000	Ken Garff Automotive LLC '144A' 4.875% 15-Sep-2028	343.645	0,02
1.115.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 4.750% 01-Jun-2027	1.072.318	0,08
197.000	Kontoor Brands Inc '144A' 4.125% 15-Nov-2029	161.265	0,01
316.000	Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027	291.583	0,02
2.007.000	Las Vegas Sands Corp 2.900% 25-Jun-2025	1.848.305	0,13
5.864.000	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	5.575.525	0,39
3.106.000	Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	2.793.704	0,20
2.441.000	Las Vegas Sands Corp 3.900% 08-Aug-2029	2.076.532	0,15
527.000	LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4.875% 01-May-2029	422.701	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
275.000	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	245.094	0,02
390.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	310.046	0,02
408.000	LGI Homes Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2029	315.761	0,02
795.000	Life Time Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2026	740.741	0,05
470.000	Life Time Inc '144A' 8.000% 15-Apr-2026	423.587	0,03
525.000	Lindblad Expeditions LLC '144A' 6.750% 15-Feb-2027	476.920	0,03
630.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	366.091	0,03
1.555.000	Lithia Motors Inc '144A' 3.875% 01-Jun-2029	1.290.650	0,09
430.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2031	350.614	0,02
260.000	Lithia Motors Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2027	234.952	0,02
627.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2028	535.820	0,04
840.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2027	750.389	0,05
780.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2024	756.440	0,05
522.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2026	494.459	0,04
1.130.000	Live Nation Entertainment Inc '144A' 6.500% 15-May-2027	1.108.859	0,08
450.000	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2026	398.840	0,03
445.000	M/I Homes Inc 3.950 % 15-Feb-2030	359.877	0,03
455.000	M/I Homes Inc 4.950% 01-Feb-2028	404.968	0,03
261.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043	157.774	0,01
465.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	324.463	0,02
217.000	Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042	142.185	0,01
571.000	Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037	457.414	0,03
673.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	596.865	0,04
312.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Mar-2030	271.190	0,02
160.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.125% 15-Mar-2032	134.720	0,01
150.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 6.700% 15-Jul-2034	125.514	0,01
240.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037	212.706	0,02
639.000	Marriott Ownership Resorts Inc 4.750% 15-Jan-2028	557.420	0,04
500.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 4.500% 15-Jun-2029	415.463	0,03
468.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2025	482.335	0,03
730.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031	560.760	0,04
705.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.125% 01-Aug-2030	576.791	0,04
355.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028	317.097	0,02
322.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	296.794	0,02
203.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029	189.150	0,01
271.000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2030	220.124	0,02
360.000	Mattamy Group Corp '144A' 5.250% 15-Dec-2027	319.890	0,02
149.000	Matthews International Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2025	140.526	0,01
1.228.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 04-Dec-2029	987.423	0,07
455.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.750% 21-Jul-2028	381.162	0,03
1.230.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4.875% 06-Jun-2025	1.131.671	0,08
525.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.250% 26-Apr-2026	462.831	0,03
770.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.625% 17-Jul-2027	656.645	0,05
118.000	Meritage Homes Corp 5.125% 06-Jun-2027	111.147	0,01
708.000	Meritage Homes Corp 6.000% 01-Jun-2025	705.811	0,05
886.000	Meritage Homes Corp '144A' 3.875% 15-Apr-2029	747.735	0,05
13.000	Merlin Entertainments Ltd '144A' 5.750% 15-Jun-2026	12.192	0,00
805.000	Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029	676.830	0,05

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
540.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	478.409	0,03
620.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.250% 18-Jun-2025	584.051	0,04
701.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15-May-2024	677.667	0,05
880.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15-May-2026	823.158	0,06
889.000	MGM Resorts International 4.625% 01-Sep-2026	815.865	0,06
1.156.000	MGM Resorts International 4.750% 15-Oct-2028	1.010.587	0,07
792.000	MGM Resorts International 5.500% 15-Apr-2027	737.614	0,05
905.000	MGM Resorts International 5.750% 15-Jun-2025	880.806	0,06
983.000	MGM Resorts International 6.750% 01-May-2025	989.615	0,07
775.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028	624.445	0,04
1.149.000	Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029	769.771	0,05
175.000	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4.875% 01-May-2029	149.129	0,01
1.650.000	Mohegan Tribal Gaming Authority '144A' 8.000% 01-Feb-2026	1.535.770	0,11
685.000	Motion Bondco DAC '144A' 6.625% 15-Nov-2027	587.388	0,04
665.000	Murphy Oil USA Inc 4.750% 15-Sep-2029	609.675	0,04
1.040.000	Murphy Oil USA Inc 5.625% 01-May-2027	1.011.639	0,07
1.005.000	Murphy Oil USA Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	830.983	0,06
254.000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15-Dec-2024	217.408	0,02
1.445.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	1.140.510	0,08
480.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875 % 15-Feb-2027	416.378	0,03
360.000	NCL Corp Ltd '144A' 7.750 % 15-Feb-2029	271.382	0,02
485.000	NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028	358.644	0,03
553.000	New Home Co Inc/The '144A' 7.250% 15-Oct-2025	469.171	0,03
1.250.000	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7.125% 01-Apr-2026	1.173.859	0,08
70.000	Nordstrom Inc 2.300 % 08-Apr-2024	65.717	0,00
241.000	Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	201.078	0,01
915.000	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	655.662	0,05
505.000	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	380.558	0,03
1.195.000	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	728.114	0,05
310.000	Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	286.362	0,02
425.000	Odeon Finco Plc '144A' 12.750% 01-Nov-2027	370.292	0,03
183.000	Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029	153.038	0,01
785.000	Party City Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	227.650	0,02
216.000	Penn Entertainment Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2029	170.922	0,01
215.000	Penn Entertainment Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2027	195.289	0,01
191.000	Penske Automotive Group Inc 3.500% 01-Sep-2025	177.560	0,01
637.000	Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029	517.845	0,04
1.435.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	1.301.045	0,09
1.345.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	1.265.736	0,09
579.000	Photo Holdings Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-Oct-2026	334.837	0,02
322.000	PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028	246.082	0,02
725.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029	535.558	0,04
435.000	Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031	308.285	0,02
1.265.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027	1.095.032	0,08
706.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2024	694.725	0,05
1.528.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	1.469.673	0,10
1.455.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	1.327.280	0,09
237.000	QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028	142.033	0,01
1.518.000	QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025	1.241.724	0,09
1.185.000	QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027	839.525	0,06
525.000	QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024	486.544	0,03
630.000	QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034	330.309	0,02
245.000	QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043	121.484	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Zyklische Konsumgüter Forts.				
630.000	Rakuten Group Inc '144A' 10.250% 30-Nov-2024	637.872	0,05	
996.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125 % 22-Apr-2026	771.900	0,05	
1.120.000	Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031	760.796	0,05	
520.000	Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026	462.707	0,03	
710.000	Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029	487.628	0,03	
170.000	Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029	137.742	0,01	
700.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031	475.435	0,03	
1.300.000	Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029	926.085	0,07	
36.000	Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027	14.670	0,00	
605.000	Rite Aid Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2026	324.513	0,02	
695.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028	511.923	0,04	
750.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027	639.424	0,05	
335.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026	271.215	0,02	
1.215.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.375% 15-Jul-2027	985.305	0,07	
727.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	611.600	0,04	
1.834.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028	1.466.870	0,10	
500.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	514.403	0,04	
1.080.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	1.160.676	0,08	
500.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.625% 15-Aug-2027	502.115	0,04	
375.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025	361.826	0,03	
2.407.000	Sands China Ltd 2.800% 08-Mar-2027	2.064.701	0,15	
765.000	Sands China Ltd 3.350% 08-Mar-2029	626.009	0,04	
2.643.000	Sands China Ltd 4.300% 08-Jan-2026	2.442.531	0,17	
1.945.000	Sands China Ltd 4.875% 18-Jun-2030	1.711.872	0,12	
6.179.000	Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	5.926.960	0,42	
5.420.000	Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	5.093.998	0,36	
292.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	247.032	0,02	
540.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028	516.081	0,04	
415.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	399.147	0,03	
470.000	Scientific Games International Inc '144A' 8.625% 01-Jul-2025	480.303	0,03	
600.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029	522.738	0,04	
230.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025	237.009	0,02	
890.000	Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030	734.063	0,05	
850.000	Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031	717.513	0,05	
468.000	Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027	436.999	0,03	
580.000	Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029	544.808	0,04	
151.000	Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027	155.123	0,01	
600.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 15-Feb-2028	524.813	0,04	
315.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp 4.750% 01-Apr-2029	265.370	0,02	
1.150.000	Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029	352.188	0,03	
488.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31-Jul-2024	470.615	0,03	
610.000	Six Flags Entertainment Corp '144A' 5.500% 15-Apr-2027	551.745	0,04	
573.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025	578.291	0,04	
140.000	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp '144A' 8.500% 28-Nov-2025	128.994	0,01	
855.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029	685.717	0,05	
355.000	Sonic Automotive Inc '144A' 4.875% 15-Nov-2031	279.568	0,02	
637.000	Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027	598.276	0,04	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Zyklische Konsumgüter Forts.				
492.000	Sotheby's/Bidfair Holdings Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029	413.772	0,03	
539.000	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc '144A' 4.875% 01-Nov-2027	479.153	0,03	
1.943.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	1.676.304	0,12	
1.165.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	840.757	0,06	
490.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	426.757	0,03	
315.000	Station Casinos LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2031	253.086	0,02	
345.000	StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029	276.448	0,02	
1.355.000	Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029	1.005.214	0,07	
120.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025	104.233	0,01	
400.000	Studio City Finance Ltd '144A' 6.500 % 15-Jan-2028	311.240	0,02	
255.000	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp '144A' 5.875% 15-May-2025	238.440	0,02	
40.000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.625% 01-Mar-2024	39.886	0,00	
200.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	174.087	0,01	
239.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028	224.199	0,02	
775.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027	745.427	0,05	
579.000	TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028	453.154	0,03	
733.000	TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029	411.720	0,03	
396.000	TPro Acquisition Corp '144A' 11.000% 15-Oct-2024	393.743	0,03	
630.000	Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024	621.603	0,04	
510.000	Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027	484.913	0,03	
457.000	Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025	451.090	0,03	
945.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.500% 01-Dec-2029	771.404	0,05	
164.000	Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030	136.296	0,01	
630.000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026	617.388	0,04	
569.000	TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 5.875% 15-Jun-2024	564.569	0,04	
138.000	Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027	123.418	0,01	
319.000	Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028	289.483	0,02	
710.000	TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029	584.685	0,04	
494.000	TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025	488.867	0,03	
895.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	772.720	0,05	
310.000	Uber Technologies Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	298.080	0,02	
747.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-May-2025	747.731	0,05	
1.415.000	Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027	1.417.434	0,10	
1.360.000	Uber Technologies Inc '144A' 8.000% 01-Nov-2026	1.367.442	0,10	
723.000	Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026	644.323	0,05	
875.000	Universal Entertainment Corp '144A' 8.500% 11-Dec-2024	818.196	0,06	
655.000	Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	656.127	0,05	
585.000	Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2029	460.044	0,03	
1.135.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027	927.005	0,07	
695.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025	629.847	0,04	
680.000	Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029	563.584	0,04	
605.000	Viking Cruises Ltd '144A' 13.000 % 15-May-2025	639.265	0,05	
365.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029	294.300	0,02	
555.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028	478.232	0,03	
310.000	Wabash National Corp '144A' 4.500% 15-Oct-2028	264.269	0,02	
347.000	WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	327.448	0,02	
784.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 4.875% 15-Sep-2028	660.160	0,05	
354.000	Wheel Pros Inc '144A' 6.500% 15-May-2029	125.670	0,01	
603.000	William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027	579.446	0,04	
520.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029	394.696	0,03	
836.000	WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	418.744	0,03	
673.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028	604.892	0,04	
1.041.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027	941.117	0,07	
1.648.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025	1.567.917	0,11	
975.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024	922.075	0,07	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen	Summe Nettover- mögen
		%	%
a			
Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumgüter Forts.			
840.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029	681.009	0,05
840.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026	771.893	0,05
1.019.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027	892.308	0,06
1.240.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5.625% 26-Aug-2028	1.061.806	0,08
888.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029	762.583	0,05
584.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.750% 15-Apr-2025	581.685	0,04
1.444.000	Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031	1.213.841	0,09
1.820.000	Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032	1.612.250	0,11
361.000	Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043	299.237	0,02
1.864.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	1.729.046	0,12
203.000	Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037	206.475	0,01
1.819.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	1.671.988	0,12
1.420.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025	1.338.516	0,09
750.000	ZipRecruiter Inc '144A' 5.000% 15-Jan-2030	619.290	0,04
Nicht-zyklische Konsumgüter - 159.329.482			
(31. Dezember 2021: 121.724.948)		159.329.482	11,24
190.000	1375209 BC Ltd '144A' 9.000% 30-Jan-2028	185.963	0,01
465.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	400.432	0,03
780.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029	718.618	0,05
806.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	765.781	0,05
350.000	ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029	289.205	0,02
500.000	AdaptHealth LLC '144A' 4.625% 01-Aug-2029	419.275	0,03
245.000	AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030	208.885	0,01
652.000	AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028	600.292	0,04
458.000	AHP Health Partners Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	359.736	0,03
600.000	Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025	32.721	0,00
545.000	Akumin Escrow Inc '144A' 7.500% 01-Aug-2028	332.710	0,02
724.000	Akumin Inc '144A' 7.000% 01-Nov-2025	519.432	0,04
900.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026	822.267	0,06
1.876.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029	1.578.072	0,11
1.579.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027	1.470.160	0,10
1.139.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030	1.018.534	0,07
1.665.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028	1.585.746	0,11
1.106.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 7.500% 15-Mar-2026	1.131.183	0,08
200.000	American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025	192.452	0,01
720.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	617.850	0,04
500.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	461.895	0,03
444.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025	433.938	0,03
1.327.000	Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028	1.240.705	0,09
2.025.000	Aramark Services Inc '144A' 6.375% 01-May-2025	2.004.224	0,14
685.000	Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029	576.102	0,04
1.400.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	1.275.008	0,09
200.000	Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043	191.840	0,01
1.268.000	B&G Foods Inc 5.250% 01-Apr-2025	1.113.802	0,08
866.000	B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027	665.493	0,05
800.000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026	561.263	0,04
1.655.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028	1.055.744	0,07
1.100.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030	529.800	0,04
1.090.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031	524.703	0,04
1.989.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025	1.693.786	0,12
800.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027	546.736	0,04
1.340.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 01-Feb-2027	925.578	0,07
889.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029	429.443	0,03
995.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9.000% 15-Dec-2025	791.930	0,06
2.099.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 11.000% 30-Sep-2028	1.647.389	0,12
413.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 14.000% 15-Oct-2030	247.241	0,02
600.000	BellRing Brands Inc '144A' 7.000% 15-Mar-2030	578.115	0,04

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen	Summe Nettover- mögen
		%	%
a			
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
712.000	Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028	434.320	0,03
537.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029	428.257	0,03
300.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030	237.259	0,02
351.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	327.103	0,02
1.030.000	CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025	889.014	0,06
1.032.000	Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030	847.406	0,06
252.000	Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028	234.829	0,02
781.000	Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031	647.527	0,05
479.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029	424.320	0,03
926.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031	802.328	0,06
390.000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028	359.869	0,03
1.035.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	867.102	0,06
630.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2028	549.495	0,04
414.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	403.787	0,03
905.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031	658.745	0,05
1.414.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.250% 15-May-2030	1.068.733	0,08
2.021.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027	1.736.605	0,12
1.035.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029	867.102	0,06
1.352.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030	672.016	0,05
409.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 01-Apr-2028	198.244	0,01
2.218.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029	1.144.118	0,08
1.959.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026	1.787.587	0,13
480.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027	433.099	0,03
990.000	Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026	940.165	0,07
630.000	Coty Inc '144A' 6.500% 15-Apr-2026	605.776	0,04
455.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029	412.432	0,03
349.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027	336.457	0,02
1.703.000	Darling Ingredients Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2030	1.666.982	0,12
2.780.000	DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	2.080.983	0,15
4.010.000	DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	3.227.319	0,23
875.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029	747.183	0,05
985.000	Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028	922.945	0,07
759.000	Elanco Animal Health Inc 6.400% 28-Aug-2028	725.991	0,05
860.000	Embecka Corp '144A' 5.000% 15-Feb-2030	729.039	0,05
405.000	Emergent BioSolutions Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2028	201.971	0,01
917.000	Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028	834.424	0,06
909.000	Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031	782.760	0,06
820.000	Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030	721.393	0,05
165.000	Encompass Health Corp 5.750% 15-Sep-2025	163.300	0,01
1.155.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029	979.076	0,07
872.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028	757.073	0,05
655.000	Energizer Holdings Inc '144A' 5.500% 31-Dec-2027	624.175	0,04
844.000	Envision Healthcare Corp '144A' 8.750% 15-Oct-2026	233.761	0,02
410.000	FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc '144A' 5.625% 15-Aug-2026	380.980	0,03
125.000	Garden Spinco Corp '144A' 8.625% 20-Jul-2030	132.681	0,01
795.000	Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025	570.246	0,04
505.000	Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028	436.648	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
504.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026	446.143	0,03
795.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025	708.003	0,05
865.000	H-Food Holdings LLC / Hearthside Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026	503.067	0,04
575.000	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029	396.790	0,03
1.401.000	Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029	1.205.317	0,09
296.000	Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028	279.609	0,02
915.000	Horizon Therapeutics USA Inc '144A' 5.500% 01-Aug-2027	933.597	0,07
919.000	Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031	774.087	0,05
1.352.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	1.293.702	0,09
1.365.000	IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027	1.304.257	0,09
2.127.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	1.899.571	0,13
51.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026	50.268	0,00
722.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	625.432	0,04
570.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027	469.537	0,03
1.040.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030	919.932	0,07
780.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032	682.613	0,05
781.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028	741.380	0,05
446.000	Land O'Lakes Capital Trust I '144A' 7.450% 15-Mar-2028	437.080	0,03
510.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027	432.174	0,03
660.000	Legacy LifePoint Health LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2025	622.162	0,04
585.000	LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029	331.367	0,02
590.000	MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6.375% 01-Jun-2029	441.020	0,03
345.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 10.000% 15-Jun-2029	187.159	0,01
500.000	Mallinckrodt International Finance SA / Mallinckrodt CB LLC '144A' 11.500% 15-Dec-2028	427.542	0,03
400.000	Mattel Inc 6.200% 01-Oct-2040	345.975	0,02
915.000	Mattel Inc '144A' 3.375% 01-Apr-2026	842.445	0,06
785.000	Mattel Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2029	690.619	0,05
380.000	Mattel Inc '144A' 5.875% 15-Dec-2027	373.069	0,03
4.654.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	3.754.219	0,27
3.045.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	2.423.987	0,17
528.000	ModivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	445.949	0,03
400.000	ModivCare Inc '144A' 5.875% 15-Nov-2025	376.247	0,03
1.375.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	1.075.442	0,08
1.445.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028	964.122	0,07
2.528.000	Newell Brands Inc 4.450% 01-Apr-2026	2.383.892	0,17
345.000	Newell Brands Inc 4.875% 01-Jun-2025	336.075	0,02
294.000	Newell Brands Inc 5.625% 01-Apr-2036	252.954	0,02
597.000	Newell Brands Inc 5.750% 01-Apr-2046	476.913	0,03
736.000	Newell Brands Inc 6.375% 15-Sep-2027	732.622	0,05
439.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	384.557	0,03
2.259.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	2.004.072	0,14
2.481.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	2.151.360	0,15
800.000	Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026	500.000	0,04
175.000	Owens & Minor Inc 4.375% 15-Dec-2024	169.427	0,01
155.000	Owens & Minor Inc '144A' 4.500% 31-Mar-2029	123.783	0,01
525.000	Owens & Minor Inc '144A' 6.625% 01-Apr-2030	451.867	0,03
694.000	P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025	563.889	0,04
1.040.000	Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029	902.512	0,06
1.584.000	Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027	1.497.339	0,11

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
305.000	Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025	306.156	0,02
985.000	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	932.165	0,07
980.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	910.371	0,06
1.400.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.400% 15-Jun-2030	1.194.728	0,08
645.000	Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044	437.183	0,03
2.435.000	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	2.051.501	0,14
2.675.000	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	2.305.516	0,16
2.280.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	2.067.960	0,15
1.596.000	Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028	1.504.717	0,11
795.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	769.989	0,05
300.000	PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026	271.882	0,02
240.000	Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031	198.085	0,01
351.000	Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028	330.039	0,02
1.190.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	1.007.436	0,07
960.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	830.181	0,06
1.015.000	Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028	571.378	0,04
1.624.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A' 9.750% 01-Dec-2026	1.310.341	0,09
1.147.000	RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025	877.341	0,06
255.000	Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031	254.002	0,02
385.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.000% 01-Apr-2031	294.683	0,02
549.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.375% 01-Feb-2032	414.588	0,03
412.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029	334.462	0,02
439.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 5.250% 15-Dec-2026	416.738	0,03
605.000	SEG Holding LLC / SEG Finance Corp '144A' 5.625% 15-Oct-2028	570.527	0,04
1.531.000	Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026	1.458.875	0,10
950.000	Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026	681.102	0,05
812.000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029	661.993	0,05
62.000	Spectrum Brands Inc 5.750% 15-Jul-2025	61.390	0,00
335.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	290.464	0,02
126.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2030	111.405	0,01
158.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	156.183	0,01
294.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	299.610	0,02
785.000	SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029	455.889	0,03
325.000	Syneos Health Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029	261.900	0,02
1.116.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	644.847	0,05
225.000	Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027	214.832	0,02
880.000	Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	804.874	0,06
1.610.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2031	1.261.524	0,09
1.331.000	Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029	1.120.176	0,08
636.000	Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	573.969	0,04
1.205.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.250% 01-Jun-2029	1.046.115	0,07
1.432.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15-Jan-2030	1.242.002	0,09
707.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 01-Sep-2024	687.711	0,05
665.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	596.067	0,04
2.170.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 01-Jan-2026	2.064.625	0,15
935.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 01-Nov-2027	871.672	0,06
2.414.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028	2.166.396	0,15
1.460.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2030	1.393.650	0,10
1.130.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027	1.081.342	0,08
749.000	Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029	589.158	0,04
300.000	Toledo Hospital/The 4.982% 15-Nov-2045	187.875	0,01
1.155.000	Toledo Hospital/The 5.325% 15-Nov-2028	906.502	0,06
1.145.000	Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	810.030	0,06
765.000	TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028	651.474	0,05
564.000	Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029	453.140	0,03
465.000	Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026	401.727	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettövermögen %	Summe Nettövermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Nicht-zyklische Konsumgüter Forts.			
337.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	324.339	0,02
487.000	US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026	432.784	0,03
701.000	US Foods Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030	618.204	0,04
1.135.000	US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029	1.009.128	0,07
795.000	US Foods Inc '144A' 6.250% 15-Apr-2025	787.975	0,06
635.000	US Renal Care Inc '144A' 10.625% 15-Jul-2027	134.937	0,01
730.000	Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031	599.936	0,04
885.000	Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030	860.143	0,06
440.000	Varex Imaging Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2027	437.950	0,03
1.271.000	Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029	1.103.902	0,08
1.022.000	Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026	1.016.164	0,07
1.275.000	Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	937.814	0,07
410.000	Winnabago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028	383.899	0,03
Elektro - 2.522.218			
(31. Dezember 2021: -)		2.522.218	0,18
690.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2026	650.959	0,05
580.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	505.627	0,04
850.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028	762.039	0,05
635.000	Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039	603.593	0,04
Energie - 167.918.925			
(31. Dezember 2021: 89.893.903)		167.918.925	11,85
650.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	645.516	0,05
790.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.625% 20-May-2024	768.061	0,05
490.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.750% 20-May-2027	456.149	0,03
965.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.875% 20-Aug-2026	917.965	0,06
885.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029	810.297	0,06
535.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	506.543	0,04
775.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028	720.231	0,05
670.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026	679.167	0,05
385.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	357.457	0,03
353.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	355.503	0,02
386.000	Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030	342.259	0,02
315.000	Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028	284.470	0,02
280.000	Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043	211.757	0,01
795.000	Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040	660.619	0,05
270.000	Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042	222.318	0,02
306.000	Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049	247.824	0,02
479.000	Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037	444.215	0,03
370.000	Apache Corp 7.375% 15-Aug-2047	371.486	0,03
190.000	Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029	199.899	0,01
820.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028	751.644	0,05
101.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027	96.578	0,01
155.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 5.875% 30-Jun-2029	138.404	0,01
725.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026	704.388	0,05
555.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 8.250% 31-Dec-2028	544.735	0,04
255.000	Athabasca Oil Corp '144A' 9.750% 01-Nov-2026	270.610	0,02
900.000	Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027	917.213	0,06
375.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026	345.006	0,02
344.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	333.515	0,02

Bestände	Beschreibung	Summe Nettövermögen %	Summe Nettövermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
1.140.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	1.132.931	0,08
671.000	Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028	618.400	0,04
577.000	Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026	517.136	0,04
771.000	Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027	675.743	0,05
391.000	Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024	378.351	0,03
330.000	Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044	243.547	0,02
243.000	Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043	182.607	0,01
50.000	Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033	45.938	0,00
864.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025	824.633	0,06
1.095.000	Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028	964.198	0,07
900.000	California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026	865.998	0,06
660.000	Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026	616.193	0,04
233.000	Callon Petroleum Co 8.250% 15-Jul-2025	233.294	0,02
311.000	Callon Petroleum Co '144A' 7.500% 15-Jun-2030	284.969	0,02
696.000	Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028	661.684	0,05
311.100	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 8.125% 15-Jan-2027	291.267	0,02
260.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 9.250% 15-Jul-2024	264.393	0,02
931.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 15-Apr-2025	971.756	0,07
153.000	CGG SA '144A' 8.750% 01-Apr-2027	123.823	0,01
1.074.000	Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028	972.884	0,07
564.063	Chesapeake Energy Corp 0.000% 15-Apr-2022	12.691	0,00
408.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026	394.240	0,03
820.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	778.153	0,05
759.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	739.987	0,05
520.000	Chord Energy Corp '144A' 6.375% 01-Jun-2026	507.166	0,04
335.000	Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026	306.694	0,02
543.000	CNX Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Apr-2030	446.327	0,03
394.000	CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029	363.122	0,03
66.000	CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027	65.619	0,00
105.000	CNX Resources Corp '144A' 7.375% 15-Jan-2031	100.786	0,01
862.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029	741.458	0,05
250.000	Colgate Energy Partners III LLC '144A' 7.750% 15-Feb-2026	243.722	0,02
530.000	Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030	456.330	0,03
889.000	Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029	803.932	0,06
1.475.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	1.291.186	0,09
1.020.000	Crescent Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026	962.487	0,07
569.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5.750% 01-Apr-2025	554.502	0,04
655.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5.625% 01-May-2027	610.277	0,04
656.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029	602.835	0,04
791.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 8.000% 01-Apr-2029	788.271	0,06
599.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029	541.404	0,04
1.500.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	1.450.552	0,10
87.000	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2025	81.562	0,01
615.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	566.713	0,04
115.000	CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028	100.289	0,01
667.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025	645.416	0,05
775.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028	700.073	0,05
1.257.000	DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029	1.082.321	0,08
1.286.000	DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031	1.080.561	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
900.000	Earthstone Energy Holdings LLC '144A' 8.000% 15-Apr-2027	860.687	0,06
944.000	Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028	858.089	0,06
1.308.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028	1.257.799	0,09
810.000	Enerflex Ltd '144A' 9.000% 15-Oct-2027	808.842	0,06
137.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026	141.966	0,01
506.000	EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029	469.042	0,03
547.000	EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028	521.777	0,04
810.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	802.751	0,06
860.000	EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025	814.221	0,06
791.000	EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026	744.923	0,05
240.000	EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045	182.305	0,01
470.000	EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047	377.604	0,03
819.000	EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044	679.329	0,05
854.000	Ensign Drilling Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2024	808.469	0,06
411.000	EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024	395.666	0,03
320.000	EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026	285.241	0,02
550.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	492.774	0,03
238.000	EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048	178.797	0,01
525.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029	441.729	0,03
740.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	606.397	0,04
341.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025	329.650	0,02
585.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027	560.138	0,04
326.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2027	319.671	0,02
595.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 7.500% 01-Jun-2030	574.115	0,04
912.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026	830.738	0,06
855.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029	702.724	0,05
172.000	FTAI Infra Escrow Holdings LLC '144A' 10.500% 01-Jun-2027	172.303	0,01
337.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 5.625% 15-Jun-2024	325.901	0,02
558.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026	511.430	0,04
704.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.500% 01-Oct-2025	669.769	0,05
447.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028	412.161	0,03
1.190.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027	1.123.324	0,08
115.000	Global Marine Inc 7.000% 01-Jun-2028	83.950	0,01
698.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029	640.324	0,04
442.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027	420.434	0,03
520.000	Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026	507.663	0,04
410.000	Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026	368.194	0,03
1.430.000	Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028	1.368.324	0,10
467.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030	399.894	0,03
220.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028	203.892	0,01
248.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.500% 15-Oct-2030	227.230	0,02
670.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	653.729	0,05
777.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029	692.705	0,05
556.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 15-Apr-2030	495.241	0,03

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
611.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031	529.315	0,04
765.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028	693.683	0,05
720.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 15-Apr-2032	622.358	0,04
655.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028	597.508	0,04
550.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 6.375% 15-Apr-2027	541.086	0,04
360.000	Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027	345.527	0,02
790.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026	778.915	0,05
1.425.000	ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029	1.202.721	0,08
833.000	KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025	788.747	0,06
1.450.000	Kinetik Holdings LP '144A' 5.875% 15-Jun-2030	1.361.743	0,10
345.000	KLX Energy Services Holdings Inc '144A' 11.500% 01-Nov-2025	311.045	0,02
605.000	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025	597.256	0,04
240.000	Laredo Petroleum Inc 10.125% 15-Jan-2028	234.416	0,02
271.000	Laredo Petroleum Inc '144A' 7.750% 31-Jul-2029	244.275	0,02
320.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026	310.096	0,02
150.000	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 28-Feb-2025	150.258	0,01
1.205.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	1.159.761	0,08
780.000	MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029	736.554	0,05
1.053.000	MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027	1.075.308	0,08
800.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	721.440	0,05
215.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027	203.572	0,01
710.000	Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027	681.042	0,05
367.000	Murphy Oil Corp 6.125% 01-Dec-2042	289.042	0,02
402.000	Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028	402.946	0,03
240.000	Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029	238.291	0,02
546.000	Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025	521.534	0,04
449.000	Nabors Industries Inc '144A' 7.375% 15-May-2027	435.463	0,03
412.000	Nabors Industries Inc '144A' 9.000% 01-Feb-2025	417.759	0,03
793.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026	748.575	0,05
752.000	Nabors Industries Ltd '144A' 7.500% 15-Jan-2028	689.190	0,05
689.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025	670.230	0,05
2.042.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026	1.900.285	0,13
1.925.000	New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025	1.825.131	0,13
2.642.000	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026	2.353.507	0,17
308.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025	251.507	0,02
539.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026	413.159	0,03
1.295.000	Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028	1.245.531	0,09
580.000	Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026	550.303	0,04
690.000	NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027	646.312	0,05
185.000	NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025	178.407	0,01
795.000	NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026	766.879	0,05
785.000	NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030	727.255	0,05
706.000	Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024	678.458	0,05
363.000	Occidental Petroleum Corp 3.000% 15-Feb-2027	329.340	0,02
139.000	Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026	131.352	0,01
385.000	Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029	343.653	0,02
76.000	Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048	58.793	0,00
415.000	Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039	332.972	0,02
417.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046	326.426	0,02
172.000	Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049	137.296	0,01
433.000	Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044	346.879	0,02
140.000	Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045	113.334	0,01
1.087.000	Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025	1.084.826	0,08
784.000	Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026	782.338	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettöver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
606.000	Occidental Petroleum Corp 5.875 % 01-Sep-2025	604.715	0,04
1.561.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	1.578.350	0,11
615.000	Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040	598.525	0,04
445.000	Occidental Petroleum Corp 6.375 % 01-Sep-2028	450.072	0,03
1.440.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	1.472.047	0,10
825.000	Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046	850.777	0,06
1.686.000	Occidental Petroleum Corp 6.625 % 01-Sep-2030	1.746.081	0,12
680.000	Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024	693.070	0,05
652.000	Occidental Petroleum Corp 7.150 % 15-May-2028	677.056	0,05
1.246.000	Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031	1.337.917	0,09
686.000	Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031	756.504	0,05
665.000	Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039	722.340	0,05
825.000	Occidental Petroleum Corp 8.500 % 15-Jul-2027	889.892	0,06
1.617.000	Occidental Petroleum Corp 8.875 % 15-Jul-2030	1.828.317	0,13
845.000	Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024	808.318	0,06
260.000	Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028	238.793	0,02
283.000	Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7.750% 15-Dec-2025	273.006	0,02
865.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.500% 01-Oct-2029	722.997	0,05
811.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 4.625% 01-May-2030	672.274	0,05
865.000	Parkland Corp/Alberta '144A' 5.875% 15-Jul-2027	822.805	0,06
425.000	Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028	376.253	0,03
275.000	Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029	247.583	0,02
995.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028	889.256	0,06
447.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 7.250% 15-Jun-2025	442.472	0,03
615.000	PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026	588.063	0,04
500.000	PDC Energy Inc 6.125% 15-Sep-2024	493.794	0,03
275.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 5.375% 15-Jan-2026	250.763	0,02
380.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027	359.061	0,03
655.000	Petrofac Ltd '144A' 9.750% 15-Nov-2026	371.005	0,03
158.000	Precision Drilling Corp '144A' 6.875% 15-Jan-2029	147.304	0,01
352.000	Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026	341.116	0,02
700.000	Puma International Financing SA '144A' 5.000% 24-Jan-2026	612.550	0,04
515.000	Puma International Financing SA '144A' 5.125% 06-Oct-2024	483.909	0,03
939.000	Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025	893.488	0,06
648.000	Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029	668.600	0,05
150.000	Range Resources Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2030	132.381	0,01
160.000	ROCC Holdings LLC '144A' 9.250% 15-Aug-2026	159.463	0,01
1.000.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	916.225	0,06
745.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025	704.673	0,05
876.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030	772.405	0,05
427.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029	384.467	0,03
715.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040	602.453	0,04
440.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038	410.104	0,03
819.000	SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025	787.502	0,06
247.000	SM Energy Co 6.500% 15-Jul-2028	237.129	0,02
349.000	SM Energy Co 6.625% 15-Jan-2027	336.715	0,02
744.000	SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026	723.484	0,05
625.000	Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024	573.359	0,04
1.022.000	Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032	875.358	0,06
317.000	Southwestern Energy Co 4.950 % 23-Jan-2025	311.969	0,02
355.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	329.619	0,02
755.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	690.028	0,05
100.000	Southwestern Energy Co 8.375% 15-Sep-2028	103.273	0,01
455.000	Strathcona Resources Ltd/Alberta '144A' 6.875% 01-Aug-2026	332.625	0,02
193.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027	184.644	0,01

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettöver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
645.000	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031	549.061	0,04
430.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025	365.812	0,03
1.080.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2026	1.026.518	0,07
317.000	Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026	283.601	0,02
1.099.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029	962.883	0,07
890.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 30-Apr-2030	773.766	0,05
580.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028	550.281	0,04
1.018.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027	1.004.174	0,07
745.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029	638.052	0,04
1.010.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028	897.304	0,06
357.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027	333.866	0,02
1.108.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030	959.561	0,07
295.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031	255.544	0,02
680.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025	687.191	0,05
706.000	Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026	743.983	0,05
555.000	Tap Rock Resources LLC '144A' 7.000% 01-Oct-2026	516.899	0,04
177.000	TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026	172.580	0,01
250.000	Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029	226.010	0,02
239.000	TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp 6.125% 15-Feb-2026	207.263	0,01
792.480	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15-Jan-2024	775.112	0,05
500.000	Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038	316.062	0,02
415.000	Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031	278.839	0,02
135.000	Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041	91.557	0,01
340.000	Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	301.172	0,02
525.000	Transocean Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026	442.795	0,03
1.200.000	Transocean Inc '144A' 8.000% 01-Feb-2027	979.896	0,07
784.000	Transocean Inc '144A' 11.500% 30-Jan-2027	787.124	0,06
806.800	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.750% 15-Oct-2024	802.596	0,06
842.800	Transocean Pontus Ltd '144A' 6.125% 01-Aug-2025	827.637	0,06
698.250	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027	680.584	0,05
513.200	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.250% 01-Dec-2024	506.335	0,04
934.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026	897.476	0,06
737.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027	690.278	0,05
98.000	Vantage Drilling International '144A' 9.250% 15-Nov-2023	97.109	0,01
1.455.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029	1.275.679	0,09
1.660.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	1.359.117	0,10
1.545.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031	1.319.044	0,09
490.000	Vermilion Energy Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2025	471.487	0,03
689.000	Vermilion Energy Inc '144A' 6.875% 01-May-2030	631.245	0,04
582.000	Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027	553.616	0,04
580.000	Weatherford International Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2028	569.409	0,04
1.430.000	Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030	1.375.793	0,10
150.000	Welltec International ApS '144A' 8.250% 15-Oct-2026	146.597	0,01
732.000	Western Midstream Operating LP 3.350 % 01-Feb-2025	694.207	0,05
124.000	Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025	117.587	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Energie Forts.			
1.533.000	Western Midstream Operating LP 4.300 % 01-Feb-2030	1.329.534	0,09
429.000	Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028	395.941	0,03
858.000	Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026	815.769	0,06
821.000	Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028	756.773	0,05
363.000	Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048	298.579	0,02
1.379.000	Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044	1.146.136	0,08
325.000	Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048	270.721	0,02
1.161.000	Western Midstream Operating LP 5.500 % 01-Feb-2050	948.060	0,07
Finanzunternehmen - 4.869.893			
(31. Dezember 2021: -)		4.869.893	0,34
820.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045	779.459	0,05
318.000	FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028	279.700	0,02
570.000	FirstCash Inc '144A' 5.625% 01-Jan-2030	508.078	0,04
1.125.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028	961.234	0,07
972.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025	915.579	0,06
480.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027	482.040	0,03
1.171.000	PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029	943.803	0,07
Finanzwerte - 133.442.992			
(31. Dezember 2021: 74.165.247)		133.442.992	9,41
650.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	537.364	0,04
870.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029	712.121	0,05
885.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	814.548	0,06
447.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026	435.463	0,03
593.000	Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027	601.167	0,04
599.000	AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028	551.401	0,04
275.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC '144A' 8.625% 30-Sep-2027	276.719	0,02
475.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	426.159	0,03
757.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Nov-2029	623.541	0,04
1.485.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027	1.338.000	0,09
960.000	Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025	931.225	0,07
820.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	696.546	0,05
608.000	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029	490.230	0,03
447.000	Aretac Escrow Issuer Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2029	369.874	0,03
390.000	Armor Holdco Inc '144A' 8.500% 15-Nov-2029	293.410	0,02
380.000	Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048	368.559	0,03
1.183.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	975.194	0,07
395.000	AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025	382.622	0,03
678.000	Blackstone Mortgage Trust Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2027	583.862	0,04
220.000	BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026	199.548	0,01
800.000	BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029	681.905	0,05
1.172.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Selcoo LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027	981.240	0,07
785.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSJ Selcoo LL '144A' 5.750% 15-May-2026	716.853	0,05
605.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.250% 15-Apr-2028	539.179	0,04

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Finanzwerte Forts.			
400.000	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	357.797	0,03
445.000	Castlelake Aviation Finance DAC '144A' 5.000% 15-Apr-2027	387.790	0,03
168.000	CNG Holdings Inc '144A' 12.500% 15-Jun-2024	143.131	0,01
710.000	Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029	419.823	0,03
725.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028	384.177	0,03
570.000	Coinbase Global Inc '144A' 3.625% 01-Oct-2031	275.260	0,02
230.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Jan-2032	183.000	0,01
1.107.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029	948.800	0,07
535.000	Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026	507.922	0,04
447.000	Credit Acceptance Corp '144A' 5.125% 31-Dec-2024	421.266	0,03
721.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028	612.227	0,04
1.610.000	Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028	753.086	0,05
790.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028	755.339	0,05
178.000	Diversified Healthcare Trust 4.375% 01-Mar-2031	113.129	0,01
498.000	Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028	284.024	0,02
515.000	Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025	494.253	0,03
1.267.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	1.312.226	0,09
967.000	Enact Holdings Inc '144A' 6.500% 15-Aug-2025	954.158	0,07
70.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 01-Sep-2024	65.994	0,00
381.000	Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025	353.846	0,02
1.320.000	Enstar Finance LLC FRN 5.500% 15-Jan-2042	1.056.858	0,07
100.000	Enstar Finance LLC FRN 5.750% 01-Sep-2040	91.180	0,01
600.000	Finance of America Funding LLC '144A' 7.875% 15-Nov-2025	312.360	0,02
326.000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15-Nov-2025	274.558	0,02
413.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027	321.934	0,02
630.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026	526.495	0,04
421.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.125% 15-Nov-2024	387.985	0,03
872.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8.250% 15-Apr-2025	785.722	0,06
560.000	Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034	493.837	0,03
2.195.958	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024	1.871.286	0,13
840.000	Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051	641.158	0,05
450.000	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027	374.787	0,03
298.000	goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026	264.153	0,02
863.000	goeasy Ltd '144A' 5.375% 01-Dec-2024	829.386	0,06
550.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5.750% 01-Dec-2025	538.435	0,04
531.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027	509.473	0,04
1.030.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026	896.296	0,06
1.120.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.750% 15-Sep-2030	825.010	0,06
423.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025	410.310	0,03
555.000	Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029	466.516	0,03
700.000	Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026	484.918	0,03
845.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029	708.909	0,05
870.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031	705.147	0,05
1.323.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028	1.194.007	0,08
585.000	HUB International Ltd '144A' 5.625% 01-Dec-2029	511.689	0,04
1.600.000	HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026	1.569.632	0,11
744.000	Hunt Cos Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2029	626.308	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Finanzwerte Forts.			
1.085.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029	919.098	0,06
1.338.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024	1.285.672	0,09
1.332.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	1.222.510	0,09
1.352.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026	1.302.234	0,09
1.003.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025	974.735	0,07
1.795.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	1.727.229	0,12
1.604.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026	1.544.768	0,11
1.004.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.198% 01-Jun-2032	741.929	0,05
697.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042	451.695	0,03
539.000	iStar Inc 4.250% 01-Aug-2025	529.106	0,04
409.000	iStar Inc 4.750% 01-Oct-2024	406.629	0,03
165.000	iStar Inc 5.500% 15-Feb-2026	164.860	0,01
370.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	318.735	0,02
1.112.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028	908.726	0,06
324.000	Jefferson Capital Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Aug-2026	268.547	0,02
665.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029	527.908	0,04
715.000	Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030	546.117	0,04
490.000	Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031	369.496	0,03
191.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027	160.829	0,01
344.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029	278.237	0,02
527.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	496.060	0,04
495.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028	300.215	0,02
230.000	LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025	155.353	0,01
150.000	LFS Topco LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2026	121.232	0,01
840.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061	513.542	0,04
480.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037	532.985	0,04
405.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051	330.464	0,02
1.221.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029	1.064.040	0,08
268.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.375% 15-May-2031	228.227	0,02
335.000	LPL Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2027	313.493	0,02
971.000	MGIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028	896.976	0,06
516.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 5.625% 15-Jan-2030	418.564	0,03
1.040.000	Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028	892.351	0,06
1.680.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.500% 15-Mar-2031	1.155.124	0,08
909.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029	694.826	0,05
1.459.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027	1.229.587	0,09
546.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030	422.431	0,03
1.334.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028	1.089.926	0,08
491.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031	382.391	0,03
555.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027	497.602	0,04
670.000	Navient Corp 4.875% 15-Mar-2028	551.971	0,04
822.000	Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027	721.028	0,05
1.026.000	Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029	838.725	0,06
65.000	Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024	63.004	0,00
630.000	Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025	605.844	0,04
209.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	199.330	0,01
550.000	Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033	392.796	0,03
870.000	Navient Corp 'MTN' 6.125% 25-Mar-2024	853.687	0,06
933.000	Necessity Retail REIT Inc/The / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028	687.126	0,05

Bestände	Beschreibung	Summe Nettvermögen %	Summe Nettver- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Finanzwerte Forts.			
743.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	633.479	0,04
2.170.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	1.793.459	0,13
770.000	NFP Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2030	728.862	0,05
120.000	NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025	121.406	0,01
637.000	Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	467.742	0,03
740.000	Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	574.919	0,04
1.284.000	Office Properties Income Trust 3.450% 15-Oct-2031	862.829	0,06
1.169.000	Office Properties Income Trust 4.250% 15-May-2024	1.108.135	0,08
2.039.000	Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	1.850.331	0,13
529.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030	488.488	0,03
270.000	Ohio National Financial Services Inc '144A' 6.625% 01-May-2031	262.023	0,02
995.000	OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027	825.074	0,06
615.000	OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028	489.860	0,03
1.270.000	OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030	949.255	0,07
770.000	OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029	631.062	0,04
1.373.000	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	1.331.491	0,09
1.145.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	1.056.354	0,07
1.573.000	OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025	1.514.650	0,11
1.640.000	OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026	1.563.100	0,11
730.000	Oxford Finance LLC / Oxford Finance Co-Issuer II Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2027	680.440	0,05
775.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	657.045	0,05
785.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028	708.234	0,05
1.208.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025	1.209.184	0,09
1.040.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	812.634	0,06
744.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	671.813	0,05
1.055.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	838.182	0,06
355.000	PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026	315.802	0,02
199.000	PRA Group Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029	164.468	0,01
731.000	PRA Group Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	707.533	0,05
898.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025	785.781	0,06
1.921.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.250% 15-Apr-2030	1.403.886	0,10
1.210.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029	916.805	0,06
722.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027	654.537	0,05
705.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029	609.027	0,04
758.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	681.351	0,05
350.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026	311.821	0,02
559.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	453.970	0,03
1.350.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026	1.165.023	0,08
777.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029	617.014	0,04
1.471.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031	1.126.268	0,08
1.245.000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033	931.640	0,07
400.000	Ryan Specialty Group LLC '144A' 4.375% 01-Feb-2030	346.858	0,02
180.000	Sagcor Financial Co Ltd '144A' 5.300% 13-May-2028	168.889	0,01
1.710.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	1.424.849	0,10
2.089.000	SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027	1.890.730	0,13
530.000	Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028	377.133	0,03
863.000	Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024	785.892	0,06
194.000	Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030	128.493	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettovermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Finanzwerte Forts.			
452.000	Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025	390.585	0,03
533.000	Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024	509.922	0,04
1.099.000	Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026	866.594	0,06
775.000	Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027	611.614	0,04
204.000	Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029	141.318	0,01
490.000	Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026	410.047	0,03
823.000	Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027	709.765	0,05
1.214.000	Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025	1.158.369	0,08
740.000	SLM Corp 3.125% 02-Nov-2026	630.254	0,04
565.000	SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025	517.922	0,04
661.000	Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025	631.896	0,04
372.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.625% 15-Jul-2026	325.963	0,02
720.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2027	631.077	0,04
422.000	StoneX Group Inc '144A' 8.625% 15-Jun-2025	426.958	0,03
365.000	Synovus Financial Corp FRN 5.900% 07-Feb-2029	357.656	0,03
375.000	Texas Capital Bancshares Inc FRN 4.000% 06-May-2031	333.659	0,02
1.700.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.459% 30-Jun-2035	1.388.140	0,10
885.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032	781.324	0,06
1.254.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034	1.154.159	0,08
823.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025	742.412	0,05
985.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029	787.498	0,06
390.000	United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027	336.301	0,02
1.178.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030	746.945	0,05
1.564.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7.875% 15-Feb-2025	1.517.220	0,11
475.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 4.750% 15-Apr-2028	378.122	0,03
900.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029	597.933	0,04
664.000	USI Inc/NY '144A' 6.875% 01-May-2025	640.710	0,05
955.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2030	766.015	0,05
1.105.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 7.875% 01-May-2027	998.279	0,07
382.000	WeWork Cos Inc '144A' 7.875% 01-May-2025	145.764	0,01
620.000	WeWork Cos LLC / WW Co-Obligor Inc '144A' 5.000% 10-Jul-2025	205.970	0,01
330.000	Wilton RE Ltd '144A' FRN (Perpetual) 6.000% 22-Oct-2030	286.955	0,02
365.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	299.456	0,02
1.026.000	XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025	988.082	0,07
Industrie - 125.327.974			
(31. Dezember 2021: 64.216.541)		125.327.974	8,84
186.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027	173.738	0,01
704.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2030	684.999	0,05
725.000	AECOM 5.125% 15-Mar-2027	698.994	0,05
1.043.000	Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030	894.221	0,06
443.000	Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027	422.008	0,03
813.000	Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029	706.054	0,05
1.000.000	ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027	697.668	0,05
1.341.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028	1.141.312	0,08
855.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029	679.233	0,05
715.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jun-2027	700.953	0,05
1.469.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	1.275.508	0,09
879.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	838.484	0,06
1.196.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	896.490	0,06

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettovermögen %
a			
Anleihen Forts.			
Industrie Forts.			
1.085.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	813.287	0,06
847.814	Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025	707.645	0,05
695.000	Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031	596.967	0,04
314.000	ATS Corp '144A' 4.125% 15-Dec-2028	271.277	0,02
1.571.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	1.256.015	0,09
1.040.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	836.607	0,06
1.020.000	Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026	990.237	0,07
711.000	Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025	702.732	0,05
592.000	Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026	566.572	0,04
513.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	501.443	0,04
270.000	Boise Cascade Co '144A' 4.875% 01-Jul-2030	236.665	0,02
700.000	Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	647.964	0,05
658.000	Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026	639.569	0,05
100.000	Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034	100.500	0,01
1.133.000	Bombardier Inc '144A' 7.500% 15-Mar-2025	1.124.293	0,08
2.138.000	Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027	2.078.254	0,15
1.010.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 8.500% 15-Jul-2025	808.570	0,06
475.000	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc '144A' 6.000% 01-Feb-2026	433.626	0,03
1.610.000	Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032	1.309.519	0,09
570.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030	506.093	0,04
480.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6.375% 15-Jun-2032	451.486	0,03
90.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028	81.182	0,01
200.000	BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029	175.328	0,01
653.000	Camelot Return Merger Sub Inc '144A' 8.750% 01-Aug-2028	600.058	0,04
888.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028	807.334	0,06
202.000	Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029	143.683	0,01
300.000	Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	301.665	0,02
300.000	Chart Industries Inc '144A' 9.500% 01-Jan-2031	307.514	0,02
550.000	Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027	522.071	0,04
20.000	Clean Harbors Inc '144A' 5.125% 15-Jul-2029	18.590	0,00
650.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 6.625% 15-Apr-2029	619.186	0,04
1.040.000	Clydesdale Acquisition Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Apr-2030	892.409	0,06
1.055.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029	744.862	0,05
319.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	258.298	0,02
505.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	414.388	0,03
700.000	CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028	520.803	0,04
63.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026	60.184	0,00
624.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026	605.810	0,04
680.000	Crown Americas LLC '144A' 5.250% 01-Apr-2030	643.936	0,05
495.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7.375% 15-Dec-2026	510.459	0,04
376.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	327.812	0,02
574.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	546.997	0,04
40.000	EnerSys '144A' 4.375% 15-Dec-2027	36.187	0,00
385.000	EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026	375.260	0,03
645.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026	530.513	0,04
1.000.000	First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	828.572	0,06
653.000	Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028	588.858	0,04
1.062.000	FXI Holdings Inc '144A' 7.875% 01-Nov-2024	881.635	0,06
1.032.000	FXI Holdings Inc '144A' 12.250% 15-Nov-2026	858.996	0,06
582.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026	562.532	0,04
985.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	867.251	0,06
736.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025	696.679	0,05
630.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	539.478	0,04
768.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025	734.779	0,05
360.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2029	305.541	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Industrie Forts.			
872.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029	764.330	0,05
845.000	GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026	809.514	0,06
833.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029	654.503	0,05
115.000	Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2032	91.183	0,01
425.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	355.239	0,02
255.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029	198.569	0,01
1.012.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	927.549	0,07
418.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	330.699	0,02
601.000	Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027	560.176	0,04
136.000	Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025	132.918	0,01
88.000	Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026	85.098	0,01
560.000	Hillenbrand Inc 5.750% 15-Jun-2025	558.242	0,04
1.024.000	Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029	871.880	0,06
1.645.000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	1.628.057	0,11
285.000	Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027	283.327	0,02
575.000	Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037	559.283	0,04
273.000	Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028	277.129	0,02
916.000	Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025	941.465	0,07
991.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	879.513	0,06
915.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028	739.667	0,05
794.000	James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028	729.789	0,05
659.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2025	552.954	0,04
153.000	JELD-WEN Inc '144A' 4.875% 15-Dec-2027	115.400	0,01
590.000	JELD-WEN Inc '144A' 6.250% 15-May-2025	555.957	0,04
343.000	JPW Industries Holding Corp '144A' 9.000% 01-Oct-2024	296.623	0,02
367.000	LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028	320.444	0,02
603.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	571.862	0,04
390.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	311.463	0,02
1.165.000	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	1.074.711	0,08
530.000	Louisiana-Pacific Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	460.062	0,03
655.000	Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028	537.932	0,04
1.115.000	Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029	766.316	0,05
474.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026	446.220	0,03
400.000	Masonite International Corp '144A' 3.500% 15-Feb-2030	324.090	0,02
1.018.000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028	943.004	0,07
1.847.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	1.799.521	0,13
1.838.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	1.703.286	0,12
160.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 8.500% 15-Apr-2024	157.593	0,01
460.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A' 10.125% 01-Aug-2024	447.585	0,03
871.000	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2030	694.579	0,05
795.000	Moog Inc '144A' 4.250% 15-Dec-2027	736.742	0,05
628.000	Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	552.656	0,04
441.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028	392.168	0,03
230.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028	213.259	0,01
165.000	OI European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030	144.729	0,01
330.000	Oscar Acquisition Co LLC / Oscar Finance Inc '144A' 9.500% 15-Apr-2030	296.571	0,02
243.000	OT Merger Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2029	129.401	0,01
610.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2025	586.942	0,04
174.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.375% 15-Aug-2025	168.405	0,01
250.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6.625% 13-May-2027	243.005	0,02
1.153.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	1.023.747	0,07

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Industrie Forts.			
855.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028	764.947	0,05
310.000	Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025	299.896	0,02
778.000	Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027	529.756	0,04
255.000	PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029	213.822	0,01
635.000	Promontoria Holding 264 BV '144A' 7.875% 01-Mar-2027	588.979	0,04
318.000	Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc '144A' 8.250% 15-Nov-2028	294.563	0,02
740.000	Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029	640.803	0,05
1.075.000	Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025	994.375	0,07
1.564.000	Rolls-Royce Plc '144A' 5.750% 15-Oct-2027	1.492.259	0,11
890.000	Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027	809.007	0,06
722.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	679.723	0,05
360.000	Sealed Air Corp '144A' 5.125% 01-Dec-2024	354.319	0,02
290.000	Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025	286.377	0,02
540.000	Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033	536.153	0,04
545.000	Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029	413.726	0,03
188.000	Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028	174.253	0,01
1.565.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	1.403.476	0,10
285.000	Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026	258.368	0,02
814.000	Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028	658.290	0,05
1.015.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	1.005.165	0,07
230.000	SPX FLOW Inc '144A' 8.750% 01-Apr-2030	181.691	0,01
1.673.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031	1.264.568	0,09
1.909.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030	1.559.671	0,11
1.320.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	1.187.169	0,08
560.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027	517.562	0,04
511.000	Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029	446.519	0,03
1.506.000	Stericycle Inc '144A' 5.375% 15-Jul-2024	1.478.252	0,10
294.000	Stevens Holding Co Inc '144A' 6.125% 01-Oct-2026	295.241	0,02
920.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029	858.176	0,06
350.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027	343.592	0,02
725.000	Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029	652.518	0,05
379.000	Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025	409.443	0,03
801.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	722.637	0,05
514.000	TK Elevator Holdco GmbH '144A' 7.625% 15-Jul-2028	420.523	0,03
1.927.000	TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027	1.708.751	0,12
886.000	TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029	727.588	0,05
425.000	TopBuild Corp '144A' 4.125% 15-Feb-2032	345.973	0,02
1.960.000	TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029	1.726.809	0,12
1.157.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	1.010.668	0,07
3.990.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	3.752.475	0,26
1.172.000	TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026	1.140.300	0,08
650.000	TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027	644.125	0,05
4.919.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	4.861.890	0,34
1.930.000	TransDigm Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2025	1.962.046	0,14
702.000	TransDigm UK Holdings Plc 6.875% 15-May-2026	686.601	0,05
292.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	254.980	0,02
1.071.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 9.250% 01-Aug-2024	1.025.597	0,07
100.000	TriMas Corp '144A' 4.125% 15-Apr-2029	87.461	0,01
214.000	Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024	208.021	0,01
530.000	Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025	446.170	0,03
937.000	Triumph Group Inc '144A' 6.250% 15-Sep-2024	886.931	0,06
779.000	Triumph Group Inc '144A' 8.875% 01-Jun-2024	793.840	0,06
865.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.500% 15-Aug-2026	794.622	0,06
790.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027	726.092	0,05
383.000	Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025	335.729	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Industrie Forts.			
1.175.000	Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028	1.000.137	0,07
515.000	Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029	283.920	0,02
300.000	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	264.618	0,02
640.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026	566.630	0,04
704.000	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027	669.912	0,05
1.038.000	Weir Group Plc/The '144A' 2.200% 13-May-2026	922.844	0,06
523.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025	351.236	0,02
1.090.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025	1.106.028	0,08
1.370.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028	1.390.850	0,10
360.000	Western Global Airlines LLC '144A' 10.375% 15-Aug-2025	270.965	0,02
390.000	XPO Escrow Sub LLC '144A' 7.500% 15-Nov-2027	395.156	0,03
Versicherungen - 1.904.107			
(31. Dezember 2021: -)		1.904.107	0,14
300.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030	254.677	0,02
910.000	Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032	757.015	0,06
976.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	892.415	0,06
Sonstige Industrie - 10.070.646			
(31. Dezember 2021: -)		10.070.646	0,71
252.000	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	228.997	0,02
1.125.000	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026	1.004.884	0,07
792.000	Albion Financing 2SARL '144A' 8.750% 15-Apr-2027	678.383	0,05
387.000	API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029	321.210	0,02
510.000	API Group DE Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2029	444.708	0,03
685.000	Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025	481.212	0,03
250.000	Arrow Bidco LLC '144A' 9.500% 15-Mar-2024	249.771	0,02
720.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028	639.167	0,04
330.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 4.000% 01-Jul-2029	290.924	0,02
400.000	Grand Canyon University 4.125% 01-Oct-2024	376.191	0,03
350.000	Grand Canyon University 5.125% 01-Oct-2028	330.151	0,02
660.000	Installed Building Products Inc '144A' 5.750% 01-Feb-2028	594.479	0,04
583.000	KBR Inc '144A' 4.750% 30-Sep-2028	518.551	0,04
580.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	508.005	0,04
350.000	Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	305.375	0,02
1.674.000	Vericast Corp '144A' 11.000% 15-Sep-2026	1.787.514	0,13
813.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15-Aug-2028	735.033	0,05
581.000	Williams Scotsman International Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025	576.091	0,04
Technologie - 100.576.647			
(31. Dezember 2021: 29.366.293)		100.576.647	7,10
115.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2026	111.900	0,01
200.000	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL '144A' 5.000% 01-May-2028	160.587	0,01
446.000	Ahead DB Holdings LLC '144A' 6.625% 01-May-2028	359.050	0,03
1.220.000	Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027	1.209.323	0,09
595.000	ams-OSRAM AG '144A' 7.000% 31-Jul-2025	560.850	0,04
2.631.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	1.943.802	0,14
1.016.000	Avaya Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2028	311.531	0,02
972.000	Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028	845.640	0,06
991.000	Block Inc 2.750% 01-Jun-2026	886.568	0,06
660.000	Block Inc 3.500% 01-Jun-2031	527.472	0,04
940.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025	915.646	0,06
387.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 9.125% 01-Mar-2026	365.713	0,03
460.000	Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026	431.848	0,03
675.000	Castle US Holding Corp '144A' 9.500% 15-Feb-2028	268.734	0,02

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Technologie Forts.			
700.000	Central Parent Inc / CDK Global Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2029	686.043	0,05
530.000	Ciena Corp '144A' 4.000% 31-Jan-2030	467.134	0,03
650.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028	563.924	0,04
1.061.000	Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029	903.601	0,06
5.235.000	Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	4.421.689	0,31
817.000	Coherent Corp '144A' 5.000% 15-Dec-2029	705.667	0,05
829.000	CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029	669.894	0,05
1.110.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	1.022.501	0,07
785.000	CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028	562.448	0,04
1.006.000	CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027	787.195	0,06
792.000	CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027	539.179	0,04
1.093.000	CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025	999.898	0,07
2.112.000	Condor Merger Sub Inc '144A' 7.375% 15-Feb-2030	1.702.432	0,12
608.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029	497.526	0,03
320.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026	300.642	0,02
419.000	Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028	385.928	0,03
935.000	CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028	718.543	0,05
301.000	CPI CG Inc '144A' 8.625% 15-Mar-2026	297.204	0,02
615.000	Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029	520.011	0,04
705.000	Diebold Nixdorf Inc '144A' 9.375% 15-Jul-2025	480.581	0,03
755.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	610.776	0,04
635.000	Endurance International Group Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029	437.324	0,03
1.083.000	Entegris Escrow Corp '144A' 5.950% 15-Jun-2030	1.000.150	0,07
500.000	Entegris Inc '144A' 3.625% 01-May-2029	407.763	0,03
378.000	Entegris Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2028	334.845	0,02
270.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	232.272	0,02
300.000	Exela Intermediate LLC / Exela Finance Inc '144A' 11.500% 15-Jul-2026	47.280	0,00
1.235.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	1.122.956	0,08
425.000	Fair Isaac Corp '144A' 5.250% 15-May-2026	416.776	0,03
1.226.000	Gartner Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2029	1.078.788	0,08
1.185.000	Gartner Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2030	1.023.215	0,07
910.000	Gartner Inc '144A' 4.500% 01-Jul-2028	850.031	0,06
1.736.000	Gen Digital Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025	1.692.548	0,12
1.762.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	1.729.051	0,12
1.310.000	Gen Digital Inc '144A' 7.125% 30-Sep-2030	1.288.844	0,09
1.450.000	GoTo Group Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027	782.133	0,06
354.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	309.803	0,02
738.000	Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl '144A' 4.625% 01-May-2028	563.795	0,04
2.481.000	Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029	2.157.444	0,15
560.000	ION Trading Technologies Sarl '144A' 5.750% 15-May-2028	469.252	0,03
1.765.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031	1.454.704	0,10
1.539.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027	1.417.773	0,10
1.889.000	Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029	1.650.759	0,12
650.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	584.968	0,04
955.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028	880.243	0,06
2.316.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030	2.017.827	0,14
1.319.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032	1.145.408	0,08
1.525.000	Iron Mountain Information Management Services Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2032	1.269.022	0,09
160.000	Likewise Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025	147.453	0,01
810.000	Maxar Technologies Inc '144A' 7.750% 15-Jun-2027	841.884	0,06
300.000	MicroStrategy Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2028	214.941	0,01
259.000	MoneyGram International Inc '144A' 5.375% 01-Aug-2026	262.830	0,02
905.000	MSCI Inc '144A' 3.250% 15-Aug-2033	700.202	0,05
1.120.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Sep-2030	932.988	0,07
1.080.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Nov-2031	894.699	0,06
1.080.000	MSCI Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2031	899.856	0,06
1.756.000	MSCI Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2029	1.532.654	0,11

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Technologie Forts.			
805.000	NCR Corp '144A' 5.000% 01-Oct-2028	687.602	0,05
787.000	NCR Corp '144A' 5.125% 15-Apr-2029	659.770	0,05
596.000	NCR Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2030	492.674	0,03
234.000	NCR Corp '144A' 5.750% 01-Sep-2027	224.283	0,02
331.000	NCR Corp '144A' 6.125% 01-Sep-2029	310.034	0,02
2.000.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	1.888.910	0,13
520.000	Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027	492.155	0,03
407.000	Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039	387.031	0,03
725.000	ON Semiconductor Corp '144A' 3.875% 01-Sep-2028	633.788	0,04
1.734.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 15-Feb-2028	1.490.980	0,11
1.550.000	Open Text Corp '144A' 3.875% 01-Dec-2029	1.248.855	0,09
1.598.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 15-Feb-2030	1.288.669	0,09
1.798.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2031	1.400.175	0,10
510.000	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2029	394.638	0,03
315.000	Pitney Bowes Inc 4.625% 15-Mar-2024	306.637	0,02
1.033.000	Pitney Bowes Inc '144A' 6.875% 15-Mar-2027	884.568	0,06
280.000	Pitney Bowes Inc '144A' 7.250% 15-Mar-2029	219.374	0,02
429.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4.875% 01-Feb-2027	391.883	0,03
735.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8.250% 01-Feb-2028	682.565	0,05
860.000	PTC Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2025	819.135	0,06
955.000	PTC Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2028	861.174	0,06
600.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2028	349.422	0,02
645.000	Rackspace Technology Global Inc '144A' 5.375% 01-Dec-2028	279.017	0,02
620.000	Rocket Software Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2029	491.047	0,03
1.335.000	Sabre GBLB Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025	1.277.912	0,09
775.000	Sabre GBLB Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2025	773.355	0,05
765.000	Sabre GBLB Inc '144A' 11.250% 15-Dec-2027	787.954	0,06
465.000	Science Applications International Corp '144A' 4.875% 01-Apr-2028	430.862	0,03
502.000	Seagate HDD Cayman 3.125% 15-Jul-2029	386.619	0,03
670.000	Seagate HDD Cayman 3.375% 15-Jul-2031	510.109	0,04
695.000	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	575.922	0,04
693.000	Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031	541.951	0,04
635.000	Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025	618.630	0,04
140.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024	137.469	0,01
699.000	Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027	652.693	0,05
604.000	Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034	513.192	0,04
905.000	Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029	781.784	0,05
260.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025	254.366	0,02
795.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.625% 01-Nov-2024	793.482	0,06
776.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.875% 01-Sep-2030	736.556	0,05
1.105.000	Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031	910.713	0,06
1.096.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030	956.018	0,07
465.000	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026	440.085	0,03
1.994.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5.500% 30-Sep-2027	1.875.480	0,13
273.000	Synaptics Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029	230.410	0,02
215.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp '144A' 5.750% 01-Jun-2025	215.739	0,02
305.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	261.992	0,02
742.000	Twilio Inc 3.625% 15-Mar-2029	603.765	0,04
685.000	Twilio Inc 3.875% 15-Mar-2031	544.438	0,04
895.000	Unisys Corp '144A' 6.875% 01-Nov-2027	688.523	0,05
2.391.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7.500% 01-Sep-2025	1.655.419	0,12
1.260.000	Verscend Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Aug-2026	1.237.144	0,09
560.000	Viavi Solutions Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2029	471.576	0,03
682.000	Virtusa Corp '144A' 7.125% 15-Dec-2028	520.723	0,04
500.000	Xerox Corp 3.800% 15-May-2024	482.560	0,03
135.000	Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035	88.232	0,01
575.000	Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039	429.350	0,03
1.153.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2025	1.056.833	0,07
1.050.000	Xerox Holdings Corp '144A' 5.500% 15-Aug-2028	842.179	0,06

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Technologie Forts.			
500.000	Ziff Davis Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2030	423.978	0,03
535.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3.875% 01-Feb-2029	450.287	0,03
Transport - 26.689.283			
(31. Dezember 2021: -)			
875.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	776.384	0,06
550.000	Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026	563.557	0,04
845.000	Allegiant Travel Co '144A' 7.250% 15-Aug-2027	804.932	0,06
676.552	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025	588.032	0,04
417.405	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	361.414	0,03
535.058	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	447.753	0,03
667.927	American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028	546.668	0,04
233.838	American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028	183.237	0,01
266.921	American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028	208.124	0,01
300.000	American Airlines 2021-1 Class B Pass Through Trust 3.950% 11-Jul-2030	242.625	0,02
370.000	American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025	313.974	0,02
1.492.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	1.603.464	0,11
3.059.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	2.946.225	0,21
2.795.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	2.554.622	0,18
335.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 4.750% 01-Apr-2028	282.687	0,02
390.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.375% 01-Mar-2029	334.128	0,02
40.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	36.246	0,00
152.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2027	138.104	0,01
890.000	Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024	844.617	0,06
390.000	Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029	324.868	0,02
686.000	Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028	612.601	0,04
1.060.000	Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026	1.084.772	0,08
503.234	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026	431.734	0,03
1.661.000	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026	1.506.361	0,11
800.000	Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026	671.000	0,05
1.385.000	Hertz Corp/The '144A' 5.000% 01-Dec-2029	1.052.462	0,07
488.333	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	491.485	0,03
200.000	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025	200.994	0,01
540.000	Stena AB '144A' 7.000% 01-Feb-2024	522.631	0,04
195.000	Stena International SA '144A' 5.750% 01-Mar-2024	187.652	0,01
400.000	Stena International SA '144A' 6.125% 01-Feb-2025	373.578	0,03
356.458	United Airlines 2016-1 Class B Pass Through Trust 3.650% 07-Jan-2026	323.216	0,02
550.694	United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 3.500% 01-May-2028	475.436	0,03
493.000	United Airlines Holdings Inc 4.875% 15-Jan-2025	471.663	0,03
160.000	United Airlines Holdings Inc 5.000% 01-Feb-2024	157.475	0,01
1.480.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	1.374.366	0,10
2.050.000	United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029	1.788.524	0,13
249.030	US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025	227.331	0,02
696.815	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025	634.341	0,05
Versorger - 31.227.179			
(31. Dezember 2021: 18.202.400)			
825.000	Algonquin Power & Utilities Corp FRN 4.750% 18-Jan-2082	669.442	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Nettovermögen %	Summe Nettover- mögen %
a			
Anleihen Forts.			
Versorger Forts.			
695.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.500% 20-May-2025	667.953	0,05
494.000	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028	438.751	0,03
939.000	Calpine Corp '144A' 3.750% 01-Mar-2031	757.002	0,05
1.454.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	1.298.006	0,09
820.000	Calpine Corp '144A' 4.625% 01-Feb-2029	707.023	0,05
750.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	631.126	0,04
1.733.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	1.550.937	0,11
426.000	Calpine Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2026	406.469	0,03
710.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Feb-2031	590.560	0,04
892.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 3.750% 15-Jan-2032	715.188	0,05
861.000	Clearway Energy Operating LLC '144A' 4.750% 15-Mar-2028	795.241	0,06
154.000	DPL Inc 4.125% 01-Jul-2025	144.948	0,01
414.000	DPL Inc 4.350 % 15-Apr-2029	372.759	0,03
405.000	Drax Finco Plc '144A' 6.625% 01-Nov-2025	387.677	0,03
490.000	FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026	434.034	0,03
250.000	FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025	232.040	0,02
630.000	FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030	501.149	0,03
495.000	FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030	404.472	0,03
694.000	FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050	462.742	0,03
1.140.000	FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027	1.065.775	0,07
673.000	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	602.041	0,04
535.000	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	603.493	0,04
578.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC '144A' 4.250% 01-Jul-2029	494.576	0,03
125.019	Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6.000% 15-Mar-2025	127.832	0,01
415.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3.875% 15-Oct-2026	380.558	0,03
359.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.250% 15-Jul-2024	348.816	0,02
1.093.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4.500% 15-Sep-2027	1.002.261	0,07
693.000	NRG Energy Inc 5.750% 15-Jan-2028	651.628	0,05
600.000	NRG Energy Inc 6.625% 15-Jan-2027	595.908	0,04
319.000	NRG Energy Inc '144A' 3.375 % 15-Feb-2029	256.702	0,02
1.385.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625 % 15-Feb-2031	1.056.098	0,07
1.447.000	NRG Energy Inc '144A' 3.875 % 15-Feb-2032	1.089.555	0,08
1.560.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	1.374.531	0,10
1.444.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	1.298.259	0,09
1.373.000	PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028	1.255.094	0,09
1.224.000	PG&E Corp 5.250% 01-Jul-2030	1.115.719	0,08
230.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	229.046	0,02
6.000	TransAlta Corp 6.500% 15-Mar-2040	5.538	0,00
450.000	TransAlta Corp 7.750% 15-Nov-2029	460.279	0,03
1.605.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	1.387.996	0,10
1.392.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.000% 31-Jul-2027	1.291.636	0,09
1.135.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2026	1.095.421	0,08
1.335.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2027	1.270.898	0,09
Gesamtanlagen in Anleihen		1.374.678.963	96,98
Aktien			
Energie - 5.755			
(31. Dezember 2021: 3.934)			
61	Chesapeake Energy Corp	5.755	0,00
Gesamtanlagen in Aktien		5.755	0,00

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps - 153.178			
(31. Dezember 2021: 4.353.157)			
(26.301.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 39 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	153.178	0,01
Credit Default Swaps insgesamt		153.178	0,01
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.655.050 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 10.495.044)			
		4.655.050	0,33
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.379.492.946	97,32
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (3.999.065) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (4.088.433))			
		(3.999.065)	(0,28)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(3.999.065)	(0,28)
Nettoumlaufvermögen		41.982.586	2,96
Summe Nettovermögen		1.417.476.467	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			
			95,53
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			
			0,33
Sonstiges Umlaufvermögen			
			4,14
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	47.053	50.250	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	154
Euro	US-Dollar	7.655.262	8.098.964	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	101.576
					USD	101.730
					EUR	95.035
US-Dollar	Euro	47.896	44.978	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(286)
US-Dollar	Euro	51.782	48.751	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(441)
US-Dollar	Euro	78.305	73.696	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(640)
					USD	(1.367)
					EUR	(1.277)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	482	514	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	78.692	83.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.044
					USD	1.046
					EUR	977
US-Dollar	Euro	817	767	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Euro	599	563	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	421	395	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(10)
					EUR	(9)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	76	81	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	12.489	13.212	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	166
US-Dollar	Euro	67	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	166
					EUR	155
US-Dollar	Euro	130	122	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	95	89	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(2)
					EUR	(2)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	71	76	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	11.619	12.292	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	154
US-Dollar	Euro	88	83	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	62	58	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	154
					EUR	144

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	121	113	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(1)
					EUR	(1)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	173.145	183.845	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.498
Euro	US-Dollar	306.088	326.575	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.100
Euro	US-Dollar	90.000	95.696	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	715
Euro	US-Dollar	148.232	157.345	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.445
Euro	US-Dollar	1.279.019	1.359.230	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10.892
Euro	US-Dollar	77	82	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	6.039	6.410	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	174.448	185.744	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.130
Euro	US-Dollar	61.121	65.417	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Euro	US-Dollar	2.066.139	2.206.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.752
Euro	US-Dollar	58.725	62.043	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	864
Euro	US-Dollar	14.499	15.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	184
Euro	US-Dollar	336.988.772	356.520.768	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.471.454
					USD	4.496.151
					EUR	4.200.241
US-Dollar	Euro	326.778	306.088	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.112)
US-Dollar	Euro	183.963	173.145	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.516)
US-Dollar	Euro	2.103.986	1.975.799	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12.547)
US-Dollar	Euro	673.803	633.697	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.032)
US-Dollar	Euro	66.366	62.522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(609)
US-Dollar	Euro	159.027	149.642	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.274)
US-Dollar	Euro	715.856	673.225	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.322)
US-Dollar	Euro	2.269.978	2.137.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19.326)
US-Dollar	Euro	382.061	359.583	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.135)
US-Dollar	Euro	53.340	50.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(493)
US-Dollar	Euro	3.437.052	3.234.751	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28.108)
US-Dollar	Euro	653.197	613.472	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.973)
US-Dollar	Euro	35.189	32.878	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
US-Dollar	Euro	249.094	233.779	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.337)
US-Dollar	Euro	105.423	99.784	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.468)
US-Dollar	Euro	646.317	610.588	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.763)
					USD	(93.046)
					EUR	(86.922)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	57	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	9.248	9.784	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	123

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Inc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	58	54	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	123
						EUR	115
US-Dollar	Euro	63	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	95	89	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(2)
						EUR	(2)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	63	67	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.194	10.785	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		135
US-Dollar	Euro	77	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	54	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	135
						EUR	126
US-Dollar	Euro	106	99	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(1)
						EUR	(1)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	13.718	14.651	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		45
Euro	US-Dollar	2.236.887	2.366.537	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		29.681
						USD	29.726
						EUR	27.770
US-Dollar	Euro	23.059	21.654	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(137)
US-Dollar	Euro	13.113	12.354	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(120)
US-Dollar	Euro	17.008	15.966	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(96)
US-Dollar	Euro	11.950	11.205	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(53)
						USD	(406)
						EUR	(379)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	279.511	230.967	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		203
US-Dollar	Pfund Sterling	413.053	339.005	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3.095
US-Dollar	Pfund Sterling	291.309	239.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.286
						USD	5.584
						GBP	4.619
Pfund Sterling	US-Dollar	833.700	1.031.557	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(23.365)
Pfund Sterling	US-Dollar	216.128	268.759	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(7.395)
Pfund Sterling	US-Dollar	690.900	846.587	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(11.083)

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.							
Pfund Sterling	US-Dollar	34.838.125	42.832.280	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(702.579)
US-Dollar	Pfund Sterling	235.175	195.381	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1.099)
						USD	(745.521)
						GBP	(616.668)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	71	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	84	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	124	101	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
						USD	1
						GBP	1
Pfund Sterling	US-Dollar	66	82	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.841	13.328	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(219)
						USD	(221)
						GBP	(183)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	348.703	419.745	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1.942
US-Dollar	Pfund Sterling	372.192	305.536	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.709
US-Dollar	Pfund Sterling	1.181.819	976.565	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		859
US-Dollar	Pfund Sterling	1.740.351	1.428.356	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		13.042
US-Dollar	Pfund Sterling	836	686	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		7
						USD	18.559
						GBP	15.351
Pfund Sterling	US-Dollar	26.751	32.559	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(208)
Pfund Sterling	US-Dollar	100.613	124.491	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2.820)
Pfund Sterling	US-Dollar	936.501	1.164.551	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(32.042)
Pfund Sterling	US-Dollar	28.891	35.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(516)
Pfund Sterling	US-Dollar	42.329.611	51.868.166	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(679.020)
Pfund Sterling	US-Dollar	110.163.833	135.442.654	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2.221.669)
US-Dollar	Pfund Sterling	994.388	826.128	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(4.647)
US-Dollar	Pfund Sterling	166.365	137.579	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(10)
						USD	(2.940.932)
						GBP	(2.432.633)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	64	53	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	76	62	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	111	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
						USD	1
						GBP	1

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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 W (Inc) (Hedged) Forts.

Pfund Sterling	US-Dollar	59	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	9.741	11.976	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(196)
						USD
						(198)
						GBP
						(164)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	67	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	80	67	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	119	97	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
						USD
						1
						GBP
						1
Pfund Sterling	US-Dollar	64	79	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.424	12.817	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(210)
						USD
						(212)
						GBP
						(175)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	321.171	387.683	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	708
US-Dollar	Pfund Sterling	120.772	99.121	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	905
US-Dollar	Pfund Sterling	81.895	67.672	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60
						USD
						1.673
						GBP
						1.384
US-Dollar	Pfund Sterling	387.589	321.171	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(702)
Pfund Sterling	US-Dollar	64.674	80.423	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.213)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.606.973	13.040.910	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(213.910)
US-Dollar	Pfund Sterling	68.684	57.062	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(321)
						USD
						(217.146)
						GBP
						(179.615)

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Supranational - 17.750.000			
(31. Dezember 2021: 28.749.161)			
17.750.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	17.750.000	5,04
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		17.750.000	5,04
Anleihen			
Argentinien - 7.498.992			
(31. Dezember 2021: 13.407.785)			
1.082.000	Banco Macro SA 'REGS' FRN 6.643% 04-Nov-2026	897.064	0,26
500.000	Pampa Energia SA 'REGS' 7.500% 24-Jan-2027	459.540	0,13
1.900.000	YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10.000% 25-Jul-2026	1.661.702	0,47
5.957.000	YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029	4.480.686	1,27
Australien - 1.790.762			
(31. Dezember 2021: -)			
2.056.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.750% 01-Oct-2030	1.790.762	0,51
Brasilien - 20.318.784			
(31. Dezember 2021: 40.166.059)			
1.430.000	Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026	882.310	0,25
3.000.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050	2.341.141	0,66
5.300.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	4.253.250	1,21
700.000	CSN Resources SA 'REGS' 4.625% 10-Jun-2031	556.920	0,16
2.000.000	CSN Resources SA 'REGS' 5.875% 08-Apr-2032	1.678.547	0,48
1.200.000	GUSAP III LP 'REGS' 4.250% 21-Jan-2030	1.116.858	0,32
2.760.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	2.132.804	0,61
2.500.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031	2.057.876	0,58
1.300.000	Nexa Resources SA 'REGS' 6.500% 18-Jan-2028	1.272.986	0,36
2.100.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	1.682.173	0,48
3.000.000	Suzano Austria GmbH 3.125% 15-Jan-2032	2.343.919	0,66
Burkina Faso - 2.576.400			
(31. Dezember 2021: 4.974.050)			
3.000.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	2.576.400	0,73
Burundi - 2.121.600			
(31. Dezember 2021: 5.226.034)			
2.550.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN' 4.125% 30-Jun-2028	2.121.600	0,60
Chile - 10.972.624			
(31. Dezember 2021: 31.419.918)			
3.040.000	CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031	2.409.200	0,69
1.500.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 5.150% 29-Jan-2050	1.304.223	0,37
1.000.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 5.500% 30-Apr-2049	889.193	0,25
1.500.000	Cia Cervecerias Unidas SA 'REGS' 3.350% 19-Jan-2032	1.267.298	0,36
2.940.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	2.348.898	0,67
1.000.000	Inversiones CMPC SA 'REGS' 3.000% 06-Apr-2031	840.076	0,24
2.200.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	1.913.736	0,54
China - 29.405.844			
(31. Dezember 2021: 18.487.192)			
2.000.000	Alibaba Group Holding Ltd 3.150% 09-Feb-2051	1.258.644	0,36
2.000.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.000% 06-Dec-2037	1.662.582	0,47
2.000.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN' 2.500% 20-Jan-2028	1.710.460	0,49
2.000.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN' 3.000% 20-Jan-2031	1.640.869	0,47
1.200.000	CNOOC Petroleum North America ULC 6.400% 15-May-2037	1.236.569	0,35
1.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd 4.200% 06-Feb-2026	605.644	0,17

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
China Forts.			
800.000	Country Garden Holdings Co Ltd 7.250% 08-Apr-2026	502.764	0,14
2.000.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN' 4.875% 22-Nov-2026	1.789.762	0,51
800.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN' 2.250% 02-Nov-2026	722.872	0,20
2.000.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 5.831% 27-Jan-2028	1.936.574	0,55
1.600.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 6.536% 27-Jul-2032	1.547.411	0,44
250.000	Longfor Group Holdings Ltd 3.850% 13-Jan-2032	173.809	0,05
4.307.000	Longfor Group Holdings Ltd 3.950% 16-Sep-2029	3.165.645	0,90
1.200.000	Prosus NV 'REGS' 3.832% 08-Feb-2051	737.731	0,21
5.650.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	4.702.521	1,33
2.500.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.240% 03-Jun-2050	1.605.640	0,46
1.000.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.840% 22-Apr-2051	715.759	0,20
1.500.000	Tencent Music Entertainment Group 1.375% 03-Sep-2025	1.336.748	0,38
1.000.000	Tencent Music Entertainment Group 2.000% 03-Sep-2030	759.668	0,22
2.000.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN' 3.500% 12-Nov-2029	1.594.172	0,45
Kolumbien - 16.801.230			
(31. Dezember 2021: 26.068.974)			
2.100.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033	1.602.345	0,46
2.800.000	Aris Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	2.198.000	0,62
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA 'REGS' 4.875% 21-Apr-2025	967.970	0,28
2.000.000	Bancolombia SA FRN 4.625% 18-Dec-2029	1.761.090	0,50
650.000	Bancolombia SA FRN 7.139% 18-Oct-2027	640.628	0,18
3.000.000	Ecopetrol SA 4.625% 02-Nov-2031	2.298.681	0,65
3.500.000	Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045	2.462.687	0,70
800.000	Ecopetrol SA 5.875% 02-Nov-2051	542.824	0,15
1.500.000	Frontera Energy Corp 'REGS' 7.875% 21-Jun-2028	1.254.193	0,36
1.000.000	Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027	861.840	0,24
1.839.000	Grupo Energia Bogota SA ESP 'REGS' 4.875% 15-May-2030	1.654.824	0,47
630.000	Oleoducto Central SA 'REGS' 4.000% 14-Jul-2027	556.148	0,16
Zypern - 1.002.573			
(31. Dezember 2021: 4.903.955)			
1.085.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031	1.002.573	0,28
Tschechische Republik - 680.887			
(31. Dezember 2021: -)			
705.000	CEZ AS 'EMTN' 2.375% 06-Apr-2027	680.887	0,19
Ecuador - 1.500.551			
(31. Dezember 2021: -)			
1.564.753	International Airport Finance SA 'REGS' 12.000% 15-Mar-2033	1.500.551	0,43
Ägypten - 4.605.250			
(31. Dezember 2021: 8.432.010)			
4.000.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031	3.301.160	0,94
1.400.000	Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	1.304.090	0,37
Ghana - 1.449.023			
(31. Dezember 2021: 3.288.800)			
2.400.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025	1.449.023	0,41
Guatemala - 2.684.475			
(31. Dezember 2021: 1.935.396)			
1.500.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	1.405.672	0,40
1.237.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	1.087.988	0,31
200.000	Energuate Trust 'REGS' 5.875% 03-May-2027	190.815	0,05
Hongkong - 6.687.140			
(31. Dezember 2021: 1.215.159)			
3.000.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	2.487.669	0,71

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Hongkong Forts.			
1.200.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.375% 04-Dec-2029	961.083	0,27
2.000.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5.750% 21-Jul-2028	1.666.195	0,47
1.800.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	1.572.193	0,45
Indien - 11.686.456			
(31. Dezember 2021: 27.028.566)		11.686.456	3,32
5.530.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 3.100% 02-Feb-2031	4.064.727	1,15
1.500.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS' 4.375% 10-Jun-2025	1.458.981	0,42
3.800.000	JSW Steel Ltd 'REGS' 5.050% 05-Apr-2032	3.012.790	0,86
700.000	Network I2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 5.650% 15-Apr-2171	671.125	0,19
3.100.000	UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	2.478.833	0,70
Indonesien - 16.821.317			
(31. Dezember 2021: 29.760.631)		16.821.317	4,78
500.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 'EMTN' 3.750% 30-Mar-2026	465.023	0,13
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT FRN (Perpetual) 4.300% 24-Mar-2171	158.228	0,05
3.350.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 5.315% 14-Apr-2032	3.089.626	0,88
200.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 6.200% 14-Apr-2052	177.000	0,05
5.000.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3.398% 09-Jun-2031	4.163.708	1,18
1.000.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4.745% 09-Jun-2051	740.081	0,21
4.000.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	3.554.380	1,01
3.300.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 2.300% 09-Feb-2031	2.675.135	0,76
500.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 15-May-2047	423.388	0,12
1.650.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS' 4.850% 14-Oct-2038	1.374.748	0,39
Israel - 15.404.452			
(31. Dezember 2021: 13.449.784)		15.404.452	4,37
3.300.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	2.849.857	0,81
1.457.627	Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030	1.382.574	0,39
2.000.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd '144A' FRN 3.077% 07-Apr-2031	1.762.500	0,50
1.500.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.750% 09-May-2027	1.381.986	0,39
1.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.375% 09-May-2030	880.262	0,25
2.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.000% 31-Jan-2025	2.418.541	0,69
1.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.150% 01-Oct-2026	869.690	0,25
1.400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.750% 09-May-2027	1.272.250	0,36
2.600.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.125% 31-Jan-2025	2.586.792	0,73
Jordanien - 2.047.848			
(31. Dezember 2021: 1.234.140)		2.047.848	0,58
2.200.000	Hikma Finance USA LLC 3.250% 09-Jul-2025	2.047.848	0,58
Kasachstan - 375.030			
(31. Dezember 2021: 1.329.303)		375.030	0,11
500.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 3.500% 14-Apr-2033	375.030	0,11
Kuwait - 6.340.729			
(31. Dezember 2021: 12.843.138)		6.340.729	1,80
3.500.000	Burgan Bank SAK FRN 2.750% 15-Dec-2031	2.558.955	0,73
2.500.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.000% 18-May-2025	2.460.940	0,70
1.500.000	NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027	1.320.834	0,37

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Litauen - 2.787.713			
(31. Dezember 2021: 4.529.608)		2.787.713	0,79
3.200.000	Akropolis Group Uab 2.875% 02-Jun-2026	2.787.713	0,79
Luxemburg - 5.286.421			
(31. Dezember 2021: 4.426.172)		5.286.421	1,50
1.600.000	Altice Financing SA 'REGS' 3.000% 15-Jan-2028	1.347.375	0,38
1.200.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	956.389	0,27
3.200.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	2.982.657	0,85
Macau - 17.957.997			
(31. Dezember 2021: 12.902.695)		17.957.997	5,10
2.500.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027	2.231.225	0,63
3.650.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027	3.257.589	0,93
2.000.000	Sands China Ltd 2.800% 08-Mar-2027	1.685.648	0,48
1.500.000	Sands China Ltd 3.750% 08-Aug-2031	1.209.450	0,34
4.417.000	Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	4.116.318	1,17
2.000.000	Studio City Finance Ltd 'REGS' 5.000% 15-Jan-2029	1.451.166	0,41
2.600.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	2.095.249	0,60
2.100.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026	1.911.352	0,54
Mauritius - 1.276.000			
(31. Dezember 2021: -)		1.276.000	0,36
1.450.000	Axian Telecom 'REGS' 7.375% 16-Feb-2027	1.276.000	0,36
Mexiko - 20.580.620			
(31. Dezember 2021: 34.627.748)		20.580.620	5,84
2.260.000	Alpek SAB de CV 'REGS' 3.250% 25-Feb-2031	1.900.784	0,54
800.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 5.875% 24-Jan-2171	714.440	0,20
600.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 24-Jan-2171	497.266	0,14
1.200.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual) 7.625% 06-Oct-2171	1.126.398	0,32
2.000.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	1.983.400	0,56
3.285.000	Becle SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031	2.557.192	0,73
1.800.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	1.317.411	0,38
1.400.000	Food Service Project SA 'REGS' 5.500% 21-Jan-2027	1.383.086	0,39
1.000.000	Grupo Televisa SAB 4.625% 30-Jan-2026	980.084	0,28
1.750.000	Industrias Panoles SAB de CV 'REGS' 4.750% 06-Aug-2050	1.449.936	0,41
1.800.000	Nemak SAB de CV 'REGS' 2.250% 20-Jul-2028	1.523.503	0,43
3.870.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	3.033.867	0,86
3.000.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	2.078.253	0,59
1.000.000	Unifin Financiera SAB de CV 'REGS' (Defaulted) 0.000% 27-Jan-2028	35.000	0,01
Moldawien - 2.391.942			
(31. Dezember 2021: 5.487.794)		2.391.942	0,68
3.335.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	2.391.942	0,68
Marokko - 2.809.430			
(31. Dezember 2021: 10.742.232)		2.809.430	0,80
2.500.000	OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	1.911.930	0,54
1.000.000	Vivo Energy Investments BV 'REGS' 5.125% 24-Sep-2027	897.500	0,26
Niederlande - 1.389.498			
(31. Dezember 2021: -)		1.389.498	0,39
1.800.000	United Group BV 'REGS' 5.250% 01-Feb-2030	1.389.498	0,39
Nigeria - 5.815.032			
(31. Dezember 2021: 18.229.905)		5.815.032	1,65
900.000	Access Bank Plc 'REGS' FRN (Perpetual) 9.125% 07-Jul-2171	645.867	0,18
2.000.000	Africa Finance Corp 3.750% 30-Oct-2029	1.726.040	0,49
3.500.000	EBN Finance Co BV 'REGS' 7.125% 16-Feb-2026	2.842.875	0,81

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Nigeria Forts.			
700.000	United Bank for Africa Plc 'REGS' 6.750% 19-Nov-2026	600.250	0,17
Panama - 3.918.135			
(31. Dezember 2021: 14.060.339)		3.918.135	1,11
1.500.000	Banco Nacional de Panama 'REGS' 2.500% 11-Aug-2030	1.214.813	0,34
2.900.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	2.703.322	0,77
Peru - 10.789.588			
(31. Dezember 2021: 21.724.781)		10.789.588	3,06
870.000	Camposol SA 'REGS' 6.000% 03-Feb-2027	577.750	0,16
1.570.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034	1.431.451	0,41
700.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	631.886	0,18
3.000.000	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 2.400% 28-Sep-2027	2.520.465	0,71
1.800.000	Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.125% 16-Aug-2027	1.650.096	0,47
1.800.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	1.380.240	0,39
4.000.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 5.625% 19-Jun-2047	2.597.700	0,74
Philippinen - 3.373.135			
(31. Dezember 2021: 5.972.267)		3.373.135	0,96
4.300.000	PLDT Inc 2.500% 23-Jan-2031	3.373.135	0,96
Polen - 1.171.806			
(31. Dezember 2021: -)		1.171.806	0,33
1.400.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027	1.171.806	0,33
Katar - 4.157.922			
(31. Dezember 2021: 13.452.839)		4.157.922	1,18
1.200.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN' 1.875% 08-Sep-2025	1.094.226	0,31
2.000.000	Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026	1.799.200	0,51
1.520.000	QatarEnergy Trading LLC 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	1.264.496	0,36
Republik Korea - 13.262.073			
(31. Dezember 2021: 8.041.048)		13.262.073	3,77
1.500.000	Kookmin Bank 'REGS' 2.500% 04-Nov-2030	1.197.075	0,34
2.500.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Perpetual) 4.350% 02-Jul-2024	2.338.959	0,67
2.350.000	LG Chem Ltd 'REGS' 4.375% 14-Jul-2025	2.285.161	0,65
3.200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	2.934.078	0,83
4.000.000	Woori Bank 'REGS' 4.750% 30-Apr-2024	3.937.760	1,12
600.000	Woori Bank 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 04-Apr-2171	569.040	0,16
Saudi-Arabien - 7.560.555			
(31. Dezember 2021: 13.257.503)		7.560.555	2,15
500.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 'EMTN' 7.750% 07-Feb-2026	490.290	0,14
5.700.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	4.404.105	1,25
2.108.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 2.250% 24-Nov-2030	1.745.083	0,50
1.000.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029	921.077	0,26
Singapur - 8.453.748			
(31. Dezember 2021: -)		8.453.748	2,40
982.000	DBS Group Holdings Ltd 'GMTN' FRN 1.822% 10-Mar-2031	874.049	0,25
2.000.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS' FRN 4.520% 11-Dec-2028	1.979.700	0,56
2.500.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 2.000% 14-Oct-2031	2.188.632	0,62
3.500.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 3.750% 15-Apr-2029	3.411.367	0,97
Taiwan - 983.260			
(31. Dezember 2021: -)		983.260	0,28
1.000.000	TSMC Global Ltd 'REGS' 4.375% 22-Jul-2027	983.260	0,28

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Tansania - 2.507.625			
(31. Dezember 2021: -)		2.507.625	0,71
2.700.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	2.507.625	0,71
Thailand - 13.224.046			
(31. Dezember 2021: 6.337.115)		13.224.046	3,75
2.700.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.466% 23-Sep-2036	2.152.893	0,61
1.200.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.733% 25-Sep-2034	1.007.152	0,28
1.500.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN (Perpetual) 5.000% 23-Mar-2171	1.418.238	0,40
3.950.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.980% 18-Mar-2031	3.195.651	0,91
1.556.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	1.382.327	0,39
1.000.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 5.200% 30-Mar-2052	805.076	0,23
1.500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.750% 18-Jun-2050	944.024	0,27
3.000.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.875% 23-Jan-2043	2.318.685	0,66
Togo - 708.750			
(31. Dezember 2021: 2.871.116)		708.750	0,20
900.000	Ecobank Transnational Inc 'REGS' FRN 8.750% 17-Jun-2031	708.750	0,20
Türkei - 8.209.005			
(31. Dezember 2021: 11.179.129)		8.209.005	2,33
4.800.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	3.958.603	1,12
1.489.595	Limak Iskenderun Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036	1.297.269	0,37
1.700.000	Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026	1.557.455	0,44
1.500.000	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS 'REGS' 5.875% 14-Jan-2026	1.395.678	0,40
Ukraine - 876.317			
(31. Dezember 2021: 7.574.597)		876.317	0,25
1.700.000	NPC Ukrenrengo 'REGS' 0.000% 09-Nov-2028	308.169	0,09
2.800.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026	568.148	0,16
Vereinigte Arabische Emirate - 16.772.343			
(31. Dezember 2021: 12.169.842)		16.772.343	4,76
1.500.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 'GMTN' 4.500% 14-Sep-2027	1.481.310	0,42
1.000.000	DAE Funding LLC 'REGS' 1.550% 01-Aug-2024	930.209	0,27
600.000	DAE Sukuk Dfrc Ltd 'REGS' 3.750% 15-Feb-2026	570.767	0,16
2.000.000	DIB Sukuk Ltd 2.950% 20-Feb-2025	1.909.418	0,54
2.000.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN' 2.950% 16-Jan-2026	1.872.920	0,53
1.500.000	EI Sukuk Co Ltd 1.827% 23-Sep-2025	1.376.892	0,39
1.849.320	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.160% 31-Mar-2034	1.579.411	0,45
2.490.748	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040	2.012.377	0,57
2.000.000	MAF Global Securities Ltd 4.750% 07-May-2024	1.976.918	0,56
1.250.000	Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	1.304.375	0,37
1.657.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	1.757.746	0,50
Vereinigtes Königreich - 1.655.987			
(31. Dezember 2021: -)		1.655.987	0,47
2.000.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS' 2.500% 15-Apr-2031	1.655.987	0,47
Gesamtanlagen in Anleihen		320.690.915	91,04

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 61.869				
(31. Dezember 2021: 76.471)				
(60)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(7.100.625)	47.838	0,01
(17)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.133.500)	14.031	0,01
Offene Terminkontrakte insgesamt			61.869	0,02
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 1.845.949 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.201.624)			1.845.949	0,52
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			340.348.733	96,62

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (5.591)				
(31. Dezember 2021: (247.063))				
(7)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(943.688)	(5.591)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(5.591)	(0,00)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (1.970.512) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (10.371))			(1.970.512)	(0,56)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.976.103)	(0,56)
Nettoumlaufvermögen			13.873.679	3,94
Summe Nettovermögen			352.246.309	100,00

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist JPMorgan Chase Bank.
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	95,34
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,02
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,52
Sonstiges Umlaufvermögen	4,12
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund								
Euro	US-Dollar	124.000	132.082	10. Jan. 23	Morgan Stanley		374	
Euro	US-Dollar	4.206.000	4.446.480	10. Jan. 23	HSBC Bank plc		46.358	
US-Dollar	Euro	821.904	769.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley		461	
							USD	47.193
US-Dollar	Euro	823.960	774.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley		(2.824)	
US-Dollar	Euro	1.355.295	1.274.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch		(5.589)	
US-Dollar	Euro	7.938.859	7.489.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley		(60.870)	
US-Dollar	Euro	16.414.895	16.809.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley		(1.540.432)	
							USD	(1.609.715)

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)								
Schweizer Franken	US-Dollar	16.759	18.105	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		60	
Schweizer Franken	US-Dollar	974	1.053	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		4	
Schweizer Franken	US-Dollar	240.451	258.033	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.897	
Schweizer Franken	US-Dollar	23.220.670	25.018.264	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		180.082	
							USD	183.043
							CHF	168.875
US-Dollar	Schweizer Franken	18.123	16.759	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(63)	
US-Dollar	Schweizer Franken	1.113	1.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(8)	
US-Dollar	Schweizer Franken	158.932	147.688	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1.335)	
US-Dollar	Schweizer Franken	243	224	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)	
US-Dollar	Schweizer Franken	18.138	16.750	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(39)	
US-Dollar	Schweizer Franken	15.108	14.040	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(127)	
US-Dollar	Schweizer Franken	344	318	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)	
US-Dollar	Schweizer Franken	1.448	1.351	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(19)	
US-Dollar	Schweizer Franken	3.451	3.203	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(25)	
							USD	(1.618)
							CHF	(1.493)

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)								
Schweizer Franken	US-Dollar	77.285	82.936	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		931	
Schweizer Franken	US-Dollar	7.463.477	8.041.252	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		57.881	
							USD	58.812
							CHF	54.260
US-Dollar	Schweizer Franken	51.110	47.495	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(429)	
							USD	(429)
							CHF	(396)

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Euro	US-Dollar	15.373	16.350	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		63
Euro	US-Dollar	10.397	11.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		57
Euro	US-Dollar	29.606	31.476	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		156
Euro	US-Dollar	64.033	68.277	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		138
Euro	US-Dollar	164.589	174.924	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		928
Euro	US-Dollar	113.263	120.703	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		310

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	80.000	84.514	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	961	
Euro	US-Dollar	40.000	42.371	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	366	
Euro	US-Dollar	61.473	64.984	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	696	
Euro	US-Dollar	5.981.807	6.328.191	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	62.959	
						USD	66.634
						EUR	62.412
US-Dollar	Euro	16.359	15.373	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(65)	
US-Dollar	Euro	38.143	35.974	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(293)	
US-Dollar	Euro	21.326	20.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(43)	
US-Dollar	Euro	409	387	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Euro	7.103	6.705	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(61)	
						USD	(467)
						EUR	(437)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
Euro	US-Dollar	93.398	98.668	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.122	
Euro	US-Dollar	7.265	7.696	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	66	
Euro	US-Dollar	100.654	106.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.139	
Euro	US-Dollar	37.035.798	39.180.407	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	389.804	
						USD	392.131
						EUR	367.284
US-Dollar	Euro	60.302	56.873	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(463)	
US-Dollar	Euro	5.725	5.369	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)	
US-Dollar	Euro	54.165	51.134	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(468)	
US-Dollar	Euro	28.483.014	26.913.550	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(272.269)	
						USD	(273.212)
						EUR	(255.900)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	254.744	270.934	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.044	
Euro	US-Dollar	3.540	3.766	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	13	
Euro	US-Dollar	849.141	897.638	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.611	
Euro	US-Dollar	20.627.165	21.849.987	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	188.724	
Euro	US-Dollar	81.896	86.516	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	984	
Euro	US-Dollar	111.052	118.560	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	91	
Euro	US-Dollar	10.753	11.444	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	45	
Euro	US-Dollar	80.902	86.217	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	222	
Euro	US-Dollar	216.907	230.528	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.223	
Euro	US-Dollar	1.014.839	1.082.103	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.183	
Euro	US-Dollar	5.193.923	5.519.234	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30.117	
Euro	US-Dollar	101.416	107.822	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	534	
Euro	US-Dollar	34.996	37.197	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	194	
Euro	US-Dollar	110.424	117.512	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	468	

Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	264.244	281.319	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.008	
Euro	US-Dollar	6.287.549	6.654.207	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63.607	
Euro	US-Dollar	75.703.920	80.087.660	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	796.788	
						USD	1.096.856
						EUR	1.027.355
US-Dollar	Euro	117.442	110.424	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(452)	
US-Dollar	Euro	281.136	264.244	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.005)	
US-Dollar	Euro	3.768	3.540	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)	
US-Dollar	Euro	271.096	254.744	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.080)	
US-Dollar	Euro	159.976	150.509	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(833)	
US-Dollar	Euro	418.557	393.691	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.075)	
US-Dollar	Euro	615.676	580.664	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.724)	
US-Dollar	Euro	239.630	225.506	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.308)	
US-Dollar	Euro	13.185	12.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27)	
US-Dollar	Euro	67.758	63.755	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(359)	
US-Dollar	Euro	33.934	31.842	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(87)	
US-Dollar	Euro	70.432	66.179	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(275)	
US-Dollar	Euro	363.638	340.609	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(279)	
US-Dollar	Euro	4.306	4.065	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)	
US-Dollar	Euro	9.779	9.240	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(94)	
						USD	(12.649)
						EUR	(11.848)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.177	1.244	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	13	
Euro	US-Dollar	113.756	120.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.197	
						USD	1.210
						EUR	1.133
US-Dollar	Euro	674	635	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
						USD	(5)
						EUR	(5)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	30	37	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Pfund Sterling	148	122	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
US-Dollar	Pfund Sterling	3.939	3.229	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	50	
US-Dollar	Pfund Sterling	619	500	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17	
US-Dollar	Pfund Sterling	84	68	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	70
					GBP	58
Pfund Sterling	US-Dollar	275	338	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7)
Pfund Sterling	US-Dollar	26.139	32.143	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(665)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.588.334	3.164.639	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71.736)
US-Dollar	Pfund Sterling	19.732	16.393	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
					USD	(72.417)
					GBP	(60.152)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Angola - 173.680			
(31. Dezember 2021: 201.465)			
200.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.750% 14-Apr-2032	173.680	0,72
Argentinien - 492.656			
(31. Dezember 2021: 541.083)			
6.590	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	1.767	0,01
37.037	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	9.930	0,04
208.928	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	56.695	0,23
54.800	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	14.871	0,06
100.399	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.500% 09-Jul-2035	25.701	0,11
693.171	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.500% 09-Jul-2035	177.447	0,73
725.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	206.245	0,85
Bahrain - 201.963			
(31. Dezember 2021: 627.724)			
200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 7.000% 12-Oct-2028	201.963	0,83
Brasilien - 520.626			
(31. Dezember 2021: 1.282.748)			
250.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	212.042	0,88
200.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	160.500	0,66
200.000	Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	148.084	0,61
Burkina Faso - 172.260			
(31. Dezember 2021: 198.888)			
200.000	Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	172.260	0,71
Chile - 512.310			
(31. Dezember 2021: 620.125)			
200.000	Chile Government International Bond 3.500% 31-Jan-2034	170.828	0,70
200.000	Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032	171.449	0,71
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4.375% 05-Feb-2049	170.033	0,70
China - 1.107.578			
(31. Dezember 2021: 1.396.258)			
200.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	181.006	0,74
200.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 3.421% 02-Nov-2030	159.394	0,66
200.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 6.536% 27-Jul-2032	193.684	0,80
200.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	166.618	0,69
440.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029	406.876	1,68
Kolumbien - 663.046			
(31. Dezember 2021: 1.001.271)			
275.000	Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	205.147	0,84
200.000	Colombia Government International Bond 4.125% 15-May-2051	120.348	0,50
200.000	Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045	136.670	0,56
200.000	Colombia Government International Bond 8.000% 20-Apr-2033	200.881	0,83
Elfenbeinküste - 410.615			
(31. Dezember 2021: 883.998)			
250.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048	187.665	0,77
235.104	Ivory Coast Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.750% 31-Dec-2032	222.950	0,92

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Dominikanische Republik - 155.091			
(31. Dezember 2021: 529.094)			
200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041	155.091	0,64
Ecuador - 445.993			
(31. Dezember 2021: 790.572)			
64.164	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	25.380	0,11
213.930	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.500% 31-Jul-2040	88.103	0,36
297.456	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2035	138.239	0,57
300.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	194.271	0,80
Ägypten - 186.270			
(31. Dezember 2021: 1.070.723)			
300.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	186.270	0,77
Ghana - 242.422			
(31. Dezember 2021: 736.275)			
450.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029	169.920	0,70
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	72.502	0,30
Guatemala - 341.587			
(31. Dezember 2021: -)			
406.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031	341.587	1,41
Hongkong - 131.287			
(31. Dezember 2021: -)			
150.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	131.287	0,54
Indien - 299.813			
(31. Dezember 2021: 351.796)			
345.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	299.813	1,24
Indonesien - 1.306.850			
(31. Dezember 2021: 2.081.891)			
200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 'REGS' 6.757% 15-Nov-2048	188.195	0,78
200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 6.500% 27-May-2041	204.119	0,84
225.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030	197.156	0,81
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.875% 17-Jul-2029	177.650	0,73
250.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4.875% 17-Jul-2049	197.850	0,82
400.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042	341.880	1,41
Israel - 369.942			
(31. Dezember 2021: 653.112)			
225.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032	194.567	0,80
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	175.375	0,73
Kasachstan - 341.127			
(31. Dezember 2021: 854.988)			
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	179.764	0,74
225.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030	161.363	0,67
Kenia - 212.882			
(31. Dezember 2021: 270.188)			
275.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	212.882	0,88

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Kuwait - 625.733			
(31. Dezember 2021: 726.820)			
200.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	174.750	0,72
260.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 4.250% 03-Nov-2026	249.233	1,03
200.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.875% 18-May-2030	201.750	0,83
Mexiko - 2.649.882			
(31. Dezember 2021: 4.055.998)			
325.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	255.158	1,05
255.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	194.004	0,80
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 5.750% 14-Feb-2042	163.916	0,68
225.000	Mexico Government International Bond 3.771% 24-May-2061	143.478	0,59
672.000	Mexico Government International Bond 4.400% 12-Feb-2052	495.269	2,04
575.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	436.456	1,80
250.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	214.597	0,89
250.000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16-Oct-2025	243.636	1,00
325.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	225.648	0,93
400.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	277.720	1,15
Marokko - 189.833			
(31. Dezember 2021: 233.174)			
200.000	OCP SA 'REGS' 6.875% 25-Apr-2044	189.833	0,78
Niederlande - 143.000			
(31. Dezember 2021: 195.562)			
200.000	VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027	143.000	0,59
Nigeria - 669.037			
(31. Dezember 2021: 866.420)			
275.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	222.742	0,92
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.625% 28-Nov-2047	129.527	0,54
225.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	150.950	0,62
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	165.818	0,68
Oman - 188.004			
(31. Dezember 2021: 840.668)			
200.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	188.004	0,77
Pakistan - 79.264			
(31. Dezember 2021: 202.304)			
200.000	Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027	79.264	0,33
Panama - 684.872			
(31. Dezember 2021: 754.565)			
550.000	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	409.358	1,69
200.000	Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060	129.073	0,53
200.000	Panama Government International Bond 4.500% 01-Apr-2056	146.441	0,60
Paraguay - 173.089			
(31. Dezember 2021: 229.250)			
200.000	Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.400% 30-Mar-2050	173.089	0,71
Peru - 493.744			
(31. Dezember 2021: 199.700)			
200.000	Consortio Transmantaro SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	180.539	0,75
200.000	Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	158.265	0,65

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Peru Forts.			
200.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	154.940	0,64
Katar - 953.356			
(31. Dezember 2021: 298.954)			
300.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	270.580	1,12
700.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 4.817% 14-Mar-2049	682.776	2,81
Republik Korea - 183.853			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	183.853	0,76
Republik Serbien - 75.454			
(31. Dezember 2021: 130.496)			
125.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	75.454	0,31
Rumänien - 589.966			
(31. Dezember 2021: 118.323)			
250.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	187.281	0,77
100.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 5.125% 15-Jun-2048	79.870	0,33
300.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	322.815	1,33
Russland - 82.930			
(31. Dezember 2021: 1.418.527)			
200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 5.100% 28-Mar-2035	82.930	0,34
Saudi-Arabien - 550.150			
(31. Dezember 2021: 617.224)			
200.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	154.275	0,64
200.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029	184.073	0,76
200.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	211.802	0,87
Senegal - 283.898			
(31. Dezember 2021: 393.360)			
400.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.750% 13-Mar-2048	283.898	1,17
Südafrika - 678.046			
(31. Dezember 2021: 608.169)			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	175.051	0,72
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.750% 30-Sep-2049	147.766	0,61
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	173.210	0,72
200.000	Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028	182.019	0,75
Supranational - 708.791			
(31. Dezember 2021: 821.367)			
200.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026	180.000	0,74
560.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	528.791	2,18
Tansania - 372.000			
(31. Dezember 2021: 418.200)			
400.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	372.000	1,53
Türkei - 767.532			
(31. Dezember 2021: 1.187.828)			
400.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	378.436	1,56
200.000	Turkey Government International Bond 5.750% 11-May-2047	137.000	0,57

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Türkei Forts.			
300.000	Türkey Government International Bond 6.875% 17-Mar-2036	252.096	1,04
Ukraine - 373.551			
(31. Dezember 2021: 804.057)		373.551	1,54
400.000	Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026	216.000	0,89
200.000	MHP Lux SA 'REGS' 6.250% 19-Sep-2029	95.126	0,39
215.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 0.000% 01-Aug-2041	62.425	0,26
Vereinigte Arabische Emirate - 1.742.318			
(31. Dezember 2021: 1.845.311)		1.742.318	7,19
200.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	177.500	0,73
275.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 4.700% 30-Sep-2049	232.191	0,96
280.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037	298.418	1,23
400.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	396.533	1,64
350.000	Emirate of Dubai Government International Bonds 'EMTN' 3.900% 09-Sep-2050	252.162	1,04
200.000	Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	208.700	0,86
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3.234% 23-Oct-2029	176.814	0,73
Gesamtanlagen in Anleihen		21.546.301	88,86

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 53.410				
(31. Dezember 2021: 27.476)				
(2)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(284.590)	18.966	0,08
(1)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(144.768)	26.760	0,11
(8)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(946.250)	6.879	0,03
3	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	615.234	735	0,00
5	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	539.649	70	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			53.410	0,22
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 5.256 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 9.510)				
			5.256	0,02
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			21.604.967	89,10

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (10.234)				
(31. Dezember 2021: (40.411))				
3	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	376.031	(3.145)	(0,01)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
6	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	805.875	(7.089)	(0,03)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(10.234)	(0,04)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (12.781) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (5.140))				
			(12.781)	(0,05)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(23.015)	(0,09)
Nettoumlaufvermögen			2.664.946	10,99
Summe Nettovermögen			24.246.898	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	88,27
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,22
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,02
Sonstiges Umlaufvermögen	11,49
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund							
US-Dollar	Euro	1.505.317	1.416.604	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC		(12.742)
						USD	(12.742)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	3.120	3.332	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		10
Euro	US-Dollar	395.392	418.309	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		5.246
						USD	5.256
						EUR	4.910
US-Dollar	Euro	2.462	2.318	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(21)
US-Dollar	Euro	3.266	3.066	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(18)
						USD	(39)
						EUR	(36)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Brasilien - 3.476.479			
(31. Dezember 2021: 5.621.646)			
9.272.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	1.680.125	6,65
7.021.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	1.222.828	4,84
2.208.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	374.870	1,48
1.199.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	198.656	0,79
Chile - 421.059			
(31. Dezember 2021: 6.559.098)			
360.000.000	Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	421.059	1,67
China - 2.946.828			
(31. Dezember 2021: 18.025.181)			
9.540.000	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	1.402.089	5,55
10.380.000	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	1.544.739	6,11
Kolumbien - 2.189.762			
(31. Dezember 2021: 9.692.355)			
1.177.800.000	Colombian TES 7.000% 30-Jun-2032	165.763	0,66
1.132.600.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	132.957	0,53
3.109.100.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	483.522	1,91
5.100.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	942.160	3,73
3.000.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	465.360	1,84
Tschechische Republik - 631.165			
(31. Dezember 2021: 2.825.037)			
2.500.000	Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030	82.989	0,33
9.880.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	264.150	1,05
7.390.000	Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029	284.026	1,12
Ungarn - 788.122			
(31. Dezember 2021: 1.892.062)			
90.760.000	Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033	141.518	0,56
15.070.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2027	29.370	0,12
161.200.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	291.140	1,15
228.890.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	326.094	1,29
Indonesien - 2.709.588			
(31. Dezember 2021: 8.055.303)			
13.591.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	855.493	3,39
2.874.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	177.951	0,70
9.826.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	647.802	2,56
729.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Jun-2035	48.316	0,19
3.596.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-Jun-2032	250.722	0,99
3.939.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Mar-2034	277.365	1,10
6.300.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	451.939	1,79
Malaysia - 1.573.235			
(31. Dezember 2021: 4.213.292)			
1.176.000	Malaysia Government Bond 3.502% 31-May-2027	263.124	1,04
1.832.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	402.996	1,60
1.161.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	261.818	1,04
215.000	Malaysia Government Bond 3.899% 16-Nov-2027	48.901	0,19
2.517.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	596.396	2,36
Mexiko - 2.221.170			
(31. Dezember 2021: 12.778.997)			
11.382.800	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	510.274	2,02
6.613.800	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	302.932	1,20
4.133.600	Mexican Bonos 8.000% 31-Jul-2053	189.187	0,75
8.311.300	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	415.132	1,64
16.534.400	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	803.645	3,18

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Peru - 546.156			
(31. Dezember 2021: 1.640.323)			
1.860.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	392.305	1,55
637.000	Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	153.851	0,61
Republik Korea - 365.336			
(31. Dezember 2021: -)			
477.530.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	365.336	1,45
Rumänien - 132.972			
(31. Dezember 2021: 560.719)			
155.000	Romania Government Bond 4.750% 24-Feb-2025	32.164	0,13
500.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	100.808	0,40
Rusland - 233.654			
(31. Dezember 2021: 13.666.415)			
53.850.000	Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027	233.654	0,92
Südafrika - 3.887.566			
(31. Dezember 2021: 13.471.984)			
34.544.794	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	1.642.027	6,50
15.290.319	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	802.480	3,18
10.816.484	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	497.751	1,97
8.907.923	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	442.113	1,75
8.076.045	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	503.195	1,99
Thailand - 1.334.287			
(31. Dezember 2021: 4.074.333)			
12.516.000	Thailand Government Bond 1.585% 17-Dec-2035	308.584	1,22
7.560.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	193.518	0,76
21.803.000	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	653.763	2,59
5.663.000	Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	178.422	0,71
Uruguay - 33.835			
(31. Dezember 2021: 118.994)			
1.557.347	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	33.835	0,13
Gesamtanlagen in Anleihen		23.491.214	92,98
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 142.171 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 910.828)		142.171	0,56
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		23.633.385	93,54
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (95.817) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (481.453))		(95.817)	(0,38)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(95.817)	(0,38)
Nettoumlaufvermögen		1.726.071	6,84
Summe Nettovermögen		25.263.639	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		91,95	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,56	
Sonstiges Umlaufvermögen		7,49	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund							
Euro	US-Dollar	980.000	1.044.634	18. Jan. 23	Morgan Stanley	5.552	
Euro	US-Dollar	200.000	213.150	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	1.174	
	US-Dollar	160.000	29.815	1. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	165	
	US-Dollar	177.020.000	197.545	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	9.206	
	US-Dollar	11.534.340	503.732	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	4.697	
	US-Dollar	375.729.077	287.343	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	11.517	
	US-Dollar	4.310.000	974.672	15. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	13.890	
	US-Dollar	252.470	12.561	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	226	
	US-Dollar	9.352.900	2.101.502	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	20.309	
	US-Dollar	435.000	93.567	15. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	250	
	US-Dollar	66.595.000	1.927.385	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	8.821	
	US-Dollar	1.033.682	5.055.740.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	5.052	
	US-Dollar	1.221.315	9.500.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	2.574	
	US-Dollar	627.219	34.980.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	360	
	US-Dollar	22.987	450.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	185	
					USD	83.978	
	US-Dollar	Euro	1.237.957	1.165.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(10.479)
	US-Dollar	1.230.000	233.838	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(3.368)	
	US-Dollar	1.331.810	7.285.000	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(33.210)	
	US-Dollar	82.366	440.000	1. Mrz. 23	Goldman Sachs	(79)	
	US-Dollar	331.902	2.303.226	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(2.755)	
	US-Dollar	258.622	4.044.323.733	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(2.411)	
	US-Dollar	201.866	783.844	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.187)	
	US-Dollar	1.109.563	19.619.609	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	(38.101)	
	US-Dollar	23.826	9.329.000	16. Mrz. 23	Goldman Sachs	(674)	
					USD	(94.264)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Euro	US-Dollar	14.421	15.331	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	117	
Euro	US-Dollar	9.342	9.924	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	83	
Euro	US-Dollar	16.179	17.279	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	53	
Euro	US-Dollar	1.689.570	1.787.499	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22.419	
					USD	22.672	
					EUR	21.180	
	US-Dollar	Euro	12.114	11.358	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(54)
	US-Dollar	Euro	17.277	16.186	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(62)
					USD	(116)	
					EUR	(108)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
Euro	US-Dollar	14.663	15.625	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	82	
Euro	US-Dollar	11.610	12.310	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	126	
Euro	US-Dollar	9.874	10.568	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	12.711	13.502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	114	
Euro	US-Dollar	21.988	23.482	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	72	

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	2.292.959	2.425.860	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30.425	
					USD	30.828	
					EUR	28.799	
	US-Dollar	Euro	16.473	15.446	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(73)
	US-Dollar	Euro	23.313	21.841	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(84)
	US-Dollar	Euro	8.763	8.242	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(65)
	US-Dollar	Euro	16.956	15.959	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(139)
	US-Dollar	Euro	14.815	13.912	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(88)
					USD	(449)	
					EUR	(419)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged)							
Euro	US-Dollar	64.496	68.481	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	558	
Euro	US-Dollar	1.921	2.048	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11	
Euro	US-Dollar	1.534	1.626	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17	
Euro	US-Dollar	1.659	1.762	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15	
Euro	US-Dollar	2.867	3.062	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	298.736	316.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.964	
					USD	4.574	
					EUR	4.273	
	US-Dollar	Euro	1.927	1.809	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
	US-Dollar	Euro	2.135	2.001	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
	US-Dollar	Euro	3.025	2.834	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
	US-Dollar	Euro	68.525	64.496	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(565)
					USD	(597)	
					EUR	(558)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	53	57	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	43	45	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	46	49	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	80	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	8.313	8.795	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	110	
	US-Dollar	Euro	54	50	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
	US-Dollar	Euro	59	56	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
	US-Dollar	Euro	84	79	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	111	
					EUR	104	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling J (Inc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	27	32	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Pfund Sterling	US-Dollar	21	25	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling J (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	23	28	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	29	24	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	32	26	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	49	39	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
					USD	1
					GBP	1
Pfund Sterling	US-Dollar	39	49	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	4.051	4.981	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(82)
					USD	(83)
					GBP	(69)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	99	119	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	79	95	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	119	97	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	178	143	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
					USD	7
					GBP	6
Pfund Sterling	US-Dollar	84	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	145	180	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
Pfund Sterling	US-Dollar	14.907	18.328	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(301)
US-Dollar	Pfund Sterling	104	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(308)
					GBP	(255)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Argentinien - 329.952			
(31. Dezember 2021: 201.706)			
21.880	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029	5.866	0,02
349.200	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.500% 09-Jul-2035	89.393	0,37
825.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	234.693	0,96
Brasilien - 2.408.402			
(31. Dezember 2021: 1.484.114)			
1.869.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	338.671	1,38
7.439.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	1.295.630	5,29
1.450.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	246.178	1,01
300.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031	49.705	0,20
200.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	169.634	0,69
200.000	Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	160.500	0,66
200.000	Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031	148.084	0,60
Chile - 198.833			
(31. Dezember 2021: 1.332.556)			
170.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	198.833	0,81
China - 757.296			
(31. Dezember 2021: 1.967.394)			
200.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	181.006	0,74
1.160.000	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	172.630	0,70
1.500.000	China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	237.042	0,97
200.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	166.618	0,68
Kolumbien - 1.598.841			
(31. Dezember 2021: 1.297.225)			
300.000	Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031	223.796	0,91
200.000	Colombia Government International Bond 3.250% 22-Apr-2032	146.053	0,60
200.000	Colombia Government International Bond 8.000% 20-Apr-2033	200.882	0,82
150.000.000	Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050	17.609	0,07
346.100.000	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	53.825	0,22
2.933.300.000	Colombian TES 9.250% 28-May-2042	438.542	1,79
1.520.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024	280.801	1,15
1.530.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	237.333	0,97
Elfenbeinküste - 348.091			
(31. Dezember 2021: 445.664)			
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	168.998	0,69
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031	179.093	0,73
Tschechische Republik - 175.441			
(31. Dezember 2021: 287.058)			
1.250.000	Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030	41.495	0,17
5.010.000	Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040	133.946	0,55
Ecuador - 323.024			
(31. Dezember 2021: 341.135)			
34.728	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	13.737	0,06
118.040	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.500% 31-Jul-2040	48.612	0,20
212.556	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2035	98.783	0,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Ecuador Forts.			
250.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	161.892	0,66
Ghana - 72.502			
(31. Dezember 2021: 359.839)			
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035	72.502	0,30
Guatemala - 172.418			
(31. Dezember 2021: -)			
180.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029	172.418	0,70
Hongkong - 131.287			
(31. Dezember 2021: -)			
150.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	131.287	0,54
Ungarn - 573.273			
(31. Dezember 2021: 268.721)			
68.260.000	Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033	106.435	0,43
147.100.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	265.674	1,09
141.200.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	201.164	0,82
Indien - 173.804			
(31. Dezember 2021: 203.940)			
200.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	173.804	0,71
Indonesien - 1.804.754			
(31. Dezember 2021: 1.824.239)			
250.000	Adaro Indonesia PT 'REGS' 4.250% 31-Oct-2024	241.013	0,99
4.050.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	250.766	1,02
5.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	362.600	1,48
1.100.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036	771.78	0,32
4.200.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	301.293	1,23
2.230.000.000	Indonesia Treasury Bond 9.000% 15-Mar-2029	159.633	0,65
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.000% 30-Jun-2030	164.408	0,67
290.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042	247.863	1,01
Israel - 566.587			
(31. Dezember 2021: 676.861)			
200.000	Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031	175.375	0,71
280.000	ICL Group Ltd '144A' 6.375% 31-May-2038	276.500	1,13
115.000	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023	114.712	0,47
Kasachstan - 479.138			
(31. Dezember 2021: 433.870)			
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030	179.764	0,73
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.750% 19-Apr-2047	155.940	0,64
200.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030	143.434	0,59
Kuwait - 174.750			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	174.750	0,71
Malaysia - 764.827			
(31. Dezember 2021: 389.269)			
350.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	76.992	0,31
1.440.000	Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	324.736	1,33
415.000	Malaysia Government Bond 4.893% 08-Jun-2038	100.325	0,41
1.109.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	262.774	1,07
Mexiko - 2.490.252			
(31. Dezember 2021: 3.201.286)			
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	157.020	0,64

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Mexiko Forts.			
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	152.160	0,62
200.000	Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV 'REGS' 4.875% 14-Jan-2048	153.352	0,63
12.253.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	582.352	2,38
10.550.000	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	472.940	1,93
6.500.000	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	315.929	1,29
151.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	129.617	0,53
65.000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029	55.795	0,23
250.000	Petroleos Mexicanos 6.700% 16-Feb-2032	196.838	0,80
195.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	135.389	0,55
200.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	138.860	0,57
Marokko - 152.577			
(31. Dezember 2021: 189.453)			
200.000	OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	152.577	0,62
Nigeria - 451.404			
(31. Dezember 2021: 585.799)			
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.875% 16-Feb-2032	151.408	0,62
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	134.178	0,55
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	165.818	0,67
Panama - 376.374			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	148.857	0,61
300.000	Panama Government International Bond 4.500% 16-Apr-2050	227.517	0,93
Peru - 591.640			
(31. Dezember 2021: 445.694)			
200.000	Consorcio Transmantar SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	180.539	0,73
1.100.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	232.009	0,95
100.000	Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029	24.152	0,10
200.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	154.940	0,63
Katar - 429.441			
(31. Dezember 2021: 297.930)			
200.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	180.387	0,73
300.000	QatarEnergy Trading LLC 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	249.054	1,02
Republik Korea - 538.286			
(31. Dezember 2021: -)			
463.280.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	354.434	1,45
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	183.852	0,75
Republik Serbien - 60.363			
(31. Dezember 2021: 104.397)			
100.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	60.363	0,25
Rumänien - 476.455			
(31. Dezember 2021: 24.086)			
100.000	Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027	20.162	0,08
250.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	187.281	0,76
250.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	269.012	1,10
Russland - 182.875			
(31. Dezember 2021: 2.878.000)			
42.147.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028	182.875	0,75

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Saudi-Arabien - 154.275			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	154.275	0,63
Senegal - 327.600			
(31. Dezember 2021: 407.543)			
395.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6.250% 23-May-2033	327.600	1,34
Südafrika - 2.618.344			
(31. Dezember 2021: 2.080.836)			
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028	175.051	0,71
16.700.000	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	793.806	3,24
12.843.368	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	674.057	2,75
6.150.000	Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	283.009	1,16
7.175.000	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	356.106	1,45
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	173.210	0,71
200.000	Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031	163.105	0,67
Supranational - 410.487			
(31. Dezember 2021: 505.743)			
230.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.994% 21-Sep-2029	200.583	0,82
245.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4.700% 22-Oct-2031	209.904	0,86
Tansania - 186.000			
(31. Dezember 2021: 407.427)			
200.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	186.000	0,76
Thailand - 850.026			
(31. Dezember 2021: 736.008)			
200.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	177.357	0,72
6.750.000	Thailand Government Bond 1.585% 17-Dec-2035	166.422	0,68
7.250.000	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	217.391	0,89
6.000.000	Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031	189.040	0,77
2.971.000	Thailand Government Bond 4.875% 22-Jun-2029	99.816	0,41
Türkei - 189.218			
(31. Dezember 2021: 398.348)			
200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025	189.218	0,77
Ukraine - 182.695			
(31. Dezember 2021: 485.683)			
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2034	38.130	0,16
115.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 0.000% 01-Aug-2041	33.390	0,14
200.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6.200% 11-Feb-2025	111.175	0,45
Vereinigte Arabische Emirate - 797.623			
(31. Dezember 2021: 897.272)			
200.000	DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028	177.500	0,73
200.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037	213.156	0,87
200.000	DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025	198.267	0,81
200.000	Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	208.700	0,85
Uruguay - 40.438			
(31. Dezember 2021: 39.754)			
600.000	Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031	13.036	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
1.195.000	Uruguay Forts. Uruguay Government International Bond 'REGS' 8.500% 15-Mar-2028	27.402	0,11

Gesamtanlagen in Anleihen 22.559.593 92,11

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 48.405 (31. Dezember 2021: 3.494)				
(4)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(569.180)	37.933	0,16
(12)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.419.375)	10.318	0,04
11	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.187.227	154	0,00

Offene Terminkontrakte insgesamt 48.405 0,20

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 57.037 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 96.068) 57.037 0,23

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 22.665.035 92,54

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (2.363) (31. Dezember 2021: (1.441))				
2	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	268.625	(2.363)	(0,01)

Offene Terminkontrakte insgesamt (2.363) (0,01)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (81.275) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (81.789)) (81.275) (0,33)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (83.638) (0,34)

Nettoumlaufvermögen 1.910.553 7,80

Summe Nettovermögen 24.491.950 100,00

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	91,76
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,20
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,23
Sonstiges Umlaufvermögen	7,81
Gesamtvermögen	100,00

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

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

Euro	US-Dollar	245.000	261.158	18. Jan. 23	Morgan Stanley	1.388
Brasilianischer Real	US-Dollar	1.300.000	241.748	1. Mrz. 23	Goldman Sachs	1.838
Chilenischer Peso	US-Dollar	72.170.000	80.538	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	3.753
Chinesischer Yuan	US-Dollar	5.896.831	849.706	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	7.099
Chinesischer Yuan	US-Dollar	144.972	20.899	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	166
Tschechische Krone	US-Dollar	6.137.700	268.048	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	2.499
Indonesische Rupiah	US-Dollar	1.034.432.529	66.149	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	617
Koreanischer Won	US-Dollar	361.803.142	276.693	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	11.090
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	2.137.103	483.289	15. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	6.887
Polnischer Zloty	US-Dollar	5.150.000	1.157.153	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	11.183
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	434.110	24.515	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	879
Thailändischer Baht	US-Dollar	41.162.774	1.191.328	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	5.453
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	354.045	1.731.635.145	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	1.730
US-Dollar	Hongkong-Dollar	551.520	4.290.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	1.162
US-Dollar	Philippinischer Peso	600.054	33.465.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	344
US-Dollar	Türkische Lira	117.999	2.310.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	949

USD 57.037

US-Dollar	Euro	1.346.344	1.267.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(11.396)
Brasilianischer Real	US-Dollar	250.000	46.947	1. Mrz. 23	Goldman Sachs	(104)
Brasilianischer Real	US-Dollar	610.000	115.968	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(1.670)
US-Dollar	Brasilianischer Real	1.193.784	6.530.000	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(29.769)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	340.535	6.844.332	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	(6.135)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	198.220	769.689	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(3.129)
US-Dollar	Rumänischer Leu	215.968	1.005.000	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	(781)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	660.409	11.677.537	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	(22.678)
US-Dollar	Ungarischer Forint	198.342	77.660.000	16. Mrz. 23	Goldman Sachs	(5.613)

USD (81.275)

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Irland - 3.737.054			
(31. Dezember 2021: 4.014.000)			
3.737.054	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	3.737.054	9,77
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		3.737.054	9,77
Anleihen			
Angola - 176.056			
(31. Dezember 2021: 687.358)			
200.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.000% 26-Nov-2029	176.056	0,46
Argentinien - 800.990			
(31. Dezember 2021: 2.633.357)			
800.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030	217.088	0,57
1.398.240	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.500% 09-Jul-2035	357.940	0,93
300.000	YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029	225.962	0,59
Brasilien - 4.042.151			
(31. Dezember 2021: 8.908.041)			
500.000	Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026	305.625	0,80
16.200.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	2.935.508	7,67
3.300.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	560.268	1,47
300.000	Coruipue Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	240.750	0,63
Chile - 442.283			
(31. Dezember 2021: 7.701.352)			
325.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.300% 01-Oct-2028	322.816	0,85
150.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032	119.467	0,31
China - 1.637.363			
(31. Dezember 2021: 5.475.441)			
250.000	Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	226.257	0,59
1.050.000	China Government Bond 3.020% 27-May-2031	152.871	0,40
3.500.000	China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	546.511	1,43
200.000	Lenovo Group Ltd 'REGS' 6.536% 27-Jul-2032	193.684	0,51
450.000	Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	374.891	0,98
200.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.840% 22-Apr-2051	143.149	0,37
Kolumbien - 2.469.570			
(31. Dezember 2021: 7.096.707)			
200.000	Aris Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	157.102	0,41
400.000	Colombia Government International Bond 4.125% 22-Feb-2042	252.466	0,66
650.000	Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045	444.177	1,16
200.000	Colombia Government International Bond 8.000% 20-Apr-2033	200.882	0,53
6.035.100.000	Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028	931.664	2,44
1.634.700.000	Colombian TES 9.250% 28-May-2042	244.395	0,64
1.540.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	238.884	0,62
Elfenbeinküste - 737.398			
(31. Dezember 2021: 2.906.380)			
100.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	84.499	0,22
550.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031	492.506	1,29
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.875% 17-Oct-2040	160.393	0,42
Tschechische Republik - 224.697			
(31. Dezember 2021: 431.381)			
232.000	CEZ AS 'EMTN' 2.375% 06-Apr-2027	224.697	0,59

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Ecuador - 615.190			
(31. Dezember 2021: 1.492.114)			
550.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 5.500% 31-Jul-2030	356.163	0,93
400.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	259.027	0,68
Ghana - 301.120			
(31. Dezember 2021: 3.738.840)			
800.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7.750% 07-Apr-2029	301.120	0,79
Hongkong - 175.049			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	175.049	0,46
Ungarn - 654.226			
(31. Dezember 2021: 623.455)			
170.000.000	Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	307.033	0,80
243.700.000	Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	347.193	0,91
Indien - 191.185			
(31. Dezember 2021: 1.500.000)			
220.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	191.185	0,50
Indonesien - 1.613.089			
(31. Dezember 2021: 3.519.028)			
7.300.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	451.998	1,18
7.200.000.000	Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	516.501	1,35
300.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	266.577	0,70
250.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 15-May-2047	211.381	0,55
200.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS' 4.850% 14-Oct-2038	166.632	0,44
Kasachstan - 298.712			
(31. Dezember 2021: 485.905)			
400.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 3.500% 14-Apr-2033	298.712	0,78
Kenia - 270.940			
(31. Dezember 2021: -)			
350.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034	270.940	0,71
Libanon - 110.781			
(31. Dezember 2021: 188.676)			
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.200% 17-May-2033	24.710	0,06
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034	24.802	0,07
600.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.000% 20-Mar-2028	36.881	0,10
400.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.150% 20-Nov-2031	24.388	0,06
Macao - 459.144			
(31. Dezember 2021: 694.124)			
200.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027	177.188	0,46
300.000	Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	281.956	0,74
Malaysia - 472.235			
(31. Dezember 2021: 1.638.184)			
1.993.000	Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	472.235	1,23
Mexiko - 3.736.948			
(31. Dezember 2021: 10.054.509)			
250.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033	190.201	0,50
20.807.300	Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026	967.179	2,53
22.300.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	1.059.858	2,77
12.000.000	Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	583.253	1,52

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Mexiko Forts.			
200.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031	156.539	0,41
250.000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031	189.763	0,50
850.000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	590.155	1,54
Moldawien - 200.823			
(31. Dezember 2021: 1.440.096)		200.823	0,52
280.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026	200.823	0,52
Marokko - 381.443			
(31. Dezember 2021: -)		381.443	1,00
500.000	OCF SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051	381.443	1,00
Nigeria - 748.086			
(31. Dezember 2021: 2.016.084)		748.086	1,96
250.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051	167.723	0,44
700.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	580.363	1,52
Panama - 755.426			
(31. Dezember 2021: 1.986.469)		755.426	1,97
250.000	Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	186.072	0,49
200.000	Panama Government International Bond 3.875% 17-Mar-2028	188.839	0,49
250.000	Panama Government International Bond 4.500% 19-Jan-2063	177.063	0,46
200.000	Panama Government International Bond 6.400% 14-Feb-2035	203.452	0,53
Peru - 770.443			
(31. Dezember 2021: 3.146.775)		770.443	2,01
200.000	Consorcio Transmantar SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	180.539	0,47
1.100.000	Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	232.009	0,61
239.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	185.153	0,48
200.000	Volcan Cia Minera SAA 'REGS' 4.375% 11-Feb-2026	172.742	0,45
Katar - 438.928			
(31. Dezember 2021: -)		438.928	1,15
450.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 4.817% 14-Mar-2049	438.928	1,15
Republik Korea - 734.406			
(31. Dezember 2021: -)		734.406	1,92
659.550.000	Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	504.590	1,32
250.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	229.816	0,60
Republik Serbien - 301.816			
(31. Dezember 2021: 1.148.368)		301.816	0,79
500.000	Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036	301.816	0,79
Rumänien - 779.088			
(31. Dezember 2021: 3.790.474)		779.088	2,04
1.040.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	779.088	2,04
Russland - 295.051			
(31. Dezember 2021: 9.855.452)		295.051	0,77
68.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026	295.051	0,77
Saudi-Arabien - 510.546			
(31. Dezember 2021: -)		510.546	1,33
250.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	192.844	0,50
300.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	317.702	0,83

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Senegal - 461.811			
(31. Dezember 2021: -)		461.811	1,21
500.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 4.750% 13-Mar-2028	461.811	1,21
Südafrika - 3.532.516			
(31. Dezember 2021: 7.379.219)		3.532.516	9,23
17.300.000	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	907.954	2,37
23.800.000	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	1.181.228	3,09
14.825.032	Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	923.704	2,41
600.000	Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	519.630	1,36
Supranational - 188.854			
(31. Dezember 2021: -)		188.854	0,49
200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027	188.854	0,49
Thailand - 727.504			
(31. Dezember 2021: 1.349.658)		727.504	1,90
200.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	177.357	0,46
12.100.000	Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046	309.731	0,81
300.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 5.375% 20-Nov-2048	240.416	0,63
Türkei - 411.422			
(31. Dezember 2021: 2.993.019)		411.422	1,07
500.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027	411.422	1,07
Ukraine - 511.537			
(31. Dezember 2021: 5.205.081)		511.537	1,34
618.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.253% 15-Mar-2035	116.952	0,30
900.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2034	171.585	0,45
400.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2029	86.500	0,23
700.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026	136.500	0,36
Vereinigte Arabische Emirate - 406.176			
(31. Dezember 2021: -)		406.176	1,06
200.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 'GMTN' 4.500% 14-Sep-2027	197.476	0,52
200.000	Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	208.700	0,54
Gesamtanlagen in Anleihen		31.585.003	82,57
Offene Terminkontrakte - 123.744			
(31. Dezember 2021: 120.229)			
(13)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.849.835)	0,32
33	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	3.561.679	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt		123.744	0,32
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 61.556 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 2.094.578)		61.556	0,16
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		35.507.357	92,82

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (47.614)				
(31. Dezember 2021: (70.322))				
23	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.582.828	(43.078)	(0,11)
7	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	940.188	(4.536)	(0,01)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(47.614)	(0,12)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (844.024) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (388.669))				
			(844.024)	(2,21)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(891.638)	(2,33)
Nettoumlaufvermögen			3.637.361	9,51
Summe Nettovermögen			38.253.080	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	90,02
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,32
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,16
Sonstiges Umlaufvermögen	9,50
Gesamtvermögen	100,00

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

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Chinesischer Yuan	US-Dollar	958.108	138.170	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	1.042
Tschechische Krone	US-Dollar	810.774	35.092	15. Mrz. 23	Toronto Dominion Bank	647
Euro	US-Dollar	399.000	426.122	15. Mrz. 23	UBS AG	3.087
Euro	US-Dollar	225.000	240.586	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	1.450
Indonesische Rupiah	US-Dollar	3.882.507.492	247.878	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	2.711
Koreanischer Won	US-Dollar	542.240.130	416.787	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	14.517
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	3.265.000	740.363	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	8.513
Polnischer Zloty	US-Dollar	5.550.000	1.237.300	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	21.780
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	778.000	45.195	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	315
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	2.900.000	165.971	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	3.667
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	647.734	3.179.337.272	15. Mrz. 23	Goldman Sachs	872

USD 58.601

Brasilianischer Real	US-Dollar	820.000	155.892	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(2.245)
US-Dollar	Brasilianischer Real	336.380	1.840.000	1. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(8.388)
US-Dollar	Brasilianischer Real	2.131.654	11.693.612	1. Mrz. 23	Morgan Stanley	(59.426)
Thailändischer Baht	US-Dollar	64.377.504	1.874.458	15. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	(2.724)
US-Dollar	Chilenischer Peso	52.831	46.090.000	15. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(1.000)
US-Dollar	Euro	3.396.450	3.180.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(24.318)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.682.844	33.834.000	15. Mrz. 23	Toronto Dominion Bank	(30.874)
US-Dollar	Peruanischer neuer Sol	210.952	814.380	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(2.089)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.480.912	26.133.000	15. Mrz. 23	Morgan Stanley	(47.758)
US-Dollar	Ungarischer Forint	282.037	114.412.000	16. Mrz. 23	Morgan Stanley	(18.438)

USD (197.260)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	61	65	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	62	66	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	11.018	11.657	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	146
US-Dollar	Euro	78	74	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
USD						146
EUR						136
US-Dollar	Euro	80	75	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(1)
EUR						(1)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	31	33	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	32	34	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	5.620	5.946	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	75
US-Dollar	Euro	40	37	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Euro	40	38	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
USD						75
EUR						70

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	183.297	220.832	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	829
----------------	-----------	---------	---------	-------------	-----------------------------	-----

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	61.756	49.645	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.720
US-Dollar	Pfund Sterling	244.368	201.927	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	178
USD						2.727
GBP						2.256
Pfund Sterling	US-Dollar	177.215	220.369	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.063)
Pfund Sterling	US-Dollar	31.496.063	38.723.329	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(635.180)
US-Dollar	Pfund Sterling	241.395	200.549	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.128)
USD						(642.371)
GBP						(531.346)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	5	6	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	1.247	1.502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Pfund Sterling	1.669	1.379	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
USD						7
GBP						6
Pfund Sterling	US-Dollar	3.000	3.712	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(84)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.185	1.473	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(41)
Pfund Sterling	US-Dollar	211.090	259.527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.257)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.646	1.367	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Pfund Sterling	346	287	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
USD						(4.392)
GBP						(3.633)

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %		
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.					
Irland - 2.165.146				Frankreich Forts.					
(31. Dezember 2021: 2.426.564)				300.000 Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049				181.641	0,10
2.928.215	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund ^	2.165.146	1,23	400.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	395.024	0,22		
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 2.165.146 1,23				1.300.000	Engie SA 'EMTN' 1.750% 27-Mar-2028	1.176.260	0,67		
Anleihen				4.650.000	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Feb-2027	4.148.835	2,35		
Österreich - 7.134.954				4.500.000	French Republic Government Bond OAT 0.500% 25-May-2025	4.263.365	2,41		
(31. Dezember 2021: 9.753.280)				1.900.000	French Republic Government Bond OAT 0.500% 25-May-2029	1.638.460	0,93		
700.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	686.983	0,39	2.780.000	French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Feb-2028	2.501.222	1,42		
700.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	695.495	0,39	110.494	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.500% 25-May-2040	69.527	0,04		
1.080.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Feb-2031	842.007	0,48	210.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.500% 25-May-2072	79.135	0,04		
350.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Oct-2040	197.564	0,11	929.666	French Republic Government Bond OAT '144A' 2.500% 25-May-2043	806.950	0,46		
400.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.250% 20-Oct-2036	269.994	0,15	800.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1.250% 13-Jun-2028	701.969	0,40		
750.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.500% 20-Apr-2027	679.301	0,39	200.000	Orano SA 'EMTN' 4.875% 23-Sep-2024	204.737	0,12		
600.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.500% 20-Feb-2029	516.856	0,29	500.000	Orano SA 'EMTN' 5.375% 15-May-2027	507.360	0,29		
400.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.700% 20-Apr-2071	175.666	0,10	900.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1.375% 13-Jan-2028	777.615	0,44		
295.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.750% 20-Mar-2051	166.710	0,09	1.400.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 1.125% 30-Jun-2031	1.198.217	0,68		
3.530.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.900% 20-Feb-2032	2.904.378	1,65	1.100.000	Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027	946.342	0,54		
Belgien - 5.725.970				1.100.000	Societe Generale SFH SA 1.375% 05-May-2028	995.733	0,56		
(31. Dezember 2021: 26.211.157)				700.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	593.023	0,34		
1.200.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.000% 22-Oct-2031	915.150	0,52	Deutschland - 32.317.149					
1.500.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.400% 22-Jun-2040	908.531	0,51	(31. Dezember 2021: 24.310.467)					
250.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.650% 22-Jun-2071	105.678	0,06	300.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	242.912	0,14		
2.850.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.000% 22-Jun-2026	2.690.703	1,52	2.000.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Feb-2032	1.591.660	0,90		
1.100.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.250% 22-Apr-2033	920.444	0,52	500.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2036	352.615	0,20		
265.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.700% 22-Jun-2050	185.464	0,11	2.180.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2052	1.068.898	0,61		
Kanada - 1.545.202				3.400.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15-Feb-2027	3.103.418	1,76		
(31. Dezember 2021: -)				2.430.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15-Feb-2029	2.124.962	1,20		
2.000.000	Province of Quebec Canada 'EMTN' 0.250% 05-May-2031	1.545.202	0,88	420.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.250% 15-Aug-2048	321.938	0,18		
Frankreich - 34.441.154				1.070.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.700% 15-Aug-2032	992.468	0,56		
(31. Dezember 2021: 41.575.704)				1.600.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 4.000% 24-Jun-2032	1.417.603	0,80		
300.000	Aeroports de Paris 1.500% 02-Jul-2032	236.830	0,13	300.000	Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032	218.800	0,12		
1.400.000	Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040	1.057.358	0,60	400.000	Deutsche Bank AG FRN 3.250% 24-May-2028	369.476	0,21		
700.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	700.985	0,40	477.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	401.121	0,23		
700.000	Arkea Home Loans SFH SA 0.125% 12-Jul-2029	571.627	0,32	2.479.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 1.250% 04-May-2029	2.223.846	1,26		
1.100.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 3.375% 04-Jan-2026	1.076.661	0,61	768.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 07-Jun-2032	659.252	0,37		
800.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	795.696	0,45	1.974.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.000% 15-Nov-2029	1.846.344	1,05		
1.000.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.500% 31-Mar-2032	885.374	0,50	4.600.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.000% 15-Jun-2029	3.785.414	2,14		
1.000.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	928.413	0,53	1.870.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.375% 23-Apr-2030	1.542.694	0,87		
700.000	BPCE SFH SA 1.750% 27-May-2032	607.781	0,34	4.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 2.500% 19-Nov-2025	4.451.287	2,52		
1.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.000% 25-Nov-2030	1.081.577	0,61	1.111.000	Land Berlin 0.625% 20-Mar-2026	1.028.707	0,58		
900.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 2.750% 12-Apr-2028	876.726	0,50	2.214.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 'EMTN' 2.000% 15-Jun-2032	2.012.554	1,14		
800.000	Cie de Financement Foncier SA 'EMTN' 0.600% 25-Oct-2041	497.260	0,28	400.000	Volkswagen International Finance NV 1.875% 30-Mar-2027	360.167	0,20		
700.000	Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 1.750% 03-Apr-2023	698.499	0,39	600.000	Volkswagen International Finance NV 3.750% 28-Sep-2027	578.320	0,33		
2.800.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 'EMTN' 0.875% 31-Aug-2027	2.503.062	1,42	1.140.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.625% 19-Jul-2029	877.632	0,50		
600.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.750% 05-Mar-2029	522.046	0,29	300.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	293.752	0,17		
300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1.875% 13-Oct-2036	215.844	0,12	500.000	Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025	451.309	0,26		

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Irland - 7.110.336				
(31. Dezember 2021: 11.809.854)		7.110.336	4,03	
1.503.000	AIB Group Plc FRN 3.625% 04-Jul-2026	1.459.302	0,83	
1.100.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	927.891	0,53	
198.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6.750% 01-Mar-2033	197.301	0,11	
4.075.000	Ireland Government Bond 0.200% 18-Oct-2030	3.305.233	1,87	
400.000	Ireland Government Bond 0.400% 15-May-2035	285.468	0,16	
300.000	Ireland Government Bond 1.500% 15-May-2050	206.121	0,12	
755.000	Ireland Government Bond 2.400% 15-May-2030	729.020	0,41	
Italien - 15.313.978				
(31. Dezember 2021: 35.165.976)		15.313.978	8,67	
1.508.000	Banco BPM SpA 'EMTN' 0.750% 15-Mar-2027	1.345.454	0,76	
293.000	Coca-Cola HBC Finance BV 'EMTN' 2.750% 23-Sep-2025	285.017	0,16	
1.225.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 17-Jun-2027	1.057.390	0,60	
2.204.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Apr-2026	1.958.158	1,11	
5.687.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.500% 15-Jul-2028	4.695.412	2,66	
1.520.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	1.131.136	0,64	
163.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Mar-2037	101.072	0,06	
1.430.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.150% 01-Sep-2052	855.390	0,48	
800.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	527.139	0,30	
250.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067	167.720	0,09	
1.598.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.250% 01-Mar-2038	1.331.623	0,75	
795.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.000% 30-Apr-2035	736.196	0,42	
112.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.000% 01-Feb-2037	104.331	0,06	
1.019.000	Leasys SpA 4.375% 07-Dec-2024	1.017.940	0,58	
Luxemburg - 760.859				
(31. Dezember 2021: 1.399.391)		760.859	0,43	
900.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	760.859	0,43	
Mexiko - 5.150.319				
(31. Dezember 2021: 7.714.238)		5.150.319	2,92	
116.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	5.150.319	2,92	
Niederlande - 7.845.650				
(31. Dezember 2021: 19.608.049)		7.845.650	4,44	
337.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	335.532	0,19	
683.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	643.024	0,36	
600.000	ING Groep NV FRN 2.000% 22-Mar-2030	556.106	0,31	
500.000	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	523.340	0,30	
632.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 2.125% 06-May-2025	601.453	0,34	
530.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.000% 15-Jul-2031	417.317	0,24	
730.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.000% 15-Jan-2052	348.998	0,20	
1.000.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.500% 15-Jul-2032	804.030	0,45	
660.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.500% 15-Jan-2040	451.170	0,26	
2.425.000	Netherlands Government Bond '144A' 0.750% 15-Jul-2027	2.226.635	1,26	
420.000	Netherlands Government Bond '144A' 4.000% 15-Jan-2037	469.842	0,27	
578.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	468.203	0,26	
Rumänien - 782.929				
(31. Dezember 2021: 1.022.439)		782.929	0,44	
475.000	Romanian Government International Bond 'EMTN' 2.875% 11-Mar-2029	392.516	0,22	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Rumänien Forts.				
475.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	390.413	0,22	
Südafrika - 366.851				
(31. Dezember 2021: -)		366.851	0,21	
375.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 4.750% 21-Sep-2032	366.851	0,21	
Spanien - 18.516.958				
(31. Dezember 2021: 14.827.911)		18.516.958	10,49	
600.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	564.301	0,32	
500.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	501.370	0,29	
600.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	588.894	0,33	
1.200.000	Spain Government Bond 0.000% 31-Jan-2025	1.130.268	0,64	
1.500.000	Spain Government Bond 0.000% 31-May-2025	1.396.410	0,79	
3.000.000	Spain Government Bond 0.000% 31-Jan-2027	2.647.995	1,50	
5.300.000	Spain Government Bond '144A' 0.700% 30-Apr-2032	4.113.551	2,33	
300.000	Spain Government Bond '144A' 1.000% 31-Oct-2050	156.073	0,09	
2.800.000	Spain Government Bond '144A' 1.400% 30-Jul-2028	2.548.868	1,44	
2.160.000	Spain Government Bond '144A' 1.850% 30-Jul-2035	1.754.309	0,99	
380.000	Spain Government Bond '144A' 2.900% 31-Oct-2046	325.242	0,19	
1.660.000	Spain Government Bond '144A' 3.450% 30-Jul-2043	1.542.009	0,87	
285.000	Spain Government Bond '144A' 3.450% 30-Jul-2066	253.698	0,15	
1.000.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	993.970	0,56	
Supranational - 11.804.208				
(31. Dezember 2021: 2.778.557)		11.804.208	6,69	
211.000	African Export-Import Bank/The 'EMTN' 5.250% 11-Oct-2023	196.519	0,11	
2.600.000	European Financial Stability Facility 0.875% 05-Sep-2028	2.302.868	1,30	
620.000	European Investment Bank 0.375% 15-Sep-2027	550.999	0,31	
2.500.000	European Investment Bank 1.500% 15-Jun-2032	2.164.913	1,23	
2.060.241	European Stability Mechanism 1.000% 23-Jun-2027	1.886.208	1,07	
750.000	European Union 0.000% 04-Jul-2035	503.074	0,28	
1.368.736	European Union 0.700% 06-Jul-2051	737.093	0,42	
1.080.000	European Union 1.000% 06-Jul-2032	892.881	0,51	
700.000	European Union 1.250% 04-Feb-2043	488.349	0,28	
1.625.000	European Union 1.625% 04-Dec-2029	1.476.467	0,84	
675.000	European Union 2.625% 04-Feb-2048	604.837	0,34	
Schweiz - 3.054.021				
(31. Dezember 2021: 688.720)		3.054.021	1,73	
1.172.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	877.410	0,50	
1.229.000	Credit Suisse Group AG FRN 2.125% 13-Oct-2026	1.047.697	0,59	
770.000	Credit Suisse Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	556.588	0,32	
700.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 05-Nov-2028	572.326	0,32	
Vereinigtes Königreich - 5.128.681				
(31. Dezember 2021: 6.405.974)		5.128.681	2,90	
685.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 2.000% 07-Feb-2028	680.191	0,38	
900.000	Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029	712.097	0,40	
289.993	Brass No 10 Plc FRN 0.669% 16-Apr-2069	258.724	0,15	
425.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	331.475	0,19	
1.055.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	828.767	0,47	
1.035.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.500% 11-Feb-2030	844.280	0,48	
520.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 1.500% 04-Dec-2024	511.152	0,29	
459.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.530% 20-Sep-2028	447.188	0,25	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
588.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 2.250% 16-May-2034	514.807	0,29
Vereinigte Staaten von Amerika - 9.008.586			
(31. Dezember 2021: 30.849.394)			
415.000	AT&T Inc 1.800 % 14-Sep-2039	287.578	0,16
891.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	778.878	0,44
545.000	CGDB Commercial Mortgage Trust 2019-MOB '2019-MOBX A' FRN 5.268% 15-Nov-2036	497.451	0,28
200.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	174.831	0,10
345.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	175.509	0,10
650.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	583.086	0,33
600.000	General Motors Financial Co Inc 0.600% 20-May-2027	508.326	0,29
455.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026	417.811	0,24
760.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.875% 09-May-2029	609.668	0,35
750.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	652.031	0,37
530.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 0.637% 26-Jul-2024	521.168	0,29
425.000	Occidental Petroleum Corp 8.875 % 15-Jul-2030	448.915	0,25
350.000	SLM Corp 4.200 % 29-Oct-2025	299.721	0,17
182.813	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '1444A' 4.738% 20-Mar-2025	168.916	0,10
265.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 2.000% 18-Oct-2051	164.575	0,09
1.020.000	Upjohn Finance BV 1.362% 23-Jun-2027	889.158	0,50
300.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	251.817	0,14
536.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 3.500% 15-Feb-2025	472.914	0,27
1.170.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026	1.106.233	0,63
Gesamtanlagen in Anleihen		166.007.805	94,01

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 766.719				
(31. Dezember 2021: -)				
(163)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(18.867.250)	394.839	0,22
(37)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(4.030.040)	115.679	0,07
(86)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.021.931)	50.788	0,03
6	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.149.487	1.373	0,00
(142)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(14.317.349)	197.621	0,11
(7)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(819.661)	6.419	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			766.719	0,43
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 857.087 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 411.469)				
			857.087	0,49
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			169.796.757	96,16

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps - (42.467)			
(31. Dezember 2021: -)			
9.195.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(39.462)	(0,02)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps Forts.			
9.080.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(3.005)	(0,00)
Credit Default Swaps insgesamt		(42.467)	(0,02)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (940.665)				
(31. Dezember 2021: (261.581))				
39	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Mar-2023	4.099.290	(67.891)	(0,04)
7	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	946.680	(99.013)	(0,05)
108	Euro-OAT Long Futures Contracts Exp Mar-2023	13.748.400	(577.770)	(0,33)
119	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2023	12.544.980	(157.785)	(0,09)
43	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	4.751.358	(31.583)	(0,02)
6	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	752.837	(6.623)	(0,00)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(940.665)	(0,53)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (86.989) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (267.752))				
			(86.989)	(0,05)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.070.121)	(0,60)
Nettoumlaufvermögen			7.856.853	4,44
Summe Nettovermögen			176.583.489	100,00

^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist J.P Morgan Securities Plc.
Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Goldman Sachs und JPMorgan.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	94,33
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,43
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,48
Sonstiges Umlaufvermögen	4,76
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Euroland Bond Fund							
Euro	US-Dollar	99.578	106.000	6. Jan. 23	Barclays Bank PLC	576	
Tschechische Krone	Euro	21.500.000	887.276	10. Jan. 23	Goldman Sachs	627	
Euro	Mexikanischer Peso	5.376.767	106.200.000	10. Jan. 23	Goldman Sachs	295.307	
Euro	Pfund Sterling	1.359.443	1.189.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	17.017	
Euro	Schweizer Franken	1.360.169	1.340.000	10. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	5.923	
Euro	US-Dollar	281.098	300.000	12. Jan. 23	HSBC Bank plc	1.025	
Euro	US-Dollar	393.797	390.000	12. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	29.703	
Euro	Pfund Sterling	680.000	599.873	20. Jan. 23	Morgan Stanley	3.018	
Euro	Pfund Sterling	281.505	246.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	3.883	
Euro	Pfund Sterling	990.158	866.000	20. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	12.840	
Pfund Sterling	Euro	830.000	936.315	20. Jan. 23	HSBC Bank plc	375	
Euro	US-Dollar	7.349.037	7.363.000	25. Jan. 23	HSBC Bank plc	481.608	
Euro	US-Dollar	116.623	121.000	8. Feb. 23	HSBC Bank plc	3.877	
						EUR	855.779
Pfund Sterling	Euro	1.189.000	1.346.775	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(4.350)	
Schweizer Franken	Euro	1.340.000	1.361.522	10. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(7.276)	
Schweizer Franken	Euro	102.000	103.393	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(309)	
US-Dollar	Euro	2.500.000	2.348.951	12. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(15.011)	
Pfund Sterling	Euro	790.000	904.895	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(13.347)	
US-Dollar	Euro	222.000	209.864	25. Jan. 23	Morgan Stanley	(2.806)	
						EUR	(43.099)
BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Hedged)							
Euro	Schweizer Franken	7.649	7.516	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	53	
Euro	Schweizer Franken	6.582	6.485	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27	
Euro	Schweizer Franken	9.391	9.226	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	65	
Euro	Schweizer Franken	8.324	8.220	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15	
Euro	Schweizer Franken	12.844	12.696	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11	
Euro	Schweizer Franken	7.194	7.083	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34	
						EUR	205
						CHF	203
Schweizer Franken	Euro	1.213.826	1.234.429	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.533)	
						EUR	(7.533)
						CHF	(7.456)
BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Hedged)							
Euro	Schweizer Franken	19.038	18.716	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	120	
Euro	Schweizer Franken	34.647	34.115	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	165	
Euro	Schweizer Franken	36.418	35.781	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	252	
Euro	Schweizer Franken	31.433	30.972	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	127	
Euro	Schweizer Franken	44.866	44.079	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	312	
Euro	Schweizer Franken	39.966	39.468	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	73	
Euro	Schweizer Franken	61.311	60.604	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	54	
						EUR	1.103
						CHF	1.092

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Hedged) Forts.

Schweizer Franken	Euro	5.858.309	5.957.745	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36.357)	
						EUR	(36.357)
						CHF	(35.986)

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Irland - 1.215.130				
(31. Dezember 2021: 1.473.494)		1.215.130	2,77	
2.562	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund ^	392.094	0,89	
708.127	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund ^	823.036	1,88	
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		1.215.130	2,77	
Anleihen				
Australien - 394.345				
(31. Dezember 2021: 401.020)		394.345	0,90	
100.000	Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.125% 10-Mar-2028	82.402	0,19	
200.000	Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.250% 01-Mar-2033	137.109	0,31	
200.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028	174.834	0,40	
Österreich - 561.859				
(31. Dezember 2021: 201.127)		561.859	1,28	
100.000	JAB Holdings BV 2.250% 19-Dec-2039	68.290	0,16	
300.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4,125% 08-Sep-2025	294.569	0,67	
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7,375% 20-Dec-2032	199.000	0,45	
Belgien - 728.355				
(31. Dezember 2021: -)		728.355	1,66	
200.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2030	173.339	0,39	
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.000% 23-Jan-2035	81.361	0,19	
300.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2,125% 02-Dec-2027	281.385	0,64	
209.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3,700% 02-Apr-2040	192.270	0,44	
Zypern - 147.132				
(31. Dezember 2021: 175.999)		147.132	0,34	
170.000	Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6,625% 23-Oct-2031	147.132	0,34	
Frankreich - 9.229.298				
(31. Dezember 2021: 5.466.921)		9.229.298	21,04	
100.000	Aeroports de Paris 1.000% 05-Jan-2029	84.711	0,19	
200.000	Aeroports de Paris 1.500% 02-Jul-2032	158.206	0,36	
300.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375% 09-Jun-2040	227.548	0,52	
100.000	ALD SA 'EMTN' 4,000% 05-Jul-2027	100.342	0,23	
200.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 0,875% 17-Feb-2025	188.435	0,43	
300.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4,000% 22-Sep-2026	299.179	0,68	
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,250% 19-Jul-2028	80.539	0,18	
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0,100% 08-Oct-2027	84.769	0,19	
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3,750% 01-Feb-2033	381.712	0,87	
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3,875% 16-Jun-2032	93.986	0,21	
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,250% 13-Apr-2027	174.763	0,40	
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2,500% 31-Mar-2032	177.414	0,40	
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2,750% 25-Jul-2028	278.553	0,64	
200.000	Bouygues SA 5,375% 30-Jun-2042	205.662	0,47	
200.000	BPCE SA 0,250% 15-Jan-2026	180.896	0,41	
300.000	BPCE SA 0,625% 28-Apr-2025	280.354	0,64	
200.000	BPCE SA 'EMTN' 0,375% 02-Feb-2026	180.819	0,41	
200.000	BPCE SA 'EMTN' 4,000% 29-Nov-2032	195.002	0,44	
400.000	BPCE SA FRN 1,500% 13-Jan-2042	335.628	0,77	
100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0,375% 20-Apr-2028	82.230	0,19	
300.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 3,875% 28-Nov-2034	288.154	0,66	
600.000	Credit Agricole SA FRN 0,625% 12-Jan-2028	520.110	1,19	
100.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,875% 20-Dec-2026	92.309	0,21	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Frankreich Forts.				
200.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 3,375% 19-Sep-2027	194.491	0,44	
200.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1,000% 29-Nov-2033	139.357	0,32	
300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4,750% 12-Oct-2034	297.495	0,68	
200.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0,750% 02-Aug-2032	160.561	0,37	
100.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0,875% 26-Jan-2031	86.870	0,20	
200.000	La Banque Postale SA FRN 5,500% 05-Mar-2034	196.750	0,45	
200.000	MMS USA Holdings Inc 0,625% 13-Jun-2025	185.118	0,42	
100.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1,250% 13-Jun-2028	87.825	0,20	
300.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1,750% 13-Jun-2031	249.466	0,57	
100.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2,125% 21-Jun-2052	68.048	0,16	
100.000	Orange SA 1,200% 11-Jul-2034	74.159	0,17	
200.000	Orano SA 'EMTN' 5,375% 15-May-2027	202.840	0,46	
100.000	Pernod Ricard SA 'EMTN' 3,750% 02-Nov-2032	99.171	0,23	
200.000	RCI Banque SA 'EMTN' 2,000% 11-Jul-2024	194.567	0,44	
200.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 0,000% 09-Sep-2027	168.364	0,38	
300.000	Sanofi 1,250% 06-Apr-2029	267.105	0,61	
100.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1,375% 13-Jan-2028	86.350	0,20	
200.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 4,250% 06-Dec-2030	192.158	0,44	
200.000	Suez SACA 'EMTN' 2,875% 24-May-2034	168.816	0,38	
200.000	Suez SACA 'EMTN' 5,000% 03-Nov-2032	205.133	0,47	
100.000	TDF Infrastructure SASU 2,500% 07-Apr-2026	91.530	0,21	
200.000	Thales SA 'EMTN' 0,000% 26-Mar-2026	177.525	0,40	
262.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2,000% 04-Sep-2171	199.594	0,46	
300.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0,625% 04-May-2027	255.013	0,58	
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0,750% 25-Oct-2028	80.026	0,18	
100.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2,250% 20-Jan-2026	89.417	0,20	
400.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2,500% 20-Jan-2029	320.228	0,73	
Deutschland - 4.222.400				
(31. Dezember 2021: 3.992.547)		4.222.400	9,62	
300.000	Allianz SE FRN 2,241% 07-Jul-2045	280.581	0,64	
100.000	BASF SE 'EMTN' 3,750% 29-Jun-2032	99.050	0,22	
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1,875% 23-Feb-2028	87.705	0,20	
200.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 4,000% 24-Jun-2032	177.570	0,40	
400.000	Deutsche Bank AG FRN 1,375% 17-Feb-2032	292.412	0,67	
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 1,875% 29-Jun-2080	86.231	0,20	
67.000	EnBW International Finance BV 'EMTN' 4,049% 22-Nov-2029	66.737	0,15	
228.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875% 31-Mar-2032	195.738	0,45	
200.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 'EMTN' 1,625% 07-Apr-2026	188.061	0,43	
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1,625% 24-Jun-2029	87.141	0,20	
200.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0,375% 17-Jan-2026	175.399	0,40	
100.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0,750% 30-Jun-2031	70.600	0,16	
100.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 1,500% 17-Jan-2034	67.007	0,15	
292.000	Roadster Finance DAC 'EMTN' 1,625% 09-Dec-2024	260.140	0,59	
200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 1,000% 25-Feb-2030	170.383	0,39	
300.000	Vantage Towers AG 'EMTN' 0,000% 31-Mar-2025	287.178	0,65	
100.000	Vier Gas Transport GmbH 'EMTN' 4,625% 26-Sep-2032	100.910	0,23	
248.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0,125% 12-Feb-2027	207.566	0,47	
340.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0,250% 31-Jan-2025	315.285	0,72	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Deutschland Forts.				Luxemburg Forts.			
100.000	Volkswagen International Finance NV 3.750% 28-Sep-2027	96.314	0,22	145.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	94.460	0,22
100.000	Volkswagen International Finance NV 4.125% 16-Nov-2038	91.378	0,21	168.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	141.521	0,32
100.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 4.125% 15-Nov-2025	99.684	0,23	101.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 3.250% 13-Nov-2028	84.564	0,19
200.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN' 4.375% 15-May-2030	194.997	0,44	200.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	147.253	0,34
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	75.218	0,17	150.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1.625% 17-Jun-2032	113.965	0,26
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.750% 22-Mar-2038	73.022	0,17	105.000	SELP Finance Sarl 'EMTN' 3.750% 10-Aug-2027	97.512	0,22
100.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	56.213	0,13	Niederlande - 2.301.471			
100.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	98.069	0,22	(31. Dezember 2021: 1.766.238)			
200.000	Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028	147.364	0,34	300.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	298.350	0,68
100.000	Wintershall Dea Finance BV 1.823% 25-Sep-2031	74.447	0,17	180.000	ASR Nederland NV FRN 5.125% 29-Sep-2045	179.451	0,41
Hongkong - 77.668				152.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	153.347	0,35
(31. Dezember 2021: 100.856)				135.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	114.683	0,26
100.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	77.668	0,18	100.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032	75.708	0,17
Irland - 1.904.366				400.000	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	418.672	0,96
(31. Dezember 2021: 1.669.132)				359.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	300.916	0,69
200.000	AIB Group Plc 'EMTN' 1.250% 28-May-2024	192.854	0,44	346.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	301.025	0,69
239.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.250% 04-Apr-2028	213.207	0,49	145.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	118.149	0,27
450.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	386.386	0,88	100.000	VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028	75.878	0,17
100.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	84.193	0,19	163.000	Viterra Finance BV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2025	144.950	0,33
111.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6.750% 01-Mar-2033	110.608	0,25	150.000	Viterra Finance BV 'EMTN' 1.000% 24-Sep-2028	120.342	0,27
238.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	206.783	0,47	Polen - 83.259			
400.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	383.116	0,87	(31. Dezember 2021: 98.352)			
210.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	171.210	0,39	100.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	83.259	0,19
200.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029	156.009	0,36	Portugal - 261.893			
Italien - 2.001.830				(31. Dezember 2021: 214.956)			
(31. Dezember 2021: 1.611.111)				200.000	Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031	163.082	0,37
150.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.000% 15-Jan-2030	119.184	0,27	100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 3.875% 11-Mar-2030	98.811	0,23
128.000	Autostrade per l'Italia SpA 'EMTN' 1.625% 25-Jan-2028	106.762	0,24	Slowakei - 90.689			
104.000	Coca-Cola HBC Finance BV 'EMTN' 2.750% 23-Sep-2025	101.348	0,23	(31. Dezember 2021: 119.214)			
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.875% 28-Sep-2034	67.299	0,15	113.000	Zapadoslovenska Energetika AS 1.750% 02-Mar-2028	90.689	0,21
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 1.125% 17-Oct-2034	70.293	0,16	Südafrika - 287.434			
198.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 3.875% 09-Mar-2029	195.936	0,45	(31. Dezember 2021: 353.435)			
100.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.375% 08-Jun-2027	79.209	0,18	150.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026	139.664	0,32
100.000	Eni SpA 'EMTN' 3.625% 29-Jan-2029	99.021	0,23	150.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 4.750% 21-Sep-2032	147.770	0,34
229.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	190.675	0,43	Spanien - 3.454.324			
162.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	134.693	0,31	(31. Dezember 2021: 2.910.545)			
283.000	Leasys SpA 4.375% 07-Dec-2024	283.225	0,65	200.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	168.410	0,38
200.000	Societa Cattolica Di Assicurazione SPA FRN 4.250% 14-Dec-2047	192.750	0,44	300.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	296.868	0,68
120.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.925% 18-Jan-2028	102.748	0,23	100.000	Abertis Infraestructuras SA 'EMTN' 3.000% 27-Mar-2031	87.074	0,20
260.000	UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024	258.687	0,59	300.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.125% 27-Mar-2025	274.587	0,63
Japan - 1.070.814				200.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	161.505	0,37
(31. Dezember 2021: 517.799)				100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	100.500	0,23
200.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.541% 23-Oct-2028	164.183	0,37	100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 05-Jan-2026	92.827	0,21
500.000	Asahi Group Holdings Ltd 1.151% 19-Sep-2025	464.975	1,06	500.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	466.303	1,06
142.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032	112.483	0,26	700.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	687.393	1,57
350.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	329.173	0,75	119.000	FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027	108.692	0,25
Luxemburg - 974.046				200.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025	184.372	0,42
(31. Dezember 2021: 841.784)				200.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	171.944	0,39
306.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2023	294.771	0,67	200.000	Merlin Properties Socimi SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	154.199	0,35
				200.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	199.050	0,45

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Spanien Forts.				
300.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 7.250% 15-Nov-2027	300.600	0,68	
Schweden - 177.618				
(31. Dezember 2021: 603.520)		177.618	0,40	
192.000	Akelius Residential Property AB 'EMTN' 1.750% 07-Feb-2025	177.618	0,40	
Schweiz - 1.437.674				
(31. Dezember 2021: 1.587.650)		1.437.674	3,28	
260.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	194.409	0,44	
565.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026	508.207	1,16	
300.000	Holcim Finance Luxembourg SA 1.500% 06-Apr-2025	284.703	0,65	
300.000	Holcim Finance Luxembourg SA FRN (Perpetual) 3.000% 05-Jul-2171	289.830	0,66	
100.000	Richemont International Holding SA 1.125% 26-May-2032	81.384	0,19	
100.000	Richemont International Holding SA 2.000% 26-Mar-2038	79.141	0,18	
Vereinigte Arabische Emirate - 94.004				
(31. Dezember 2021: 106.215)		94.004	0,21	
100.000	DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 2.375% 25-Sep-2026	94.004	0,21	
Vereinigtes Königreich - 4.798.976				
(31. Dezember 2021: 6.344.247)		4.798.976	10,94	
270.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.375% 04-Dec-2045	254.391	0,58	
100.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 0.750% 09-Jun-2025	95.015	0,22	
186.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 5.262% 29-Jan-2034	184.492	0,42	
150.000	Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032	110.465	0,25	
100.000	BP Capital Markets BV 1.467% 21-Sep-2041	62.982	0,14	
240.000	BP Capital Markets BV 'EMTN' 0.933% 04-Dec-2040	142.540	0,32	
100.000	BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032	91.009	0,21	
125.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	96.980	0,22	
100.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.125% 12-Sep-2029	83.336	0,19	
115.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.500% 23-Jun-2027	103.206	0,24	
100.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.500% 08-Nov-2027	90.821	0,21	
216.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	168.842	0,38	
348.000	Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025	323.946	0,74	
100.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 14-Mar-2034	72.567	0,17	
220.000	HSBC Holdings Plc FRN 3.019% 15-Jun-2027	210.070	0,48	
150.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027	135.214	0,31	
340.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027	312.691	0,71	
380.000	Lseg Netherlands BV 'GMTN' 0.250% 06-Apr-2028	320.076	0,73	
100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	98.400	0,22	
250.000	National Grid Plc 'EMTN' 3.245% 30-Mar-2034	223.071	0,51	
185.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 2.750% 02-Apr-2025	180.326	0,41	
300.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031	249.012	0,57	
130.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	100.407	0,23	
100.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.875% 29-May-2026	90.563	0,21	
157.000	Unilever Finance Netherlands BV 'EMTN' 2.250% 16-May-2034	137.242	0,31	
345.000	Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025	330.789	0,75	
350.000	Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079	343.490	0,78	
206.000	Yorkshire Building Society 0.625% 21-Sep-2025	187.033	0,43	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika - 6.803.488				
(31. Dezember 2021: 8.486.174)		6.803.488	15,51	
190.000	American Tower Corp 1.375% 04-Apr-2025	179.203	0,41	
100.000	AT&T Inc 1.800 % 14-Sep-2039	69.816	0,16	
230.000	AT&T Inc 3.550 % 17-Dec-2032	218.074	0,50	
253.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	222.174	0,51	
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	82.348	0,19	
100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026	91.696	0,21	
290.000	Celanese US Holdings LLC 1.250% 11-Feb-2025	265.038	0,60	
256.000	Celanese US Holdings LLC 5.337% 19-Jan-2029	242.026	0,55	
100.000	Chubb INA Holdings Inc 2.500% 15-Mar-2038	77.911	0,18	
150.000	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	145.408	0,33	
100.000	Digital Dutch Finco BV 1.000% 15-Jan-2032	70.237	0,16	
140.000	Dow Chemical Co/The 0.500% 15-Mar-2027	121.935	0,28	
100.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031	97.059	0,22	
120.000	Eaton Capital UnLtd Co 0.577% 08-Mar-2030	96.815	0,22	
100.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	52.378	0,12	
100.000	FedEx Corp 0.450% 04-May-2029	79.177	0,18	
123.000	Fidelity National Information Services Inc 0.625% 03-Dec-2025	112.012	0,26	
100.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	89.849	0,20	
100.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.386% 17-Feb-2026	91.127	0,21	
126.000	General Electric Co 'EMTN' 4.125% 19-Sep-2035	125.318	0,29	
330.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN' 1.694% 26-Mar-2025	312.531	0,71	
211.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	172.791	0,39	
152.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 'EMTN' 2.125% 29-Mar-2034	124.534	0,28	
100.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.000% 15-Sep-2028	94.994	0,22	
162.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	141.798	0,32	
300.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.000% 15-Oct-2025	272.496	0,62	
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 2.250% 07-Mar-2039	77.484	0,18	
110.000	Medtronic Global Holdings SCA 3.375% 15-Oct-2034	103.251	0,24	
400.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 1.342% 23-Oct-2026	369.895	0,84	
129.000	Morgan Stanley FRN 2.950% 07-May-2032	114.936	0,26	
190.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 5.148% 25-Jan-2034	198.381	0,45	
110.000	Nasdaq Inc 0.900% 30-Jul-2033	78.318	0,18	
300.000	Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030	275.229	0,63	
100.000	Philip Morris International Inc 1.875% 06-Nov-2037	63.385	0,14	
200.000	Stellantis NV 'EMTN' 0.625% 30-Mar-2027	172.693	0,39	
200.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041	134.405	0,31	
100.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 2.000% 18-Oct-2051	63.204	0,14	
135.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032	120.799	0,28	
270.000	Upjohn Finance BV 1.908% 23-Jun-2032	207.078	0,47	
400.000	Utah Acquisition Sub Inc 2.250% 22-Nov-2024	386.426	0,88	
100.000	Verizon Communications Inc 1.125% 19-Sep-2035	70.089	0,16	
520.000	Verizon Communications Inc 4.750% 31-Oct-2034	536.687	1,22	
225.000	Westlake Corp 1.625% 17-Jul-2029	182.483	0,42	
Gesamtanlagen in Anleihen		41.102.943	93,70	
Credit Default Swaps - 36.589				
(31. Dezember 2021: -)				
115.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	8.527	0,02	
130.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	9.639	0,02	
2.700.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	230	0,00	
100.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	7.426	0,02	
145.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	10.767	0,02	
Credit Default Swaps insgesamt		36.589	0,08	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Swaptions - 20.085			
(31. Dezember 2021: -)			
5.000.000	iTraxx Europe Series 38 Call 15-Feb-2023 0,900	20.085	0,05
Swaptions insgesamt		20.085	0,05

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 141.369				
(31. Dezember 2021: 37.238)				
(22)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.937.660)	139.129	0,32
(3)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(332.535)	2.240	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt			141.369	0,32
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 100.878 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.141)			100.878	0,23
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			42.616.994	97,15

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps - (14.684)			
(31. Dezember 2021: (111.371))			
3.625.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(14.684)	(0,03)
Credit Default Swaps insgesamt		(14.684)	(0,03)
Swaptions - (15.904)			
(31. Dezember 2021: -)			
(10.000.000)	iTraxx Europe Series 38 Call 15-Feb-2023 1,075	(15.904)	(0,04)
Swaptions insgesamt		(15.904)	(0,04)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (72.043)				
(31. Dezember 2021: (6.997))				
18	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.087.640	(63.547)	(0,14)
7	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2023	738.290	(8.496)	(0,02)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(72.043)	(0,16)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (11.771) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (29.711))			(11.771)	(0,03)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(114.402)	(0,26)
Nettoumlaufvermögen			1.362.029	3,11
Summe Nettovermögen			43.864.621	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,04
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,32
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,35
Sonstiges Umlaufvermögen	4,29
Gesamtvermögen	100,00

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon European Credit Fund						
Euro	US-Dollar	357.452	354.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley	26.101
Euro	US-Dollar	619.776	621.000	25. Jan. 23	UBS AG	39.059
Euro	US-Dollar	417.085	420.000	2. Feb. 23	Morgan Stanley	24.559
Euro	US-Dollar	159.758	159.000	2. Feb. 23	Morgan Stanley	11.159
EUR						100.878
US-Dollar	Euro	191.000	190.381	25. Jan. 23	HSBC Bank plc	(11.771)
EUR						(11.771)

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 32.718			
(31. Dezember 2021: -)			
1.725	OZ Minerals Ltd	32.718	1,94
Brasilien - 23.748			
(31. Dezember 2021: -)			
3.255	WEG SA	23.748	1,41
China - 158.298			
(31. Dezember 2021: -)			
600	Contemporary Ampere Technology Co Ltd	33.957	2,02
9.080	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	55.205	3,28
5.280	NARI Technology Co Ltd 'A'	18.536	1,10
400	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	18.948	1,12
1.000	Sungrow Power Supply Co Ltd	16.083	0,95
220	Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	3.988	0,24
2.000	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	11.581	0,69
Dänemark - 102.635			
(31. Dezember 2021: 125.441)			
881	Novozymes A/S	44.529	2,64
465	Orsted AS '144A'	42.523	2,53
530	Vestas Wind Systems A/S	15.583	0,93
Finnland - 51.527			
(31. Dezember 2021: -)			
1.111	Neste Oyj	51.527	3,06
Frankreich - 35.899			
(31. Dezember 2021: 98.965)			
445	Legrand SA	35.899	2,13
Deutschland - 91.245			
(31. Dezember 2021: 59.067)			
1.370	Infineon Technologies AG	41.803	2,48
1.112	RWE AG	49.442	2,94
Irland - 39.913			
(31. Dezember 2021: 59.033)			
1.075	Smurfit Kappa Group Plc	39.913	2,37
Japan - 134.302			
(31. Dezember 2021: 431.602)			
200	Daikin Industries Ltd	30.676	1,82
100	FANUC Corp	15.046	0,90
700	Kurita Water Industries Ltd	29.009	1,72
300	Nidec Corp	15.579	0,93
800	Toyota Industries Corp	43.992	2,61
Niederlande - 28.985			
(31. Dezember 2021: 52.692)			
235	Koninklijke DSM NV	28.985	1,72
Norwegen - 30.996			
(31. Dezember 2021: 111.333)			
11.335	Aker Carbon Capture ASA	13.302	0,79
1.040	TOMRA Systems ASA	17.694	1,05
Republik Korea - 32.800			
(31. Dezember 2021: 65.619)			
70	Samsung SDI Co Ltd	32.800	1,95
Schweden - 21.839			
(31. Dezember 2021: -)			
1.179	Epiroc AB	21.839	1,30
Schweiz - 63.373			
(31. Dezember 2021: -)			
548	TE Connectivity Ltd	63.373	3,77

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Taiwan - 50.512			
(31. Dezember 2021: -)			
1.000	Voltronic Power Technology Corp	50.512	3,00
Vereinigtes Königreich - 49.633			
(31. Dezember 2021: 246.623)			
260	Ashtead Group Plc	14.856	0,88
6.991	Genuit Group Plc	23.819	1,42
532	SSE Plc	10.958	0,65
Vereinigte Staaten von Amerika - 664.852			
(31. Dezember 2021: 788.252)			
202	Albemarle Corp	43.942	2,61
229	Danaher Corp	61.137	3,63
834	Darling Ingredients Inc	51.896	3,08
161	Deere & Co	69.025	4,10
117	Ecolab Inc	17.281	1,03
404	Hubbell Inc - Class B	95.120	5,65
1.542	Ingersoll Rand Inc	81.410	4,84
1.358	NextEra Energy Inc	114.174	6,78
58	SolarEdge Technologies Inc	16.273	0,97
457	Trane Technologies Plc	77.852	4,62
728	Trimble Inc	36.742	2,18
Gesamtanlagen in Aktien		1.613.275	95,83
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Vereinigtes Königreich - 33.011			
(31. Dezember 2021: 45.419)			
18.016	Greencoat UK Wind Plc/Funds	33.011	1,96
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		33.011	1,96
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 2.730 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 687)		2.730	0,16
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.649.016	97,95
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (104) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (58))		(104)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(104)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		34.511	2,05
Summe Nettovermögen		1.683.423	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,71
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,16
Sonstiges Umlaufvermögen	2,13
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	472	502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	US-Dollar	1.308	1.397	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	85.019	89.942	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	895	
					USD	897	
					EUR	840	
US-Dollar	Euro	854	800	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	902	848	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	626	587	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	701	659	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Euro	2.425	2.282	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)	
US-Dollar	Euro	642	602	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	984	931	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(10)	
					USD	(34)	
					EUR	(32)	
BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	491	522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	1.336	1.427	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	86.577	91.590	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	911	
					USD	914	
					EUR	856	
US-Dollar	Euro	868	813	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	912	858	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	635	596	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	707	664	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Euro	2.467	2.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)	
US-Dollar	Euro	652	611	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	995	942	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)	
					USD	(35)	
					EUR	(33)	
BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	495	527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	1.343	1.434	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	86.910	91.943	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	915	
					USD	919	
					EUR	861	
US-Dollar	Euro	871	816	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	915	860	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Euro	637	598	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	708	665	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Future Earth Fund EUR W (Acc) (Hedged) Share Class Forts.							
US-Dollar	Euro	2.476	2.330	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)	
US-Dollar	Euro	654	613	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	998	944	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)	
					USD	(35)	
					EUR	(33)	

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND**

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Kanada - 68.470			
(31. Dezember 2021: 122.961)		68.470	3,55
495	Nutrien Ltd	36.398	1,89
3.738	SunOpta Inc	32.072	1,66
China - 37.548			
(31. Dezember 2021: 52.382)		37.548	1,95
5.846	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	12.518	0,65
1.117	Meituan '144A'	25.030	1,30
Dänemark - 93.706			
(31. Dezember 2021: 133.245)		93.706	4,86
637	Chr Hansen Holding A/S	45.992	2,39
944	Novozymes A/S	47.714	2,47
Frankreich - 22.079			
(31. Dezember 2021: 64.321)		22.079	1,15
416	Danone SA	22.079	1,15
Deutschland - 62.582			
(31. Dezember 2021: 100.043)		62.582	3,25
580	Bayer AG	30.225	1,57
298	Symrise AG - Class A	32.357	1,68
Hongkong - 10.963			
(31. Dezember 2021: 14.791)		10.963	0,57
5.314	Vitasoy International Holdings Ltd	10.963	0,57
Irland - 57.507			
(31. Dezember 2021: 84.940)		57.507	2,98
636	Kerry Group Plc	57.507	2,98
Japan - 101.333			
(31. Dezember 2021: 166.994)		101.333	5,26
2.600	Kubota Corp	35.892	1,86
1.300	Suntory Beverage & Food Ltd	44.476	2,31
1.800	Topcon Corp	20.965	1,09
Mexiko - 54.501			
(31. Dezember 2021: 74.634)		54.501	2,83
15.237	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	54.501	2,83
Niederlande - 98.835			
(31. Dezember 2021: 165.943)		98.835	5,13
2.168	Koninklijke Ahold Delhaize NV	62.820	3,26
292	Koninklijke DSM NV	36.015	1,87
Neuseeland - 18.446			
(31. Dezember 2021: 18.572)		18.446	0,96
3.946	a2 Milk Co Ltd/The	18.446	0,96
Norwegen - 77.102			
(31. Dezember 2021: 146.573)		77.102	4,00
1.639	Grieg Seafood ASA	13.308	0,69
2.513	Mowi ASA	43.106	2,24
1.216	TOMRA Systems ASA	20.688	1,07
Schweiz - 127.977			
(31. Dezember 2021: 246.628)		127.977	6,64
113	Bucher Industries AG	47.889	2,48
686	Nestle SA	80.088	4,16
Vereinigtes Königreich - 115.127			
(31. Dezember 2021: 273.665)		115.127	5,97
689	Genus Plc	24.893	1,29
2.395	Normad Foods Ltd	41.206	2,14
972	Unilever Plc	49.028	2,54
Vereinigte Staaten von Amerika - 922.434			
(31. Dezember 2021: 998.136)		922.434	47,87
625	AGCO Corp	86.634	4,50

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
851	Archer-Daniels-Midland Co	79.241	4,11
2.034	Brixmor Property Group Inc (REIT)	45.897	2,38
594	CF Industries Holdings Inc	50.751	2,63
731	Corteva Inc	43.118	2,24
150	Costco Wholesale Corp	68.470	3,55
115	Danaher Corp	30.702	1,59
493	Darling Ingredients Inc	30.677	1,59
212	Deere & Co	90.890	4,72
65	Ecolab Inc	9.601	0,50
1.200	Grocery Outlet Holding Corp	35.172	1,83
113	Illumina Inc	22.777	1,18
372	International Flavors & Fragrances Inc	39.106	2,03
741	Mosaic Co/The	32.171	1,67
421	PepsiCo Inc	76.586	3,97
1.729	Sprouts Farmers Market Inc	56.383	2,93
433	Sysco Corp	33.274	1,73
993	Trimble Inc	50.117	2,60
355	Twist Bioscience Corp	8.318	0,43
951	Vital Farms Inc	14.527	0,75
70	Zebra Technologies Corp	18.022	0,94
Gesamtanlagen in Aktien		1.868.610	96,97
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.868.610	96,97
Nettoumlaufvermögen		58.374	3,03
Summe Nettovermögen		1.926.984	100,00
** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,85	
Sonstiges Umlaufvermögen		3,15	
Gesamtvermögen		100,00	

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Australien - 21.653			
(31. Dezember 2021: 33.081)			
156	Cochlear Ltd	21.653	1,03
Dänemark - 63.333			
(31. Dezember 2021: 113.744)			
467	Novo Nordisk A/S	63.333	3,01
Frankreich - 157.267			
(31. Dezember 2021: 74.182)			
200	EssilorLuxottica SA	36.306	1,73
676	Sanofi	65.367	3,11
2.393	SCOR SE	55.594	2,64
Hongkong - 167.773			
(31. Dezember 2021: 72.592)			
7.600	AIA Group Ltd	84.735	4,03
6.069	Prudential Plc	83.038	3,95
Indien - 26.065			
(31. Dezember 2021: -)			
4.785	ICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	26.065	1,24
Schweiz - 185.444			
(31. Dezember 2021: 327.018)			
621	Alcon Inc	42.863	2,04
232	Roche Holding AG	73.584	3,50
143	Zurich Insurance Group AG	68.997	3,28
Vereinigtes Königreich - 49.824			
(31. Dezember 2021: 231.348)			
368	AstraZeneca Plc	49.824	2,37
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.367.305			
(31. Dezember 2021: 1.203.182)			
94	Abbott Laboratories	10.371	0,49
259	AbbVie Inc	42.107	2,00
824	Alkermes Plc	21.605	1,03
245	Becton Dickinson and Co	62.939	2,99
152	BioMarin Pharmaceutical Inc	15.572	0,74
6	Booking Holdings Inc	12.018	0,57
2.225	Boston Scientific Corp	103.140	4,91
191	Chubb Ltd	42.416	2,02
118	Cooper Cos Inc/The	39.464	1,88
327	Danaher Corp	87.301	4,15
585	Dexcom Inc	65.540	3,12
724	Edwards Lifesciences Corp	54.448	2,59
50	Elevance Health Inc	25.644	1,22
261	Eli Lilly & Co	95.791	4,56
168	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	41.989	2,00
572	Evolent Health Inc - Class A	15.910	0,76
178	Gilead Sciences Inc	15.168	0,72
1.332	Healthpeak Properties Inc (REIT)	33.560	1,60
163	Humana Inc	83.635	3,98
123	Illumina Inc	24.793	1,18
74	Inspire Medical Systems Inc	18.720	0,89
223	Intuitive Surgical Inc	59.704	2,84
407	Johnson & Johnson	72.273	3,44
151	Medtronic Plc	11.752	0,56
158	Merck & Co Inc	17.513	0,83
1.034	MetLife Inc	75.136	3,57
794	National Vision Holdings Inc	30.835	1,47
1.937	Petco Health & Wellness Co Inc - Class A	18.237	0,87
38	Regeneron Pharmaceuticals Inc	27.404	1,30
88	Repligen Corp	15.045	0,72
187	ResMed Inc	39.153	1,86
135	UnitedHealth Group Inc	71.531	3,40

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
112	Zoetis Inc	16.591	0,79
Gesamtanlagen in Aktien		2.038.664	96,98
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		2.038.664	96,98
Nettoumlaufvermögen		63.402	3,02
Summe Nettovermögen		2.102.066	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			96,90
Sonstiges Umlaufvermögen			3,10
Gesamtvermögen			100,00

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen			
Australischer Dollar - 16.729.162			
(31. Dezember 2021: 15.223.765)			
5.810.000	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	2.293.901	0,56
5.240.000	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	2.068.854	0,51
5.900.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Nov-2033	3.634.698	0,89
4.810.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	3.090.209	0,76
5.760.000	Queensland Treasury Corp '144A' 1.500% 20-Aug-2032	2.948.728	0,72
5.570.000	Treasury Corp of Victoria 2.000% 17-Sep-2035	2.692.772	0,66
Kanadischer Dollar - 24.382.250			
(31. Dezember 2021: 19.879.967)			
12.100.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.811.196	2,16
5.330.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4.648% 15-Mar-2027	3.924.800	0,96
4.930.000	Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	3.595.543	0,88
2.500.000	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	1.840.828	0,45
6.897.266	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	6.209.883	1,52
Kolumbianischer Peso - 4.929.019			
(31. Dezember 2021: 6.038.346)			
10.600.700.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	1.637.058	0,40
23.404.800.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	3.291.961	0,81
Dänische Krone - 12.910.791			
(31. Dezember 2021: 5.760.251)			
104.070.000	Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029	12.910.791	3,16
Euro - 57.687.019			
(31. Dezember 2021: 101.384.306)			
4.270.000	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateriale 1.625% 20-Jul-2027	4.249.663	1,04
2.720.000	European Union 0.450% 04-Jul-2041	1.764.816	0,43
4.900.000	FMS Wertmanagement 'EMTN' 0.375% 29-Apr-2030	4.314.801	1,06
2.590.000	French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-May-2045	2.755.057	0,68
3.860.000	Indonesia Government International Bond 1.750% 24-Apr-2025	3.936.896	0,96
4.410.000	Ireland Government Bond 1.100% 15-May-2029	4.228.495	1,04
1.871.200	Ireland Government Bond 1.500% 15-May-2050	1.404.745	0,34
4.650.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030	4.082.714	1,00
4.270.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050	3.040.083	0,74
4.247.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034	4.625.270	1,13
4.950.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 31-Jul-2035	4.327.906	1,06
5.120.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	5.128.467	1,26
3.700.000	SNCF Reseau 'EMTN' 1.125% 25-May-2030	3.399.852	0,83
2.930.000	Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032	3.720.258	0,91
2.180.000	Spain Government Bond '144A' 1.900% 31-Oct-2052	1.491.703	0,37
4.430.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	5.216.293	1,28
Indische Rupie - 1.916.405			
(31. Dezember 2021: 2.219.627)			
160.700.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	1.916.405	0,47
Indonesische Rupiah - 5.664.890			
(31. Dezember 2021: 6.287.191)			
33.622.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	2.081.573	0,51
55.190.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	3.583.317	0,88

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Japanischer Yen - 20.546.130			
(31. Dezember 2021: 32.154.861)			
1.407.600.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	8.685.720	2,13
786.550.000	Japan Government Thirty Year Bond 1.000% 20-Mar-2052	5.159.111	1,26
497.350.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Mar-2040	3.313.804	0,81
438.950.000	Japan Government Twenty Year Bond 1.000% 20-Dec-2035	3.387.495	0,83
Malaysischer Ringgit - 1.941.550			
(31. Dezember 2021: 4.323.281)			
8.810.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	1.941.550	0,48
Mexikanischer neuer Peso - 7.115.788			
(31. Dezember 2021: 6.876.991)			
44.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	2.086.801	0,51
101.000.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	5.028.987	1,23
Neuseeländischer Dollar - 37.106.425			
(31. Dezember 2021: 15.385.929)			
5.130.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	3.108.236	0,76
8.910.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2025	5.399.804	1,32
4.210.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2037	2.152.342	0,53
6.430.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	2.934.054	0,72
6.300.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	5.161.852	1,26
4.310.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.000% 15-Apr-2037	1.765.545	0,43
6.110.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	3.722.439	0,91
9.090.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-May-2031	4.597.099	1,13
5.250.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.750% 15-Apr-2025	3.141.167	0,77
8.300.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4.500% 15-Apr-2027	5.123.887	1,26
Norwegische Krone - 2.756.768			
(31. Dezember 2021: -)			
3.020.000	Norway Government Bond '144A' 3.500% 06-Oct-2042	314.263	0,07
23.472.000	Norway Government Bond '144A' 3.500% 06-Oct-2042	2.442.505	0,60
Pfund Sterling - 11.676.560			
(31. Dezember 2021: 15.219.250)			
1.790.000	Affordable Housing Finance Plc 'EMTN' 3.800% 20-May-2042	1.934.313	0,47
3.810.000	Council Of Europe Development Bank 0.750% 22-Jul-2027	3.913.649	0,96
4.810.000	United Kingdom Gilt 1.500% 31-Jul-2053	3.312.925	0,81
2.030.000	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	2.515.673	0,62
Schwedische Krone - 7.779.508			
(31. Dezember 2021: 4.140.511)			
43.890.000	European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 12-May-2025	4.025.802	0,98
40.000.000	Svensk Exportkredit AB 'EMTN' 0.235% 08-Nov-2023	3.753.706	0,92
US-Dollar - 182.543.559			
(31. Dezember 2021: 156.754.802)			
6.000.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026	5.342.154	1,31
3.257.000	Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024	3.021.409	0,74
3.630.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 5.048% 05-Aug-2026	3.670.155	0,90

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
2.250.000	Colombia Government International Bond 8.125% 21-May-2024	2.322.922	0,57
5.300.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 3.978% 14-Apr-2026	5.308.567	1,30
3.841.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' 3.875% 28-Oct-2041	3.590.576	0,88
3.948.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 4.293% 10-Feb-2026	3.934.794	0,96
4.244.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 4.582% 20-Mar-2028	4.218.680	1,03
4.430.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.448% 22-Nov-2028	4.392.202	1,07
4.630.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.583% 19-Aug-2027	4.653.666	1,14
3.328.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	2.975.731	0,73
3.032.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 5.306% 17-Jun-2026	3.081.885	0,75
4.590.000	Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024	4.246.764	1,04
1.990.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	2.110.992	0,52
8.610.000	Province of British Columbia Canada 2.250% 02-Jun-2026	8.047.991	1,97
1.715.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025	1.668.270	0,41
510.000	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	477.260	0,12
3.929.000	Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024	3.676.771	0,90
2.998.000	Republic of Italy Government International Bond 1.250% 17-Feb-2026	2.608.737	0,64
1.881.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	1.994.434	0,49
8.980.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	8.976.613	2,20
10.310.000	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.435% 31-Jul-2024	10.294.809	2,52
8.737.139	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	8.151.609	2,00
4.509.369	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jan-2031	4.008.550	0,98
4.593.894	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	4.545.872	1,11
4.920.000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 30-Sep-2026	4.376.302	1,07
19.120.000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	17.910.809	4,39
5.710.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	4.883.165	1,19
4.440.000	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050	2.975.320	0,73
18.630.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	16.989.323	4,16
18.070.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	14.916.220	3,65
13.280.000	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	11.050.412	2,71
4.900.000	United States Treasury Strip Principal (Zero Coupon) 0.000% 15-May-2043	2.120.595	0,52
Gesamtanlagen in Anleihen		395.685.824	96,90

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 1.538.359 (31. Dezember 2021: 231.888)				
(37)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(5.274.845)	343.222	0,08
(68)	Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.285.571)	604.212	0,15
(240)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(27.025.227)	305.813	0,07
51	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	10.466.953	24.168	0,01

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
35	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	3.780.547	3.186	0,00
(63)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(7.559.548)	257.758	0,06
Offene Terminkontrakte insgesamt			1.538.359	0,37
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 9.740.353 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.640.448)			9.740.353	2,39
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			406.964.536	99,66

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (92.838) (31. Dezember 2021: -)				
54	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	4.247.512	(92.838)	(0,02)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(92.838)	(0,02)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (7.331.433) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (1.982.261))			(7.331.433)	(1,80)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(7.424.271)	(1,82)
Nettoumlaufvermögen			8.815.248	2,16
Summe Nettovermögen			408.355.513	100,00

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	93,56
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,36
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	2,30
Sonstiges Umlaufvermögen	3,78
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund						
Australischer Dollar	US-Dollar	695.157	464.624	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	8.900
Australischer Dollar	US-Dollar	712.502	478.273	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	7.066
Kanadischer Dollar	US-Dollar	596.001	438.930	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1.887
Kanadischer Dollar	US-Dollar	2.699.719	1.990.495	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	6.282
Euro	US-Dollar	5.728.468	6.106.262	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	28.358
Euro	US-Dollar	4.277.714	4.52.946	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	5.093
Euro	US-Dollar	4.771.61	503.663	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	7.329
Euro	US-Dollar	843.701	889.055	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	14.465
Euro	US-Dollar	489.547	521.622	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	2.634
Euro	US-Dollar	5.540.295	5.919.147	15. Feb. 23	State Street Bank	13.958
Euro	US-Dollar	2.190.000	2.287.128	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	58.144
Euro	US-Dollar	1.290.000	1.348.726	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	32.735
Euro	US-Dollar	23.137.605	23.313.450	15. Feb. 23	State Street Bank	1.464.622
Indonesische Rupiah	US-Dollar	29.225.804.901	1.866.152	15. Feb. 23	State Street Bank	26.307
Indonesische Rupiah	US-Dollar	61.329.180.000	3.911.799	15. Feb. 23	State Street Bank	59.450
Japanischer Yen	US-Dollar	310.220.000	2.249.231	15. Feb. 23	State Street Bank	119.259
Japanischer Yen	US-Dollar	8.387.025.706	58.029.332	15. Feb. 23	State Street Bank	6.004.536
Japanischer Yen	US-Dollar	201.203.028	1.392.804	15. Feb. 23	State Street Bank	144.119
Japanischer Yen	US-Dollar	56.640.621	430.861	15. Feb. 23	State Street Bank	1.583
Japanischer Yen	US-Dollar	365.445.412	2.702.888	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	87.261
Japanischer Yen	US-Dollar	87923.481	645.224	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	26.060
Japanischer Yen	US-Dollar	96.870.000	673.814	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	65.776
Mexikanischer Peso	US-Dollar	124.669.368	6.231.515	15. Feb. 23	State Street Bank	88.819
Pfund Sterling	US-Dollar	7.975.651	9.179.743	15. Feb. 23	State Street Bank	433.159
Pfund Sterling	US-Dollar	9.729.305	11.198.148	15. Feb. 23	State Street Bank	528.400
Pfund Sterling	US-Dollar	740.000	885.544	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	6.364
Schwedische Krone	US-Dollar	43.694.307	4.061.867	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	159.878
Schwedische Krone	US-Dollar	4.810.000	463.136	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1.607
US-Dollar	Kanadischer Dollar	18.193.462	24.503.210	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	70.298
US-Dollar	Kanadischer Dollar	377.307	506.175	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	2.928
US-Dollar	Indische Rupie	2.057.966	169.627.865	15. Feb. 23	State Street Bank	9.401
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	249.190	392.011	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	209
US-Dollar	Pfund Sterling	3.953.642	3.246.561	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	40.624
US-Dollar	Pfund Sterling	652.323	535.363	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	7.060
US-Dollar	Pfund Sterling	2.649.944	2.139.401	15. Feb. 23	UBS AG	71.364
US-Dollar	Pfund Sterling	6.125.180	5.032.891	15. Feb. 23	State Street Bank	59.131
US-Dollar	Pfund Sterling	2.096.745	1.717.533	15. Feb. 23	UBS AG	26.635
US-Dollar	Schwedische Krone	680.257	7.021.596	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	1.830
US-Dollar	Schwedische Krone	327.201	3.365.310	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	2.045
						USD 9.695.576
Kanadischer Dollar	US-Dollar	5.130.926	3.856.844	15. Feb. 23	State Street Bank	(61.888)
Mexikanischer Peso	US-Dollar	78.391.011	3.983.217	15. Feb. 23	State Street Bank	(8.046)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.061.068	674.306	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(381)
Pfund Sterling	US-Dollar	470.000	568.856	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	(2.374)
US-Dollar	Australischer Dollar	9.519.341	14.656.165	15. Feb. 23	State Street Bank	(464.084)
US-Dollar	Australischer Dollar	432.953	641.170	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(3.796)
US-Dollar	Australischer Dollar	459.476	680.000	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(3.724)
US-Dollar	Australischer Dollar	477.786	710.408	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(6.126)
US-Dollar	Chilenischer Peso	3.778.995	3.474.710.368	15. Feb. 23	State Street Bank	(253.723)
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	989.125	4.907.950.000	15. Feb. 23	UBS AG	(14.664)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungsdatum (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	3.981.984	20.359.683.913	15. Feb. 23	State Street Bank	(182.040)
US-Dollar	Dänische Krone	9.135.543	67.388.586	15. Feb. 23	UBS AG	(572.608)
US-Dollar	Dänische Krone	1.847.685	12.872.477	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(6.752)
US-Dollar	Dänische Krone	587.959	4.147.121	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(9.484)
US-Dollar	Euro	229.680	220.027	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(5.947)
US-Dollar	Euro	404.590	400.000	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(23.770)
US-Dollar	Euro	402.960	387.865	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(12.404)
US-Dollar	Euro	263.682	252.312	15. Feb. 23	State Street Bank	(6.519)
US-Dollar	Euro	592.623	561.688	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(8.888)
US-Dollar	Euro	368.443	353.407	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(10.021)
US-Dollar	Euro	465.299	436.638	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(2.296)
US-Dollar	Euro	1.047.050	1.000.000	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(23.851)
US-Dollar	Euro	187.648	175.804	15. Feb. 23	State Street Bank	(622)
US-Dollar	Euro	629.485	595.207	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(7.923)
US-Dollar	Euro	4.060.840	3.903.350	15. Feb. 23	State Street Bank	(119.259)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	1.260.836	19.782.520.283	15. Feb. 23	State Street Bank	(20.141)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	622.498	9.710.733.704	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(6.301)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.724.206	90.093.281.754	15. Feb. 23	State Street Bank	(109.604)
US-Dollar	Japanischer Yen	529.560	71.610.000	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(171.73)
US-Dollar	Japanischer Yen	481.964	64.411.822	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(9.812)
US-Dollar	Japanischer Yen	485.497	63.689.455	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	(764)
US-Dollar	Japanischer Yen	4.047.364	550.207.408	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(153.399)
US-Dollar	Japanischer Yen	360.279	48.707.095	15. Feb. 23	State Street Bank	(11.594)
US-Dollar	Japanischer Yen	484.052	65.960.364	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(19.547)
US-Dollar	Japanischer Yen	6.238.337	856.955.117	15. Feb. 23	State Street Bank	(304.406)
US-Dollar	Koreanischer Won	3.876.740	5.327.610.000	15. Feb. 23	State Street Bank	(374.410)
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	1.776.885	8.404.665	15. Feb. 23	State Street Bank	(144.187)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	10.562.580	209.004.944	15. Feb. 23	State Street Bank	(33.294)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	389.275	7.787.131	15. Feb. 23	UBS AG	(5.507)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	409.304	8.080.000	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(326)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	33.408.989	56.247.403	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(2.315.867)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	507.657	814.124	15. Feb. 23	State Street Bank	(9.424)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	898.250	1.416.562	15. Feb. 23	UBS AG	(1.462)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	774.766	1.250.000	15. Feb. 23	State Street Bank	(19.157)
US-Dollar	Norwegische Krone	2.279.934	23.368.490	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(99.839)
US-Dollar	Norwegische Krone	323.352	3.190.189	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(1.527)
US-Dollar	Polnischer Zloty	5.587.997	26.554.545	15. Feb. 23	UBS AG	(441.187)
US-Dollar	Polnischer Zloty	428.650	1.922.445	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(7.839)
US-Dollar	Pfund Sterling	586.173	487.799	15. Feb. 23	State Street Bank	(1.762)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.957.977	3.320.000	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(43.557)
US-Dollar	Schwedische Krone	4.442.466	47.780.344	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(174.071)
						USD (6.138.347)
BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Australischer Dollar	52	76	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
						USD 1
						AUD 1
Australischer Dollar	US-Dollar	88	60	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Australischer Dollar	US-Dollar	10.788	7.357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Australischer Dollar	93	137	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Australischer Dollar	62	93	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
						USD (21)
						AUD (31)

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)

Euro	US-Dollar	6.734	7.193	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	825.471	873.271	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.688
						USD 8.691
						EUR 8.140
US-Dollar	Euro	7.479	7.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Euro	4.432	4.166	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Euro	7.747	7.290	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(42)
US-Dollar	Euro	6.064	5.689	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
						USD (112)
						EUR (105)

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)

Euro	US-Dollar	11.352	12.125	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	1.389.216	1.469.660	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14.622
						USD 14.626
						EUR 13.699
US-Dollar	Euro	12.474	11.732	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(61)
US-Dollar	Euro	7.310	6.871	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Euro	147	138	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	1.364	1.279	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	448	422	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	12.999	12.232	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70)
US-Dollar	Euro	10.127	9.502	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)
						USD (194)
						EUR (182)

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	12	14	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	682	822	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	47	39	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	1.198	985	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12
US-Dollar	Pfund Sterling	26	22	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	30.758	25.234	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	370
US-Dollar	Pfund Sterling	506	411	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11
US-Dollar	Pfund Sterling	25.018	20.195	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	698
US-Dollar	Pfund Sterling	304	247	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

US-Dollar	Pfund Sterling	2.999	2.442	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58
						USD 1.155
						GBP 959
Pfund Sterling	US-Dollar	24.174	30.032	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(921)
Pfund Sterling	US-Dollar	912	1.120	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.924.721	3.603.770	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(81.691)
US-Dollar	Pfund Sterling	45.598	37.882	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
						USD (82.656)
						GBP (68.657)

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	10.614	8.764	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60
US-Dollar	Pfund Sterling	27	23	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	93	76	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	76	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						USD 63
						GBP 52
Pfund Sterling	US-Dollar	73	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.851	10.906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(247)
						USD (250)
						GBP (208)

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

US-Dollar	Pfund Sterling	7.400	6.071	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	89
US-Dollar	Pfund Sterling	177.155	143.959	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.793
US-Dollar	Pfund Sterling	7.252	5.854	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	202
						USD 4.084
						GBP 3.392
Pfund Sterling	US-Dollar	5.815	7.224	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(222)
Pfund Sterling	US-Dollar	848.542	1.045.553	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23.701)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.952	9.099	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
						USD (23.928)
						GBP (19.875)

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

US-Dollar	Pfund Sterling	78.515	65.187	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	37
Pfund Sterling	US-Dollar	2.829	3.403	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	11	14	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	192.516	159.770	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	114
US-Dollar	Pfund Sterling	30.928	25.537	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	175
US-Dollar	Pfund Sterling	7.756	6.359	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	98

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	19.631	16.088	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	256
US-Dollar	Pfund Sterling	403.016	330.634	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.852
US-Dollar	Pfund Sterling	18.869	15.237	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	520
US-Dollar	Pfund Sterling	16.168	13.139	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	346
US-Dollar	Pfund Sterling	327.502	264.369	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.137
US-Dollar	Pfund Sterling	22.208	18.069	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	448
US-Dollar	Pfund Sterling	7.035	5.729	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	136
US-Dollar	Pfund Sterling	65.182	54.098	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34
USD						16.157
GBP						13.421
Pfund Sterling	US-Dollar	54.098	65.160	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
Pfund Sterling	US-Dollar	65.187	78.542	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(41)
Pfund Sterling	US-Dollar	88.250	106.337	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(63)
Pfund Sterling	US-Dollar	13.510	16.362	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(93)
Pfund Sterling	US-Dollar	51.752	62.972	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(649)
Pfund Sterling	US-Dollar	28.980	35.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(448)
Pfund Sterling	US-Dollar	57.213	69.810	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(912)
Pfund Sterling	US-Dollar	25.310	31.184	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(704)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.359	10.352	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(285)
Pfund Sterling	US-Dollar	317.010	393.842	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12.084)
Pfund Sterling	US-Dollar	13.948	17.164	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(367)
Pfund Sterling	US-Dollar	186.034	228.430	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.399)
Pfund Sterling	US-Dollar	38.150.040	47.007.555	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.065.572)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.404	2.829	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Pfund Sterling	597.488	496.379	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(273)
USD						(1.085.925)
GBP						(902.005)

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Supranational - 8.241.218			
(31. Dezember 2021: 850.000)			
8.241.218	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	8.241.218	2,14
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		8.241.218	2,14
Anleihen			
Australien - 13.981.295			
(31. Dezember 2021: 14.575.803)			
3.443.000	Commonwealth Bank of Australia 'REGS' FRN 3.610% 12-Sep-2034	2.859.997	0,74
1.480.000	Metro Finance 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 4,572% 20-Jun-2027	977.215	0,25
3.408.000	National Australia Bank Ltd 'REGS' FRN 3.933% 02-Aug-2034	2.883.322	0,75
1.300.000	Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 5,068% 22-Jan-2053	873.627	0,23
1.300.000	Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 4,810% 15-Jan-2063	860.771	0,22
901.833	RESIMAC Premier Series 2020-1 '2020-1X C' FRN 5,908% 07-Feb-2052	611.186	0,16
1.357.000	Ruby Bond Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 4,510% 12-Mar-2053	895.431	0,23
1.423.000	Santos Finance Ltd 'EMTN' 5,250% 13-Mar-2029	1.307.266	0,34
1.770.000	Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 5,010% 15-Jun-2052	1.184.463	0,31
1.775.000	Westpac Banking Corp FRN 4,110% 24-Jul-2034	1.528.017	0,40
Österreich - 4.204.879			
(31. Dezember 2021: -)			
400.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0,050% 01-Sep-2027	343.645	0,09
1.200.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 5,750% 27-Jan-2028	1.315.479	0,34
1.200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2,875% 18-Jun-2032	1.056.768	0,27
1.400.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7,375% 20-Dec-2032	1.488.987	0,39
Belgien - 2.558.942			
(31. Dezember 2021: 6.609.026)			
2.600.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3,700% 02-Apr-2040	2.558.942	0,67
Brasilien - 522.501			
(31. Dezember 2021: 4.049.820)			
3.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000% 01-Jan-2027	522.501	0,14
Kanada - 3.121.471			
(31. Dezember 2021: 5.884.941)			
100.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4,300% 29-Jul-2049	82.256	0,02
20.000	Canadian Government Bond 2,000% 01-Dec-2051	11.230	-
848.000	Canadian National Railway Co 4,400% 05-Aug-2052	761.097	0,20
3.178.000	Canadian Pacific Railway Co 3,100% 02-Dec-2051	2.165.340	0,56
118.000	Rogers Communications Inc '144A' 3,800% 15-Mar-2032	101.548	0,03
Chile - 671.816			
(31. Dezember 2021: -)			
775.000	Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4,000% 27-Jan-2032	671.816	0,17
Tschechische Republik - 1.946.731			
(31. Dezember 2021: -)			
1.833.000	CEZ AS 'EMTN' 2,375% 06-Apr-2027	1.775.303	0,46
177.000	CEZ AS 'EMTN' 2,375% 06-Apr-2027	171.428	0,05
Frankreich - 21.091.130			
(31. Dezember 2021: 15.012.873)			
5.100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 3,625% 01-Sep-2029	5.228.425	1,36
958.000	Electricite de France SA '144A' 4,875% 21-Sep-2038	786.027	0,20

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Frankreich Forts.			
825.000	Electricite de France SA '144A' 5,000% 21-Sep-2048	674.393	0,18
2.419.000	Electricite de France SA 'REGS' 5,600% 27-Jan-2040	2.227.760	0,58
2.200.000	La Banque Postale SA FRN 5,500% 05-Mar-2034	2.309.658	0,60
3.100.000	Orano SA 'EMTN' 2,750% 08-Mar-2028	2.994.099	0,78
100.000	Orano SA 'EMTN' 3,375% 23-Apr-2026	104.483	0,03
200.000	Societe Generale SA '144A' FRN 2,889% 09-Jun-2032	154.902	0,04
3.700.000	Suez SACA 'EMTN' 2,375% 24-May-2030	3.477.294	0,90
600.000	Suez SACA 'EMTN' 5,000% 03-Nov-2032	656.808	0,17
800.000	WEA Finance LLC '144A' 3,500% 15-Jun-2029	659.053	0,17
2.678.000	WEA Finance LLC '144A' 4,625% 20-Sep-2048	1.818.228	0,47
Deutschland - 19.597.548			
(31. Dezember 2021: 22.950.045)			
3.942.687	Bundessobligation 0,000% 05-Apr-2024	4.090.378	1,06
419.324	Bundessobligation 0,000% 10-Oct-2025	418.783	0,11
200.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,000% 15-Feb-2032	170.379	0,04
76.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,250% 04-Jul-2042	89.538	0,02
4.500.000	Bundesschatzanweisungen 0,400% 13-Sep-2024	4.637.690	1,21
147.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6,250% 03-Jun-2030	185.153	0,05
1.691.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 6,375% 07-Jun-2032	2.166.751	0,56
557.000	EnBW International Finance BV 'EMTN' 4,049% 22-Nov-2029	592.231	0,15
1.500.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3,279% 05-Sep-2031	1.536.680	0,40
3.900.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,250% 25-Apr-2023	3.847.406	1,00
1.300.000	Vonovia SE 1,875% 28-Jun-2028	1.184.878	0,31
400.000	Vonovia SE 'EMTN' 5,000% 23-Nov-2030	419.263	0,11
300.000	Wintershall Dea Finance BV 1,332% 25-Sep-2028	258.418	0,07
Indonesien - 1.032.437			
(31. Dezember 2021: 4.001.053)			
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3,541% 27-Apr-2032	165.063	0,04
1.172.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4,745% 09-Jun-2051	867.374	0,23
Irland - 13.364.044			
(31. Dezember 2021: 15.193.452)			
281.339	Arrow CMBS 2018 DAC '2018-1 C' FRN 3,871% 22-May-2030	292.109	0,08
952.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6,750% 01-Mar-2033	1.015.472	0,26
627.881	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 4,723% 02-May-2030	730.409	0,19
526.024	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 5,473% 02-May-2030	618.584	0,16
323.419	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 4,894% 24-Feb-2058	328.946	0,09
275.942	Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 3,395% 17-Aug-2031	269.411	0,07
28.896	Portman Square 2021-NPL1 DAC '2021-NPL1X A' FRN 3,577% 25-Oct-2061	30.696	0,01
230.193	Retiro Mortgage Securities DAC FRN 3,578% 30-Jul-2075	245.500	0,06
838.000	Richmond Park CLO 1 DAC FRN 2,863% 14-Jul-2031	862.800	0,22
3.198.000	Shamrock Residential 2021-1 DAC '2021-1 B' FRN 3,294% 24-Dec-2059	3.375.669	0,88
325.608	Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 4,901% 17-May-2031	364.376	0,09
594.804	Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 3,881% 22-Dec-2030	600.762	0,16
1.579.519	Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 5,001% 17-Aug-2031	1.782.125	0,46
348.000	Toro European CLO 4 DAC FRN 3,478% 15-Jul-2030	355.638	0,09
2.100.999	Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 4,176% 22-Jul-2029	2.491.547	0,65

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen Forts.			
Italien - 10.129.061			
(31. Dezember 2021: 9.305.892)			
1.223.000	Enel Finance International NV '144A' 7.500% 14-Oct-2032	1.304.407	0,34
4.019.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2024	4.052.988	1,05
614.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 8.248% 21-Nov-2033	626.789	0,16
4.124.000	Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024	4.144.877	1,08
Japan - 1.794.960			
(31. Dezember 2021: 15.378.474)			
118.800.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051	725.400	0,19
60.950.000	Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040	404.004	0,11
710.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 'EMTN' FRN 0.337% 08-Jun-2027	665.556	0,17
Luxemburg - 2.244.832			
(31. Dezember 2021: -)			
2.843.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	2.244.832	0,58
Niederlande - 17.579.642			
(31. Dezember 2021: 12.286.106)			
2.300.000	ABN AMRO Bank NV 4.500% 21-Nov-2034	2.425.611	0,63
200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 15-Apr-2026	196.371	0,05
1.065.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	1.135.065	0,29
1.538.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	1.396.305	0,36
1.128.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	1.136.795	0,30
3.100.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024	3.124.007	0,81
1.200.000	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	1.344.503	0,35
3.958.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	4.115.443	1,07
190.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 0.875% 16-Jun-2035	141.189	0,04
2.311.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.500% 28-Oct-2034	2.564.353	0,67
Portugal - 597.594			
(31. Dezember 2021: -)			
580.000	EDP Finance BV '144A' 6.300% 11-Oct-2027	597.594	0,16
Rumänien - 2.537.557			
(31. Dezember 2021: 1.507.094)			
1.423.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2.000% 28-Jan-2032	1.017.372	0,26
700.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	615.879	0,16
1.125.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.750% 07-Feb-2034	904.306	0,24
Spanien - 4.953.182			
(31. Dezember 2021: 5.279.250)			
1.800.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	1.621.811	0,42
900.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	906.085	0,24
200.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 4.750% 30-Aug-2028	232.123	0,06
2.200.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	2.066.164	0,54
150.000	Telefonica Emisiones SA 5.520% 01-Mar-2049	126.999	0,03
Supranational - 3.650.386			
(31. Dezember 2021: 3.677.751)			
3.700.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20-Apr-2023	3.650.386	0,95
Schweden - 1.138.839			
(31. Dezember 2021: 3.841.160)			
1.435.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.000% 12-Aug-2027	1.070.330	0,28
100.000	SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029	68.509	0,02
Schweiz - 6.210.213			
(31. Dezember 2021: 16.576.140)			
2.173.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	1.741.411	0,45

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert USD	Summe Nettowert mögen %
Anleihen Forts.			
Schweiz Forts.			
1.664.000	Credit Suisse Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	1.287.548	0,33
1.128.000	Credit Suisse Group AG FRN 7.750% 01-Mar-2029	1.200.682	0,31
1.809.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN 5.125% 23-Nov-2052	1.980.572	0,52
Thailand - 637.904			
(31. Dezember 2021: -)			
796.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 5.375% 20-Nov-2048	637.904	0,17
Vereinigtes Königreich - 29.277.358			
(31. Dezember 2021: 66.693.139)			
1.056.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 3.250% 31-Jul-2028	955.755	0,25
2.102.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 4.875% 31-Jul-2024	2.415.267	0,63
733.646	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 3.784% 17-Mar-2039	805.396	0,21
620.000	Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 4.494% 25-Jul-2058	739.296	0,19
1.307.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 8.407% 14-Nov-2032	1.633.363	0,42
800.000	BAT Capital Corp 5.282% 02-Apr-2050	637.329	0,17
1.849.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	1.543.710	0,40
526.000	Canada Square Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 5.025% 17-Jun-2058	603.490	0,16
738.000	Castell 2020-1 Plc '2020-1 C' FRN 5.832% 25-Mar-2053	882.058	0,23
1.788.000	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd 2.000% 13-Apr-2030	1.612.842	0,42
3.412.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	2.869.165	0,75
200.000	LSEGA Financing Plc '144A' 3.200% 06-Apr-2041	148.563	0,04
496.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	520.882	0,14
3.465.000	National Grid Plc 'EMTN' 3.245% 30-Mar-2034	3.307.979	0,86
200.000	NatWest Markets Plc '144A' 0.800% 12-Aug-2024	185.497	0,05
678.000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 4.973% 15-Jul-2029	788.002	0,20
826.000	Newday Partnership Funding 2020-1 Plc '2020-1X B' FRN 5.179% 15-Nov-2028	997.267	0,26
2.584.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4.870% 06-May-2026	2.842.930	0,74
109.321	Ribbon Finance 2018 Plc '2018-1 D' FRN 4.796% 20-Apr-2028	126.191	0,03
378.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 5.695% 23-Jan-2029	441.489	0,11
642.997	Tower Bridge Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 4.771% 20-Nov-2063	738.567	0,19
1.750.000	United Kingdom Gilt 1.250% 22-Oct-2041	1.347.466	0,35
1.110.000	United Kingdom Gilt 1.250% 31-Jul-2051	724.242	0,19
1.041.000	Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031	902.306	0,23
1.478.000	Yorkshire Building Society FRN 3.511% 11-Oct-2030	1.508.306	0,39
Vereinigte Staaten von Amerika - 198.334.194			
(31. Dezember 2021: 183.035.456)			
1.605.000	7-Eleven Inc '144A' 1.800% 10-Feb-2031	1.230.622	0,32
200.000	7-Eleven Inc 'REGS' 1.800% 10-Feb-2031	153.349	0,04
200.000	AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039	173.024	0,05
200.000	AT&T Inc 3.500 % 01-Jun-2041	150.955	0,04
1.329.000	AT&T Inc 4.500 % 09-Mar-2048	1.092.602	0,28
200.000	Avangrid Inc 3.800% 01-Jun-2029	182.619	0,05
2.070.000	Bank of America Corp FRN 4.571% 27-Apr-2033	1.907.070	0,50
1.610.000	Bank of America Corp FRN 5.015% 22-Jul-2033	1.538.480	0,40
1.100.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.500% 18-Mar-2030	998.629	0,26
3.065.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 3.850% 15-Mar-2052	2.495.000	0,65
1.995.000	Boeing Co/The 4.875% 01-May-2025	1.978.432	0,51
1.360.000	Broadcom Inc '144A' 1.950% 15-Feb-2028	1.152.343	0,30
770.000	Celanese US Holdings LLC 4.777% 19-Jul-2026	785.346	0,20
2.093.000	Celanese US Holdings LLC 5.337% 19-Jan-2029	2.120.655	0,55
296.000	Celanese US Holdings LLC 6.379% 15-Jul-2032	283.200	0,07
2.567.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.700% 01-Apr-2051	1.579.863	0,41

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
900.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.200% 15-Mar-2028	830.117	0,22	
5.764.000	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	5.928.488	1,54	
100.000	Commonwealth Edison Co 4.000% 01-Mar-2049	82.099	0,02	
2.887.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3.950% 01-Apr-2050	2.316.997	0,60	
100.000	Crown Castle Inc 3.250% 15-Jan-2051	65.789	0,02	
3.730.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	3.620.888	0,94	
4.100.000	Entergy Corp 2.400% 15-Jun-2031	3.278.678	0,85	
2.400.000	Exelon Corp '144A' 4.100% 15-Mar-2052	1.944.119	0,51	
2.430.000	FedEx Corp 0.450% 04-May-2029	2.065.493	0,54	
2.200.000	FedEx Corp 0.950% 04-May-2033	1.682.373	0,44	
4.005.000	Fidelity National Information Services Inc 1.100% 15-Jul-2024	4.132.222	1,07	
1.282.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049	1.051.321	0,27	
480.000	FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044	451.713	0,12	
2.328.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	1.862.481	0,48	
3.840.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.250% 07-Feb-2029	3.423.534	0,89	
1.701.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 3.625% 29-Oct-2029	1.833.693	0,48	
1.145.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.102% 24-Feb-2033	935.955	0,24	
2.670.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	2.799.798	0,73	
2.100.000	Intercontinental Exchange Inc 4.950% 15-Jun-2052	1.956.491	0,51	
1.551.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2033	1.483.190	0,39	
250.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 'REGS' 5.750% 01-Apr-2033	239.070	0,06	
2.600.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	2.431.938	0,63	
360.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.005% 23-Apr-2029	333.144	0,09	
1.520.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4.912% 25-Jul-2033	1.458.723	0,38	
2.359.000	Kyndryl Holdings Inc 3.150% 15-Oct-2031	1.582.037	0,41	
4.490.000	McDonald's Corp 'GMTN' 3.000% 31-May-2034	4.423.017	1,15	
3.140.000	Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	2.551.545	0,66	
2.533.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 5.148% 25-Jan-2034	2.804.522	0,73	
1.724.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.500% 24-Mar-2026	1.654.566	0,43	
734.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028	646.897	0,17	
974.000	Newell Brands Inc 5.750% 01-Apr-2046	778.079	0,20	
414.000	NiSource Inc 5.000% 15-Jun-2052	380.650	0,10	
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC 3.700% 15-May-2050	80.056	0,02	
3.590.000	Oncor Electric Delivery Co LLC '144A' 4.550% 15-Sep-2032	3.538.207	0,92	
1.042.000	ONEOK Inc 7.150% 15-Jan-2051	1.070.753	0,28	
2.957.000	Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2050	2.017.217	0,52	
3.753.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	3.692.427	0,96	
2.295.000	Roche Holdings Inc '144A' 2.607% 13-Dec-2051	1.503.462	0,39	
2.851.000	Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081	2.393.911	0,62	
3.830.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 6.375% 12-Sep-2032	3.805.150	0,99	
167.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.750% 12-Sep-2024	171.108	0,04	
2.100.000	Travelers Cos Inc/The 3.050% 08-Jun-2051	1.451.709	0,38	
2.505.400	United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025	2.243.507	0,58	
610.000	United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026	544.747	0,14	
3.850.000	United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-Aug-2026	3.414.318	0,89	
8.032.400	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	5.070.139	1,32	
7.645.900	United States Treasury Note/Bond 1.250% 30-Nov-2026	6.871.454	1,79	
8.250.000	United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2027	7.568.086	1,97	
7.670.400	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024-	7.455.269	1,94	
16.300.000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-May-2027	15.389.492	4,00	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
3.075.200	United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028	2.897.175	0,75	
18.980.000	United States Treasury Note/Bond 3.000% 31-Jul-2024	18.521.811	4,81	
23.600.000	United States Treasury Note/Bond 3.250% 30-Jun-2027	22.858.813	5,94	
1.840.000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 31-Oct-2027	1.849.919	0,48	
200.000	Verizon Communications Inc 3.400% 22-Mar-2041	151.832	0,04	
2.256.000	Verizon Communications Inc 4.750% 31-Oct-2034	2.482.241	0,65	
740.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 5.141% 15-Mar-2052	543.771	0,14	
950.000	WPC Eurobond BV 0.950% 01-Jun-2030	738.468	0,19	
1.300.000	WPC Eurobond BV 1.350% 15-Apr-2028	1.157.336	0,30	
Gesamtanlagen in Anleihen		361.178.516	93,88	
Credit Default Swaps - 1.804.766				
(31. Dezember 2021: 5.740.006)				
1.775.000	CDS Apache Corporation 1.000% 20-Dec-2027	71.362	0,02	
3.600.000	CDS British America Tobacco Plc 1.000% 20-Dec-2027	23.280	0,01	
1.775.000	CDS British Telecommunications Plc 1.000% 20-Dec-2027	44.471	0,01	
75.000	CDS British Telecommunications Plc 1.000% 20-Dec-2027	1.879	0,00	
(26.068.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	207.764	0,05	
(343.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.734	0,00	
(2.225.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	17.733	0,01	
(1.500.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	11.955	0,00	
(350.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.790	0,00	
(200.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	1.594	0,00	
(338.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.694	0,00	
(1.575.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	12.553	0,00	
(3.375.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	26.899	0,01	
(45.400.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	361.841	0,09	
(2.400.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	19.128	0,01	
1.775.000	CDS Devon Energy Corporation 1.000% 20-Dec-2027	25.363	0,01	
3.600.000	CDS Imperial Brands Plc 1.000% 20-Dec-2027	16.250	0,01	
930.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	72.769	0,02	
845.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	66.118	0,02	
35.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	2.739	0,00	
40.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	3.130	0,00	
(1.600.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	7.350	0,00	
(450.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.067	0,00	
(89.430.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	410.837	0,11	
(1.600.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	7.350	0,00	
(600.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.756	0,00	
(1.475.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	6.776	0,00	
(840.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	3.859	0,00	
(200.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	919	0,00	
(1.505.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	6.914	0,00	
(600.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	2.756	0,00	
(725.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	3.331	0,00	
(2.550.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	11.715	0,00	
(150.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	689	0,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps Forts.			
(2.200.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	10.107	0,00
(2.000.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	9.188	0,00
1.750.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2027	115.761	0,03
75.000	CDS Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1.000% 20-Dec-2027	4.961	0,00
900.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	70.992	0,02
875.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	69.020	0,02
75.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	5.916	0,00
75.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2027	742	0,00
1.775.000	CDS United States Steel Corporation 5.000% 20-Dec-2027	17.555	0,01
(75.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2027	540	0,00
(1.900.000)	CDS Virgin Media Finance Plc 5.000% 20-Dec-2027	13.685	0,00
(75.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2027	909	0,00
(1.900.000)	CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2027	23.025	0,01
Credit Default Swaps insgesamt		1.804.766	0,47
Zinsswaps - 244.045			
(31. Dezember 2021: -)			
3.980.000	IRS Pay Fixed 2.98% Receive 1 Year GBP SONIA OIS Compound 19-Aug-2027	229.622	0,06
250.000	IRS Pay Fixed 2.98% Receive 1 Year GBP SONIA OIS Compound 19-Aug-2027	14.423	0,00
Zinsswaps insgesamt		244.045	0,06
Swaptions - 199.158			
(31. Dezember 2021: 3.076)			
2.400.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.800	5.571	0,00
46.100.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.800	107.003	0,03
2.200.000	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.925	4.359	0,00
41.500.000	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.925	82.225	0,02
Swaptions insgesamt		199.158	0,05
		Zugrunde liegendes Engagement USD	Summe Nettovermögen %
Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 2.219.011			
(31. Dezember 2021: 554.831)			
(167)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (20.692.079)	566.118	0,15
(14)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (1.632.309)	133.814	0,04
(124)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (17.644.580)	1.168.712	0,30
(11)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (1.241.316)	15.172	0,00
(9)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (9.975.160)	144.102	0,04
132	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023 27.070.312	32.327	0,01
(172)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (18.563.906)	148.535	0,04
(2)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (241.548)	10.231	0,00
Offene Terminkontrakte insgesamt		2.219.011	0,58
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.565.148 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.515.790)		3.565.148	0,93
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		377.451.862	98,11

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps - (3.373.387)			
(31. Dezember 2021: (4.948.648))			
3.575.000	CDS Anglo American Plc 1.000% 20-Dec-2027	(535.097)	(0,14)
75.000	CDS ArcelorMittal S.A. 5.000% 20-Dec-2027	(9.151)	(0,00)
1.825.000	CDS ArcelorMittal S.A. 5.000% 20-Dec-2027	(222.678)	(0,06)
3.500.000	CDS Barrick Gold Corporation 1.000% 20-Dec-2027	(56.044)	(0,02)
2.925.000	CDS Bayerische Motoren Werke AG 1.000% 20-Dec-2027	(31.542)	(0,01)
175.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2027	(953)	(0,00)
3.500.000	CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2027	(19.051)	(0,01)
1.775.000	CDS Canadian National Resources Limited 1.000% 20-Dec-2027	(11.367)	(0,00)
3.550.000	CDS Carrefour SA 1.000% 20-Dec-2027	(2.110)	(0,00)
175.000	CDS Carrefour SA 1.000% 20-Dec-2027	(104)	(0,00)
375.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(2.989)	(0,00)
425.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(3.387)	(0,00)
900.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(7.173)	(0,00)
17.658.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(140.736)	(0,04)
20.500.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(163.387)	(0,04)
1.600.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(12.752)	(0,00)
175.000	CDS Cisco Systems Inc 1.000% 20-Dec-2027	(5.133)	(0,00)
3.500.000	CDS Cisco Systems Inc 1.000% 20-Dec-2027	(102.652)	(0,03)
(175.000)	CDS Dow Chemical Company 1.000% 20-Dec-2027	(1.906)	(0,00)
(3.500.000)	CDS Dow Chemical Company 1.000% 20-Dec-2027	(38.117)	(0,01)
3.575.000	CDS Glencore International AG 1.000% 20-Dec-2027	(541.789)	(0,14)
500.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(5.342)	(0,00)
2.150.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(22.972)	(0,01)
50.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(534)	(0,00)
6.950.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(74.260)	(0,02)
175.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(804)	(0,00)
400.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(1.838)	(0,00)
125.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(574)	(0,00)
3.075.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(14.126)	(0,00)
5.600.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(25.726)	(0,01)
2.825.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(12.978)	(0,00)
2.825.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(12.978)	(0,00)
3.075.000	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(14.126)	(0,00)
29.800.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(10.558)	(0,00)
1.000.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(354)	(0,00)
(100.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(3.437)	(0,00)
(60.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(2.062)	(0,00)
(2.773.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(95.313)	(0,03)
(63.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(2.165)	(0,00)
(1.342.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(46.127)	(0,01)
(1.410.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(48.464)	(0,01)
(2.375.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(81.633)	(0,02)
(127.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(4.365)	(0,00)
3.550.000	CDS Koninklijke Ahold Delhaize N.V. 1.000% 20-Dec-2027	(99.083)	(0,03)
175.000	CDS Koninklijke Ahold Delhaize N.V. 1.000% 20-Dec-2027	(4.884)	(0,00)
(3.800.000)	CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2027	(352.382)	(0,09)
2.575.000	CDS Mercedes-Benz Group AG 1.000% 20-Dec-2027	(16.037)	(0,01)
(3.750.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2027	(323.541)	(0,08)
(175.000)	CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2027	(15.099)	(0,00)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Credit Default Swaps Forts.			
3.550.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2027	(37.731)	(0,01)
175.000	CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2027	(1.860)	(0,00)
3.550.000	CDS Repsol S.A. 1.000% 20-Dec-2027	(29.486)	(0,01)
175.000	CDS Repsol S.A. 1.000% 20-Dec-2027	(1.454)	(0,00)
1.750.000	CDS Valero Energy Corporation 1.000% 20-Dec-2027	(815)	(0,00)
(3.550.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2027	(19.131)	(0,01)
(175.000)	CDS Verizon Communications Inc 1.000% 20-Dec-2027	(943)	(0,00)
175.000	CDS Vodafone Group Plc 1.000% 20-Dec-2027	(377)	(0,00)
3.550.000	CDS Vodafone Group Plc 1.000% 20-Dec-2027	(7.649)	(0,00)
(3.550.000)	CDS Volkswagen AG 1.000% 20-Dec-2027	(74.061)	(0,02)
Credit Default Swaps insgesamt		(3.373.387)	(0,87)
Swaptions - (653.087)			
(31. Dezember 2021: (3.645.519))			
(4.800.000)	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.900	(3.688)	(0,00)
(92.200.000)	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.900	(70.841)	(0,02)
(2.200.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 15-Feb-2023 0.900	(6.004)	(0,00)
(41.500.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 15-Feb-2023 0.900	(113.262)	(0,03)
(42.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 18-Jan-2023 0.850	(34.846)	(0,01)
(2.200.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Call 18-Jan-2023 0.850	(1.808)	(0,00)
(41.500.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 15-Feb-2023 0.900	(173.867)	(0,05)
(2.200.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 15-Feb-2023 0.900	(9.217)	(0,00)
(42.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.850	(166.748)	(0,04)
(2.200.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 0.850	(8.652)	(0,00)
(83.000.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 1,025	(60.924)	(0,02)
(4.400.000)	iTraxx Europe Index Series 38 Put 18-Jan-2023 1,025	(3.230)	(0,00)
Swaptions insgesamt		(653.087)	(0,17)
Offene Terminkontrakte - (1.212.847)			
(31. Dezember 2021: (160.987))			
81	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	7.331.278	(96.168)
14	Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.026.748	(379.917)
14	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.102.665	(63.512)
36	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	4.042.688	(31.827)
232	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023	27.441.250	(316.890)
189	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	23.689.969	(202.588)
21	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.820.562	(121.945)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(1.212.847)	(0,32)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.921.723) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (4.236.892))		(1.921.723)	(0,50)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(7.161.044)	(1,86)
Nettoumlaufvermögen		14.458.359	3,75
Summe Nettovermögen		384.749.177	100,00

-Ein Teil der Beteiligung wird von Citigroup Global Markets Limited als Sicherheit gehalten.
Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC,
BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse, Goldman Sachs, J.P. Morgan Securities
Plc und Morgan Stanley.
Der Kontrahent für Zinsswaps ist Citigroup Global Markets Limited.
Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Citigroup Global Markets Limited.
Der Kontrahent für Swaptions ist Citigroup Global Markets Limited.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	93,55
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,56
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,47
Sonstiges Umlaufvermögen	4,42
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte													
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)							
BNY Mellon Global Credit Fund													
Chinesischer Yuan	US-Dollar	15.000	2.143	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	26	US-Dollar	Kolumbianischer Peso	59.304	286.000.000	18. Jan. 23	BNP Paribas	486
Euro	US-Dollar	5.863.000	6.241.678	10. Jan. 23	Morgan Stanley	37.570	US-Dollar	Indische Rupie	567.756	46.979.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	397
Euro	US-Dollar	190.000	202.029	10. Jan. 23	Morgan Stanley	1.460	US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	1.466.000	2.296.484	18. Jan. 23	Morgan Stanley	7.617
Euro	US-Dollar	45.000	48.096	10. Jan. 23	Morgan Stanley	99	US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	195.928	301.066	18. Jan. 23	Morgan Stanley	4.736
Euro	US-Dollar	6.000.000	6.379.870	10. Jan. 23	Morgan Stanley	46.104	US-Dollar	Norwegische Krone	40.473	394.603	18. Jan. 23	Morgan Stanley	168
Euro	US-Dollar	8.000.000	8.516.385	10. Jan. 23	Morgan Stanley	51.580	US-Dollar	Pfund Sterling	4.424.977	3.556.760	18. Jan. 23	Morgan Stanley	123.171
Euro	US-Dollar	370.000	393.883	10. Jan. 23	Morgan Stanley	2.386	US-Dollar	Schwedische Krone	383.213	3.893.873	18. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	9.708
Euro	US-Dollar	63.000	66.966	10. Jan. 23	Morgan Stanley	507	US-Dollar	Taiwan-Dollar	438.314	13.362.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	2.877
Euro	US-Dollar	650.000	691.982	10. Jan. 23	Morgan Stanley	4.165	Devisenterminkontrakte Forts.						
Euro	US-Dollar	182.000	193.781	10. Jan. 23	Morgan Stanley	1.140	Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Euro	US-Dollar	948.000	1.010.016	10. Jan. 23	Morgan Stanley	5.288	BNY Mellon Global Credit Fund Forts.						
Euro	US-Dollar	83.000	87.635	10. Jan. 23	Morgan Stanley	1.257	US-Dollar	Taiwan-Dollar	1.412.486	43.215.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	4.208
Euro	US-Dollar	245.000	260.634	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	1.760	USD 1.019.551						
Euro	US-Dollar	1.632.000	1.744.275	10. Jan. 23	Morgan Stanley	3.590	Kanadischer Dollar	US-Dollar	59.000	43.979	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(402)
Euro	US-Dollar	1.267.000	1.337.761	10. Jan. 23	Morgan Stanley	19.190	Kanadischer Dollar	US-Dollar	395.000	291.824	10. Jan. 23	UBS AG	(86)
Euro	US-Dollar	1.764.000	1.875.050	10. Jan. 23	Morgan Stanley	14.186	Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	28.000	17.951	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(172)
Japanischer Yen	US-Dollar	650.000	4.932	10. Jan. 23	Morgan Stanley	26	Norwegische Krone	Euro	112.000	10.912	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(251)
Pfund Sterling	US-Dollar	145.000	175.295	10. Jan. 23	Morgan Stanley	39	Pfund Sterling	US-Dollar	294.000	358.590	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.087)
Pfund Sterling	US-Dollar	297.000	357.577	10. Jan. 23	Morgan Stanley	1.554	Schweizer Franken	Euro	24.000	24.430	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(188)
Pfund Sterling	US-Dollar	6.000	7.227	10. Jan. 23	Morgan Stanley	28	US-Dollar	Australischer Dollar	15.630	23.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(35)
US-Dollar	Australischer Dollar	5.404.036	7.912.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	15.489	US-Dollar	Kanadischer Dollar	47.737	65.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(271)
US-Dollar	Australischer Dollar	321.018	470.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	920	US-Dollar	Kanadischer Dollar	7.379	10.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(7)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	321.267	431.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	2.940	US-Dollar	Kanadischer Dollar	225.270	307.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(1.473)
US-Dollar	Japanischer Yen	76.313	10.000.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	42	US-Dollar	Kanadischer Dollar	25.683	35.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(168)
US-Dollar	Pfund Sterling	190.668	156.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	2.034	US-Dollar	Kanadischer Dollar	47.696	65.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(311)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.237.485	1.802.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	58.517	US-Dollar	Euro	196.895	185.000	10. Jan. 23	Lloyds Bank plc	(1.239)
US-Dollar	Pfund Sterling	108.025	87.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	2.825	US-Dollar	Euro	115.067	110.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(2.743)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.667	3.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	39	US-Dollar	Euro	1.811.440	1.709.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(18.892)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.062.870	1.679.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	32.633	US-Dollar	Euro	1.811.180	1.709.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(19.151)
US-Dollar	Pfund Sterling	28.123.345	22.890.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	444.891	US-Dollar	Euro	1.811.489	1.709.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(18.843)
US-Dollar	Pfund Sterling	59.856	49.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	605	US-Dollar	Euro	375.773.316	35.450.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(389.480)
US-Dollar	Pfund Sterling	307.174.000	61.597	11. Jan. 23	BNP Paribas	1.664	US-Dollar	Euro	342.404	323.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.528)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	307.174.000	61.597	11. Jan. 23	BNP Paribas	1.664	US-Dollar	Euro	19.081	18.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(197)
Euro	US-Dollar	688.145	708.870	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	28.184	US-Dollar	Euro	1.812.615	1.710.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(18.787)
Japanischer Yen	US-Dollar	27.303.553	194.057	11. Jan. 23	Morgan Stanley	14.218	US-Dollar	Euro	37.568.474	35.449.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(392.250)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	386.701	236.415	11. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	9.132	US-Dollar	Euro	37.573.856	35.449.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(391.869)
Norwegische Krone	US-Dollar	244.084	23.816	11. Jan. 23	Goldman Sachs	1.108	US-Dollar	Euro	79.011	75.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(1.313)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	68.000	3.908	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	91	US-Dollar	Euro	510.901	483.000	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	(6.389)
Schweizerische Krone	US-Dollar	2.827.282	265.312	11. Jan. 23	Goldman Sachs	5.768	US-Dollar	Euro	63.858	60.000	10. Jan. 23	Lloyds Bank plc	(402)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	631.478	848.626	11. Jan. 23	Morgan Stanley	4.699	US-Dollar	Euro	37.574.880	35.449.000	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	(390.845)
US-Dollar	Indische Rupie	59.417	4.873.000	11. Jan. 23	UBS AG	542	US-Dollar	Japanischer Yen	290.932	38.864.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(5.487)
Chilenischer Peso	US-Dollar	61.000.000	71.299	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	512	US-Dollar	Japanischer Yen	13.707	1.831.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(258)
Chinesischer Yuan	US-Dollar	4.363.370	629.303	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	1.961	US-Dollar	Japanischer Yen	290.968	38.864.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(5.451)
Tschechische Krone	Euro	15.742.169	648.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	1.501	US-Dollar	Japanischer Yen	13.701	1.830.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(257)
Tschechische Krone	US-Dollar	31.813.672	1.393.023	18. Jan. 23	Goldman Sachs	13.356	US-Dollar	Australischer Dollar	29.750	44.882	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(819)
Euro	Schweizer Franken	686.000	674.365	18. Jan. 23	Morgan Stanley	4.523	US-Dollar	Brasilianischer Real	18.636	101.000	11. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(462)
Indonesische Rupiah	US-Dollar	946.851.000	60.938	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	53	US-Dollar	Chilenischer Peso	71.259	67.774.000	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	(8.580)
Koreanischer Won	US-Dollar	955.507.000	740.129	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	17.269	US-Dollar	Indonesische Rupiah	48.665	767.156.000	11. Jan. 23	BNP Paribas	(687)
Koreanischer Won	US-Dollar	380.387.000	294.429	18. Jan. 23	Goldman Sachs	7.091	US-Dollar	Mexikanischer Peso	30.821	604.000	11. Jan. 23	Goldman Sachs	(125)
Polnischer Zloty	US-Dollar	110.759	25.030	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	216	US-Dollar	Pfund Sterling	67.994	57.435	11. Jan. 23	HSBC Bank plc	(1.458)
Pfund Sterling	US-Dollar	240.108	289.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	1.405	US-Dollar	Schweizer Franken	366.211	348.233	11. Jan. 23	Morgan Stanley	(10.754)
							Australischer Dollar	US-Dollar	510.795	352.355	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(4.351)
							Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.223.289	903.800	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(270)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Euro	Tschechische Krone	1.302.000	31.662.153	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(4.433)	
Indische Rupie	US-Dollar	51.711.000	626.117	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(1.610)	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	2.295.701	1.466.000	18. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(8.115)	
Schweizer Franken	Euro	677.499	686.000	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(1.127)	
Schweizer Franken	Euro	674.381	683.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(1.291)	
Schweizer Franken	US-Dollar	893.776	971.553	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.236)	
Taiwan-Dollar	US-Dollar	13.362.000	440.510	18. Jan. 23	Goldman Sachs	(5.073)	
Taiwan-Dollar	US-Dollar	21.608.000	707.531	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(3.376)	
Taiwan-Dollar	US-Dollar	21.607.000	706.573	18. Jan. 23	Goldman Sachs	(2.450)	
US-Dollar	Australischer Dollar	287.000	423.795	18. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(1.732)	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	358.000	2.491.949	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(2.519)	
US-Dollar	Euro	11.255.674	10.539.095	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(38.215)	
US-Dollar	Euro	883.000	829.263	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(5.654)	
US-Dollar	Japanischer Yen	1.113.299	149.685.515	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(29.637)	
US-Dollar	Koreanischer Won	291.820	380.387.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(9.700)	
US-Dollar	Koreanischer Won	289.477	372.123.000	18. Jan. 23	HSBC Bank plc	(5.492)	
US-Dollar	Koreanischer Won	730.287	955.507.000	18. Jan. 23	Morgan Stanley	(27.111)	

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Credit Fund Forts.

US-Dollar	Brasilianischer Real	761.399	4.158.000	2. Feb. 23	HSBC Bank plc	(21.291)
						USD (1.878.400)

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)

Kanadischer Dollar	US-Dollar	331.512.569	243.410.067	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.441.465
						USD 1.441.465
						CAD 1.951.744
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.952.741	2.646.457	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.903)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.513.965	2.062.562	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.421)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.743.640	2.373.882	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.683)
						USD (21.007)
						CAD (28.443)

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	10.617	11.415	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	81
US-Dollar	Schweizer Franken	104	96	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schweizer Franken	73	68	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schweizer Franken	94	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
						USD 81
						CHF 75

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	7.988	8.493	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63
Euro	US-Dollar	10.000	10.615	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	98
Euro	US-Dollar	20.000	21.254	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	170
Euro	US-Dollar	10.000	10.633	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	79

Euro	US-Dollar	9.986	10.599	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	98
Euro	US-Dollar	8.200	8.731	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	53
Euro	US-Dollar	14.590.093	15.435.740	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	193.594
						USD 194.155
						EUR 181.377
US-Dollar	Euro	130.729	122.764	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(780)
US-Dollar	Euro	92.848	87.413	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(790)
US-Dollar	Euro	12.731	11.973	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(95)
US-Dollar	Euro	842.092	792.549	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.909)
US-Dollar	Euro	123.880	116.292	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(696)
						USD (9.270)
						EUR (8.660)

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	24.190.000	176.292	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.284
Japanischer Yen	US-Dollar	7.510.000	55.724	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.580

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged) Forts.

Japanischer Yen	US-Dollar	14.360.000	106.306	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.265
Japanischer Yen	US-Dollar	3.550.000	26.078	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.009
Japanischer Yen	US-Dollar	3.326.378.705	24.485.405	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	895.736
						USD 909.874
						JPY 119.411.864
US-Dollar	Japanischer Yen	236.510	31.437.198	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.364)
US-Dollar	Japanischer Yen	146.433	19.304.285	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(864)
US-Dollar	Japanischer Yen	204.080	26.902.620	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.194)
						USD (5.422)
						JPY (711.583)

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

US-Dollar	Pfund Sterling	2.862	2.365	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	3.457	2.842	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20
						USD 22
						GBP 18
Pfund Sterling	US-Dollar	376.759	463.212	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.598)
US-Dollar	Pfund Sterling	3.750	3.116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.087	1.733	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)

						USD (7.624)
						GBP (6.306)

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Pfund Sterling - 5.104.833				
(31. Dezember 2021: 6.620.068)				
3.346.151	BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	5.104.833	1,48	
US-Dollar - 14.292.057				
(31. Dezember 2021: 13.148.875)				
782.114	Blackrock Global Funds - Asian High Yield Bond Fund	4.583.188	1,33	
96.673	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	9.708.869	2,81	
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		19.396.890	5,62	
Anleihen				
Australischer Dollar - 5.774.311				
(31. Dezember 2021: 11.217.279)				
9.991.000	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	3.944.641	1,14	
2.970.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Nov-2033	1.829.670	0,53	
Brasilianischer Real - 3.307.615				
(31. Dezember 2021: -)				
25.000.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0,000% 01-Jan-2026	3.307.615	0,96	
Kanadischer Dollar - 33.514.607				
(31. Dezember 2021: 28.568.852)				
11.720.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.534.481	2,47	
10.525.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4,648% 15-Mar-2027	7.750.191	2,25	
1.240.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4,648% 15-Mar-2027	913.086	0,27	
11.590.000	Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	8.452.807	2,45	
5.840.000	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	4.300.175	1,25	
3.958.358	Canadian Government Real Return Bond 4,000% 01-Dec-2031	3.563.867	1,03	
Kolumbianischer Peso - 4.308.503				
(31. Dezember 2021: 5.579.121)				
10.234.400.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000% 28-Apr-2028	1.580.491	0,46	
19.395.300.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7,000% 30-Jun-2032	2.728.012	0,79	
Dänische Krone - 4.430.909				
(31. Dezember 2021: -)				
39.160.000	Denmark Government Bond 0,000% 15-Nov-2031	4.430.909	1,28	
Euro - 31.388.510				
(31. Dezember 2021: 86.814.206)				
1.300.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6,250% 23-Dec-2171	1.294.953	0,38	
1.000.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5,250% 29-Dec-2171	1.021.534	0,30	
646.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3,500% 01-Mar-2025	649.024	0,19	
500.000	CA Immobilien Anlagen AG 0,875% 05-Feb-2027	423.275	0,12	
1.098.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500% 27-Jan-2028	904.332	0,26	
1.900.000	Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 1,625% 10-Aug-2025	1.931.481	0,56	
3.901.442	European Union 0,450% 04-Jul-2041	2.531.371	0,73	
1.500.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 1,744% 19-Jul-2024	1.534.694	0,45	
1.318.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2,625% 01-Feb-2027	751.566	0,22	
1.640.000	Indonesia Government International Bond 1,750% 24-Apr-2025	1.672.671	0,49	
800.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2,875% 01-Jan-2025	796.847	0,23	
1.110.000	IQVIA Inc 'REGS' 2,875% 15-Sep-2025	1.145.960	0,33	
942.000	Orsted AS 'EMTN' 3,250% 13-Sep-2031	964.618	0,28	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
3.930.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0,875% 08-Oct-2025	3.936.499	1,14	
1.655.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0,000% 07-Jul-2023	1.742.754	0,51	
996.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2,625% 14-Mar-2171	417.882	0,12	
840.000	SoftBank Group Corp 2,875% 06-Jan-2027	731.815	0,21	
2.690.000	Spain Government Bond '144A' 1,900% 31-Oct-2052	1.840.680	0,53	
2.471.000	Tritax EuroBox Plc 0,950% 02-Jun-2026	2.146.266	0,62	
1.260.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 03-Jun-2171	1.001.195	0,29	
1.760.000	Universal Music Group NV 'EMTN' 3,000% 30-Jun-2027	1.809.521	0,52	
2.400.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3,875% 17-Jun-2171 VAR	2.139.572	0,62	
Indische Rupie - 2.108.284				
(31. Dezember 2021: 3.117.921)				
176.790.000	International Finance Corp 'GMTN' 6,300% 25-Nov-2024	2.108.284	0,61	
Indonesische Rupiah - 5.145.871				
(31. Dezember 2021: 5.573.775)				
29.637.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15-Apr-2032	1.834.857	0,53	
50.996.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,500% 15-Jun-2025	3.311.014	0,96	
Mexikanischer neuer Peso - 8.673.532				
(31. Dezember 2021: 7.140.918)				
73.000.000	Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031	3.462.192	1,00	
40.000.000	Mexican Bonos 8,000% 07-Nov-2047	1.825.487	0,53	
68.000.000	Mexican Bonos 8,500% 31-May-2029	3.385.853	0,98	
Neuseeländischer Dollar - 24.527.989				
(31. Dezember 2021: 11.395.641)				
3.010.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3,360% 12-Jun-2025	1.823.741	0,53	
12.950.000	New Zealand Government Bond 0,500% 15-May-2024	7.726.919	2,24	
9.230.000	New Zealand Government Bond 2,750% 15-May-2051	4.211.714	1,22	
5.220.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3,000% 20-Sep-2030	4.276.963	1,24	
4.370.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2,250% 15-Apr-2024	2.662.366	0,77	
3.430.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3,500% 14-Apr-2033	1.861.206	0,54	
3.090.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5,500% 15-Apr-2023	1.965.080	0,57	
Peruanischer neuer Sol - 3.324.527				
(31. Dezember 2021: -)				
14.340.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,150% 12-Aug-2032	3.324.527	0,96	
Südafrikanischer Rand - 3.341.083				
(31. Dezember 2021: -)				
63.570.000	Republic of South Africa Government Bond 8,000% 31-Jan-2030	3.341.083	0,97	
Pfund Sterling - 32.112.974				
(31. Dezember 2021: 42.070.811)				
176.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1,625% 10-Aug-2025	195.066	0,06	
1.430.000	AT&T Inc 2,900% 04-Dec-2026	1.588.410	0,46	
917.000	Coventry Building Society 'EMTN' 1,000% 21-Sep-2025	983.544	0,28	
1.839.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6,875% 18-Sep-2171	2.104.449	0,61	
620.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,875% 28-Aug-2025	692.229	0,20	
4.400.000	Dexia Credit Local SA 0,500% 22-Jul-2023	5.192.440	1,50	
635.000	Heathrow Finance Plc 5,750% 03-Mar-2025	743.244	0,21	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Pfund Sterling Forts.			
792.000	Hiscox Ltd 6.000% 22-Sep-2027	950.519	0,28
1.068.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2171	1.170.047	0,34
1.490.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	1.657.214	0,48
492.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026	509.258	0,15
640.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 5.250% 15-Jan-2027	641.146	0,19
3.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	3.868.573	1,12
1.030.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Mar-2171	1.143.129	0,33
1.047.171	Mitchells & Butlers Finance Plc 6.013% 15-Dec-2028	1.175.128	0,34
1.940.000	National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023	2.283.929	0,66
545.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	547.636	0,16
743.000	Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2171	848.655	0,25
402.000	Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021	331.436	0,10
475.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	374.255	0,11
1.650.000	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	2.044.759	0,59
452.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078	511.541	0,15
2.120.000	Yorkshire Building Society FRN 3.871% 19-Nov-2023	2.556.367	0,74
US-Dollar - 144.272.375			
(31. Dezember 2021: 151.993.761)			
2.750.000	American Express Co 3.375% 03-May-2024	2.698.406	0,78
3.380.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 5.175% 27-Aug-2026	3.449.805	1,00
1.190.000	Bahamas Government International Bond 'REGS' 8.950% 15-Oct-2032	955.713	0,28
1.000.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 4.250% 25-Jan-2028	919.615	0,27
857.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	676.259	0,20
2.970.000	Bank of Montreal '144A' 3.750% 25-Jul-2025	2.890.424	0,84
4.250.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 5.048% 05-Aug-2026	4.297.013	1,25
2.102.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Feb-2171	2.081.489	0,60
1.310.000	Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028	1.059.148	0,31
440.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	371.560	0,11
690.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	661.876	0,19
2.099.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.214% 27-May-2025	2.020.437	0,59
1.050.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Mar-2171	758.598	0,22
998.000	Dollar General Corp 4.625% 01-Nov-2027	982.496	0,28
2.195.000	Drax Finco Plc 'REGS' 6.625% 01-Nov-2025	2.098.675	0,61
126.496	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	49.709	0,01
442.650	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.500% 31-Jul-2040	182.089	0,05
965.835	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2035	448.457	0,13
1.446.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Jan-2027	637.512	0,18
874.000	Ethiopia International Bond 'REGS' 6.625% 11-Dec-2024	549.458	0,16
4.850.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 3.978% 14-Apr-2026	4.857.839	1,41
783.000	GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS' 4.250% 27-Oct-2027	679.311	0,20
1.320.000	Greenland Global Investment Ltd 'EMTN' 6.125% 22-Apr-2025	514.549	0,15
2.746.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023	2.706.895	0,78
1.145.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	1.103.226	0,32
2.930.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2171	2.824.666	0,82
4.140.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 4.582% 20-Mar-2028	4.115.300	1,19
5.010.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.583% 19-Aug-2027	5.035.608	1,46
4.110.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.696% 17-Jun-2024	4.124.188	1,20

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
3.020.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	2.700.333	0,78
3.670.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	3.412.572	0,99
3.374.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 5.306% 17-Jun-2026	3.429.512	0,99
500.000	KWG Group Holdings Ltd 7.875% 30-Aug-2024	238.750	0,07
210.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 6.750% 27-Sep-2171	199.091	0,06
1.620.000	Lowe's Cos Inc 3.000% 15-Oct-2050	1.057.148	0,31
1.531.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS' 5.500% 28-Apr-2033	1.624.085	0,47
1.503.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' FRN 5.232% 21-Mar-2025	1.501.342	0,43
1.090.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027	880.291	0,25
722.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024	700.343	0,20
946.000	Mozambique International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.000% 15-Sep-2031	729.612	0,21
2.050.000	National Australia Bank Ltd/New York 3.500% 09-Jun-2025	1.992.258	0,58
1.824.000	Oman Government International Bond 'REGS' 4.875% 01-Feb-2025	1.795.637	0,52
1.480.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025	1.439.673	0,42
3.220.000	Republic of South Africa Government International Bond 4.850% 30-Sep-2029	2.887.896	0,84
856.000	Republic of Tajikistan International Bond 'REGS' 7.125% 14-Sep-2027	619.188	0,18
3.260.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 4.750% 20-Feb-2024	3.199.462	0,93
600.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 5.375% 20-Feb-2029	558.822	0,16
3.340.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' FRN 4.538% 27-Apr-2026	3.236.112	0,94
1.753.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	1.858.715	0,54
504.000	Shimao Group Holdings Ltd 0.000% 16-Sep-2023	98.280	0,03
1.560.000	Shimao Group Holdings Ltd (Defaulted) 0.000% 03-Jul-2022	304.200	0,09
1.895.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN' 3.000% 20-Jul-2026	1.761.260	0,51
1.039.000	Sunac China Holdings Ltd (Defaulted) 0.000% 14-Jun-2022	230.668	0,07
3.990.000	Svensk Exportkredit AB 'GMTN' FRN 4.996% 03-Aug-2026	4.043.232	1,17
600.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	562.860	0,16
606.000	Tunisian Republic 'REGS' 5.750% 30-Jan-2025	422.946	0,12
6.730.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	6.727.462	1,95
5.980.000	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.435% 31-Jul-2024	5.971.189	1,73
6.980.799	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	6.907.827	2,00
4.897.764	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	5.206.341	1,51
9.674.900	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	9.063.038	2,63
4.120.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	3.523.405	1,02
6.019.500	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	5.008.882	1,45
2.508.000	Verizon Communications Inc FRN 5.113% 20-Mar-2026	2.446.337	0,71
236.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	233.404	0,07
790.000	Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081	660.645	0,19
1.117.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	658.645	0,19
2.750.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 3.788% 15-Mar-2025	2.630.591	0,76
Gesamtanlagen in Anleihen		306.231.090	88,76

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 1.167.528				
(31. Dezember 2021: 410.313)				
(65)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(7.592.757)	525.836	0,15
(350)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(39.411.789)	445.977	0,13
(44)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(5.279.684)	195.715	0,06
Offene Terminkontrakte insgesamt			1.167.528	0,34
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.092.971 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 5.430.962)				
			4.092.971	1,18
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			330.888.479	95,90
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (8.388.906) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (1.874.889))				
			(8.388.906)	(2,43)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(8.388.906)	(2,43)
Nettoumlaufvermögen			22.501.489	6,53
Summe Nettovermögen			345.001.062	100,00

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	92,01
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,33
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,16
Sonstiges Umlaufvermögen	6,50
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund								
Australischer Dollar	US-Dollar	1.012.855	681.558	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		8.374	
Brasilianischer Real	US-Dollar	5.554.151	1.013.901	15. Feb. 23	State Street Bank		29.110	
Tschechische Krone	US-Dollar	14.990.168	648.334	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC		12.867	
Dänische Krone	US-Dollar	2.192.626	314.703	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank		1.172	
Dänische Krone	US-Dollar	4.390.520	626.854	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		5.654	
Euro	US-Dollar	2.655.735	2.830.828	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC		13.200	
Euro	US-Dollar	2.237.521	2.390.526	15. Feb. 23	State Street Bank		5.637	
Euro	US-Dollar	523.565	560.215	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon		471	
Euro	US-Dollar	781.363	828.642	15. Feb. 23	State Street Bank		8.120	
Euro	US-Dollar	932.912	984.085	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		14.971	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	6.631.448.158	425.093	15. Feb. 23	State Street Bank		4.313	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	29.425.768.327	1.878.920	15. Feb. 23	State Street Bank		26.487	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	82.534.170.000	5.264.330	15. Feb. 23	State Street Bank		80.005	
Japanischer Yen	US-Dollar	495.053.858	3.425.248	15. Feb. 23	State Street Bank		354.425	
Japanischer Yen	US-Dollar	270.875.352	2.012.535	15. Feb. 23	UBS AG		55.564	
Koreanischer Won	US-Dollar	686.301.257	527.766	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited		19.866	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	4.907.021	244.417	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited		4.353	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	110.380.816	5.517.311	15. Feb. 23	State Street Bank		78.639	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	690.898	436.184	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		2.632	
Polnischer Zloty	US-Dollar	3.430.393	764.713	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank		14.155	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	5.845.761	332.415	15. Feb. 23	HSBC Bank plc		11.474	
Pfund Sterling	US-Dollar	346.575	417.364	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC		357	
Schwedische Krone	US-Dollar	52.558.659	4.885.906	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank		192.313	
Schwedische Krone	US-Dollar	10.515.382	977.499	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank		38.498	
US-Dollar	Brasilianischer Real	1.760.033	9.310.928	15. Feb. 23	UBS AG		11.539	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	360.775	481.695	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		4.501	
US-Dollar	Kanadischer Dollar	36.014.268	48.504.520	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		139.156	
US-Dollar	Indische Rupie	2.187.788	180.328.426	15. Feb. 23	State Street Bank		9.994	
US-Dollar	Pfund Sterling	1.137.623	918.447	15. Feb. 23	UBS AG		30.636	
US-Dollar	Pfund Sterling	5.971.976	4.907.008	15. Feb. 23	State Street Bank		57.651	
US-Dollar	Schwedische Krone	404.576	4.161.126	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		2.528	
							USD	1.238.662
Kanadischer Dollar	US-Dollar	2.966.661	2.234.452	15. Feb. 23	State Street Bank		(40.238)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	261.215.201	303.880	15. Feb. 23	State Street Bank		(716)	
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.218.395	782.229	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		(8.380)	
US-Dollar	Australischer Dollar	5.949.969	9.160.690	15. Feb. 23	State Street Bank		(290.071)	
US-Dollar	Australischer Dollar	589.072	876.698	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		(8.113)	
US-Dollar	Chilenischer Peso	2.705.138	2.487.320.000	15. Feb. 23	State Street Bank		(181.624)	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	4.689.639	23.977.891.176	15. Feb. 23	State Street Bank		(214.391)	
US-Dollar	Tschechische Krone	5.457.771	133.567.090	15. Feb. 23	UBS AG		(433.743)	
US-Dollar	Dänische Krone	5.082.004	374.875.548	15. Feb. 23	UBS AG		(318.536)	
US-Dollar	Euro	902.420	889.867	15. Feb. 23	HSBC Bank plc		(50.539)	
US-Dollar	Euro	29.772.951	29.548.384	15. Feb. 23	State Street Bank		(1.870.427)	
US-Dollar	Euro	2.491.962	2.398.609	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank		(76.710)	
US-Dollar	Euro	318.736	300.890	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		(3.487)	
US-Dollar	Euro	416.945	400.437	15. Feb. 23	State Street Bank		(11.883)	
US-Dollar	Euro	614.718	612.423	15. Feb. 23	State Street Bank		(41.127)	
US-Dollar	Euro	891.771	843.816	15. Feb. 23	UBS AG		(11.872)	
US-Dollar	Euro	939.260	886.937	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland		(10.561)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.696.628	89.659.223.694	15. Feb. 23	State Street Bank		(109.076)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	954.919	14.896.385.708	15. Feb. 23	HSBC Bank plc		(9.666)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	884.779	13.882.175.264	15. Feb. 23	State Street Bank		(14.134)	
US-Dollar	Japanischer Yen	543.295	73.555.774	15. Feb. 23	State Street Bank		(18.294)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.							
US-Dollar	Japanischer Yen	2.468.459	335.567.682	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(83.557)	
US-Dollar	Koreanischer Won	5.397.802	7.417.930.000	15. Feb. 23	State Street Bank	(521.313)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	5.433.755	10.751.933,8	15. Feb. 23	State Street Bank	(17.128)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.950.155	38.671.844	15. Feb. 23	State Street Bank	(10.382)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	54.248,5	10.875.210	15. Feb. 23	State Street Bank	(8.853)	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.516.612	30.274.441	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(18.205)	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	1.733.779	2.958.258	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(145.123)	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	21.752.336	36.622.251	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(1.507.843)	
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	817.577	1.311.007	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(15.093)	
US-Dollar	Polnischer Zloty	5.551.695	26.382.035	15. Feb. 23	UBS AG	(438.321)	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	3.542.998	63.741.134	15. Feb. 23	State Street Bank	(206.703)	
US-Dollar	Pfund Sterling	1.666.280	1.454.472	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(86.767)	
US-Dollar	Pfund Sterling	5.291.617	4.440.000	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(59.832)	
US-Dollar	Pfund Sterling	27.459.195	23.857.417	15. Feb. 23	State Street Bank	(1.295.701)	
US-Dollar	Pfund Sterling	365.266	306.926	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	(4.666)	
US-Dollar	Pfund Sterling	497.075	433.666	15. Feb. 23	State Street Bank	(25.614)	
US-Dollar	Schwedische Krone	277.933	2.976.908	15. Feb. 23	State Street Bank	(9.695)	
						USD	(8.188.384)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)

Euro	US-Dollar	6.438	6.851	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27	
Euro	US-Dollar	14.997	15.991	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	32	
Euro	US-Dollar	2.148.385	2.272.790	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22.612	
						USD	22.671
						EUR	21.234
US-Dollar	Euro	6.847	6.438	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)	
US-Dollar	Euro	14.560	13.694	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71)	
US-Dollar	Euro	35.501	33.313	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(91)	
						USD	(188)
						EUR	(176)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	266.468	281.898	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.805	
						USD	2.805
						EUR	2.627
US-Dollar	Euro	1.833	1.724	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
						USD	(9)
						EUR	(8)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)

Euro	US-Dollar	3.908	4.158	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15	
Euro	US-Dollar	6.330.467	6.697.042	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	66.628	
						USD	66.643
						EUR	62.420
US-Dollar	Euro	4.161	3.908	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)	

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	41.570	39.097	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(202)	
US-Dollar	Euro	318	299	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	9.572	8.977	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)	
US-Dollar	Euro	9.850	9.242	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)	
US-Dollar	Euro	19.823	18.731	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(190)	
						USD	(453)
						EUR	(424)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	12.698	13.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10	
Euro	US-Dollar	1.171.371	1.239.201	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12.329	
						USD	12.339
						EUR	11.557
US-Dollar	Euro	7.843	7.376	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(38)	
						USD	(38)
						EUR	(36)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged)

Euro	US-Dollar	26.119	27.835	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	72	
Euro	US-Dollar	33.781	35.952	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	140	
Euro	US-Dollar	36.336.798	38.440.930	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	382.447	
						USD	382.659
						EUR	358.412
US-Dollar	Euro	233.768	219.860	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.138)	
US-Dollar	Euro	131.978	124.199	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(720)	
US-Dollar	Euro	187.793	175.900	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(144)	
						USD	(2.002)
						EUR	(1.875)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	11.737	12.491	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	49	
Euro	US-Dollar	937	993	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	2.307.868	2.441.509	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	24.290	
						USD	24.348
						EUR	22.805
US-Dollar	Euro	14.822	13.940	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(72)	
US-Dollar	Euro	1.806	1.699	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	26.306	24.640	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(20)
					USD	(101)
					EUR	(95)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	1.878.385.094	13.836.939	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	440.257
					USD	440.257
					JPY	58.003.860
US-Dollar	Japanischer Yen	91.847	12.309.185	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.713)
					USD	(1.713)
					JPY	(225.688)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Inc) (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	7.941.940.154	58.503.520	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.861.435
US-Dollar	Japanischer Yen	20.993	2.758.820	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
					USD	1.861.458
					JPY	245.247.092
US-Dollar	Japanischer Yen	388.288	52.037.791	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.240)
					USD	(7.240)
					JPY	(953.870)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse SGD I (Acc) (Hedged)

Singapur-Dollar	US-Dollar	7.020.810	5.201.574	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	37.870
					USD	37.870
					SGD	50.755
US-Dollar	Singapur-Dollar	26.108	35.233	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(185)
					USD	(185)
					SGD	(248)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	147.576	177.531	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	187
Pfund Sterling	US-Dollar	40	48	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	4	5	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	5	4	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	57.838	47.419	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	734
US-Dollar	Pfund Sterling	673	551	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9
US-Dollar	Pfund Sterling	2.298	1.856	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63
US-Dollar	Pfund Sterling	2.334	1.897	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	50
US-Dollar	Pfund Sterling	97.206	79.092	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.960

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	13.302	10.833	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	256
					USD	3.259
					GBP	2.707
US-Dollar	Pfund Sterling	177.487	147.576	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(186)
Pfund Sterling	US-Dollar	60	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	35.370	43.430	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(836)
Pfund Sterling	US-Dollar	6.694.291	8.248.543	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(186.979)
US-Dollar	Pfund Sterling	42.609	35.399	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
					USD	(188.021)
					GBP	(156.176)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	65	54	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	-
					GBP	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.232	12.608	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(286)
					USD	(286)
					GBP	(238)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	65	54	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	-
					GBP	-
Pfund Sterling	US-Dollar	10.235	12.612	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(286)
					USD	(286)
					GBP	(238)

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Argentinien - 869.370			
(31. Dezember 2021: 2.751.785)			
3.035	Globant SA	511.716	1,45
413	MercadoLibre Inc	357.654	1,01
Australien - 279.747			
(31. Dezember 2021: -)			
14.749	OZ Minerals Ltd	279.747	0,79
Brasilien - 2.389.384			
(31. Dezember 2021: 590.098)			
263.907	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	660.548	1,87
124.834	Raia Drogasil SA	560.952	1,59
102.285	WEG SA	746.251	2,11
27.639	XP Inc	421.633	1,19
China - 11.670.386			
(31. Dezember 2021: 18.389.535)			
328.400	By-health Co Ltd	1.078.731	3,05
80.757	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	924.529	2,62
146.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	313.384	0,89
88.672	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	539.109	1,53
50.169	Meituan '144A'	1.124.171	3,18
157.020	NARI Technology Co Ltd 'A'	551.243	1,56
30.900	NetEase Inc	453.736	1,28
110.850	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	771.905	2,18
128.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	849.042	2,40
106.500	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	1.065.429	3,02
8.600	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	407.386	1,15
20.500	Sungrow Power Supply Co Ltd	329.704	0,93
38.248	Tencent Holdings Ltd	1.639.508	4,64
70.800	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	409.979	1,16
21.693	Yum China Holdings Inc	1.212.530	3,43
Hongkong - 1.679.087			
(31. Dezember 2021: 1.911.597)			
150.600	AIA Group Ltd	1.679.087	4,75
Indien - 8.887.186			
(31. Dezember 2021: 13.962.309)			
7.342	Asian Paints Ltd	273.872	0,77
67.016	FSN E-Commerce Ventures Ltd	125.640	0,36
45.352	Godrej Consumer Products Ltd	479.463	1,36
70.435	HDFC Bank Ltd	1.388.181	3,93
54.921	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	375.860	1,06
28.118	Hindustan Unilever Ltd	871.325	2,46
21.641	Housing Development Finance Corp Ltd	691.241	1,96
34.181	ICICI Bank Ltd	368.769	1,04
23.581	Info Edge India Ltd	1.115.323	3,15
113.622	Marico Ltd	700.060	1,98
4.016	Maruti Suzuki India Ltd	408.424	1,16
42.299	PB Fintech Ltd	228.930	0,65
34.316	Tata Consultancy Services Ltd	1.349.868	3,82
16.260	Titan Co Ltd	510.230	1,44
Indonesien - 537.618			
(31. Dezember 2021: -)			
842.200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	537.618	1,52
Japan - 785.708			
(31. Dezember 2021: 1.240.358)			
12.200	Advantest Corp	785.708	2,22
Mexiko - 945.891			
(31. Dezember 2021: 876.155)			
264.444	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	945.891	2,68
Niederlande - 1.056.904			
(31. Dezember 2021: 1.430.921)			
1.942	ASML Holding NV	1.056.904	2,99

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Peru - 471.825			
(31. Dezember 2021: -)			
3.483	Credicorp Ltd	471.825	1,33
Republik Korea - 1.408.152			
(31. Dezember 2021: 2.966.900)			
1.799	Samsung SDI Co Ltd	842.948	2,38
9.523	SK Hynix Inc	565.204	1,60
Russland - -			
(31. Dezember 2021: 870.050)			
15.766	HeadHunter Group Plc ADR*	-	-
Singapur - 336.717			
(31. Dezember 2021: -)			
6.376	Sea Ltd ADR	336.717	0,95
Südafrika - 425.930			
(31. Dezember 2021: 595.960)			
26.743	Clicks Group Ltd	425.930	1,21
Taiwan - 2.281.775			
(31. Dezember 2021: 3.539.433)			
38.000	Delta Electronics Inc	354.525	1,01
132.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.927.250	5,45
Vereinigte Staaten von Amerika - 324.802			
(31. Dezember 2021: 2.849.029)			
16.400	Livent Corp	324.802	0,92
Gesamtanlagen in Aktien		34.350.482	97,18
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 6.967 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 2.329)		6.967	0,02
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		34.357.449	97,20
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (257) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (255))		(257)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(257)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		988.802	2,80
Summe Nettovermögen		35.345.994	100,00
* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss. ^ Unterliegt der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts durch die Verwaltungsgesellschaft.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,99	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,02	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,99	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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	3.554	3.780	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	3.357	3.570	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	2.467	2.616	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	2.292	2.448	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	8.012	8.464	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	96
Euro	US-Dollar	367.339	388.611	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.866
					USD	4.015
					EUR	3.761
US-Dollar	Euro	3.782	3.554	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	4.208	3.955	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Euro	8.236	7.751	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(45)
US-Dollar	Euro	3.048	2.860	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	4.623	4.350	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Euro	3.579	3.357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	7.092	6.643	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	4.621	4.371	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(50)
					USD	(175)
					EUR	(164)
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	2.622	2.788	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	1.915	2.030	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	1.694	1.810	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	277.642	293.719	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.922
					USD	2.952
					EUR	2.765
US-Dollar	Euro	3.231	3.037	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	2.264	2.124	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	3.473	3.268	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Euro	2.684	2.518	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	3.468	3.281	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)
					USD	(82)
					EUR	(77)

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND**

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
China - 10.560.330			
(31. Dezember 2021: 9.597.381)			
386.436	Alibaba Group Holding Ltd	4.278.749	1,09
947.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	6.281.581	1,60
Dänemark - 3.510.619			
(31. Dezember 2021: 6.457.303)			
69.457	Novozymes A/S	3.510.619	0,89
Frankreich - 21.395.841			
(31. Dezember 2021: 9.829.857)			
12.689	L'Oreal SA	4.564.125	1,16
5.682	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	4.182.170	1,06
81.481	Sanofi	7.878.978	2,01
205.344	SCOR SE	4.770.568	1,21
Deutschland - 13.559.243			
(31. Dezember 2021: 27.095.077)			
55.290	Bayer AG	2.881.274	0,73
70.475	Deutsche Post AG	2.661.709	0,68
43.834	SAP SE	4.514.504	1,15
28.265	Volkswagen AG - Preference	3.501.756	0,89
Hongkong - 10.727.872			
(31. Dezember 2021: 9.344.239)			
962.200	AIA Group Ltd	10.727.872	2,73
Indien - 4.990.576			
(31. Dezember 2021: 4.858.119)			
253.217	HDFC Bank Ltd	4.990.576	1,27
Indonesien - 3.730.448			
(31. Dezember 2021: -)			
5.843.900	Bank Mandiri Persero Tbk PT	3.730.448	0,95
Japan - 13.557.241			
(31. Dezember 2021: 30.805.605)			
128.400	Ebara Corp	4.602.421	1,17
64.300	Sony Group Corp	4.902.418	1,25
90.800	Sugi Holdings Co Ltd	4.052.402	1,03
Niederlande - 30.124.781			
(31. Dezember 2021: 29.642.398)			
217.439	Relx Plc	6.018.460	1,53
265.134	Shell Plc	7.513.398	1,91
389.071	Universal Music Group NV	9.406.549	2,40
68.176	Wolters Kluwer NV	7.186.374	1,83
Republik Korea - 8.332.485			
(31. Dezember 2021: 10.067.267)			
17.783	Samsung SDI Co Ltd	8.332.485	2,12
Schweden - 6.404.199			
(31. Dezember 2021: 8.247.164)			
373.112	Swedbank AB	6.404.199	1,63
Schweiz - 28.903.539			
(31. Dezember 2021: 22.483.144)			
8.631	Lonza Group AG	4.289.306	1,09
55.618	Nestle SA	6.493.188	1,65
95.173	Novartis AG	8.702.872	2,21
29.694	Roche Holding AG	9.418.173	2,40
Taiwan - 3.662.933			
(31. Dezember 2021: 10.057.655)			
48.206	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.662.933	0,93
Vereinigtes Königreich - 27.371.292			
(31. Dezember 2021: 42.158.906)			
56.986	AstraZeneca Plc	7.715.375	1,96
3.151.687	Barclays Plc	6.034.486	1,54
216.481	Diageo Plc	9.517.254	2,42

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
199.244	SSE Plc	4.104.177	1,04
Vereinigte Staaten von Amerika - 194.643.250			
(31. Dezember 2021: 276.734.432)			
61.808	Abbott Laboratories	6.818.968	1,73
11.806	Accenture Plc - Class A	3.168.553	0,81
20.158	Albemarle Corp	4.385.071	1,11
140.746	Alphabet Inc - Class A	12.446.169	3,17
113.056	Altria Group Inc	5.184.183	1,32
119.303	Amazon.com Inc	10.038.154	2,55
121.941	Apple Inc	15.801.725	4,02
69.538	Applied Materials Inc	6.753.531	1,72
1.185	Chubb Ltd	263.159	0,07
24.986	Chubb Ltd	5.548.766	1,41
32.031	CME Group Inc	5.417.083	1,38
25.037	Cooper Cos Inc/The	8.373.374	2,13
60.454	Darling Ingredients Inc	3.761.750	0,96
24.964	Dollar General Corp	6.192.445	1,57
19.339	Eli Lilly & Co	7.097.703	1,80
232.375	Exelon Corp	10.020.010	2,55
1.715	General Electric Co	143.623	0,04
83.575	General Electric Co	6.998.988	1,78
23.016	Goldman Sachs Group Inc/The	7.901.508	2,01
15.837	Hubbell Inc - Class B	3.728.742	0,95
67.806	JPMorgan Chase & Co	9.032.776	2,30
28.856	Mastercard Inc	10.048.813	2,56
5.347	Medtronic Plc	416.130	0,10
41.829	Medtronic Plc	3.255.342	0,83
82.842	Microsoft Corp	19.963.679	5,08
39.739	Norfolk Southern Corp	9.864.611	2,51
42.706	Progressive Corp/The	5.575.909	1,42
37.818	Trane Technologies Plc	6.442.485	1,64
Gesamtanlagen in Aktien		381.474.649	97,05
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 321.530 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.152)		321.530	0,08
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		381.796.179	97,13
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.198.028) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (92))		(1.198.028)	(0,30)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(1.198.028)	(0,30)
Nettoumlaufvermögen		12.486.988	3,17
Summe Nettovermögen		393.085.139	100,00

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,61
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,08
Sonstiges Umlaufvermögen	3,31
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Global Equity Fund							
Euro	US-Dollar	20.406.452	21.535.643	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank		317.637
						USD	317.637
US-Dollar	Euro	20.655.370	20.406.452	15. Feb. 23	State Street Bank		(1.197.910)
						USD	(1.197.910)
BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
Euro	US-Dollar	4.697	4.980	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		38
Euro	US-Dollar	3.392	3.623	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	3.119	3.325	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		8
Euro	US-Dollar	365.422	386.582	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3.846
						USD	3.893
						EUR	3.646
US-Dollar	Euro	2.888	2.705	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3)
US-Dollar	Euro	4.273	4.017	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(18)
US-Dollar	Euro	2.372	2.226	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(6)
US-Dollar	Euro	2.466	2.317	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(10)
US-Dollar	Euro	8.929	8.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(48)
US-Dollar	Euro	3.140	2.946	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(7)
US-Dollar	Euro	2.409	2.279	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(26)
						USD	(118)
						EUR	(111)

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 4.752.378			
(31. Dezember 2021: 3.774.322)			
1.469.885	Insurance Australia Group Ltd	4.752.378	0,89
Bermudas - 4.933.229			
(31. Dezember 2021: 4.311.089)			
36.417	Credicorp Ltd	4.933.229	0,92
China - 7.130.623			
(31. Dezember 2021: 4.995.590)			
1.075.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	7.130.623	1,33
Frankreich - 18.854.219			
(31. Dezember 2021: 15.315.030)			
150.683	Sanofi	14.570.612	2,72
67.888	TotalEnergies SE	4.283.607	0,80
Deutschland - 54.364.208			
(31. Dezember 2021: 30.741.852)			
203.676	Bayer AG	10.613.969	1,98
93.015	Continental AG	5.573.138	1,04
266.657	Deutsche Post AG	10.071.139	1,88
126.378	Mercedes-Benz Group AG	8.289.949	1,55
45.917	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	14.920.245	2,79
39.517	Volkswagen AG - Preference	4.895.768	0,91
Hongkong - 5.476.397			
(31. Dezember 2021: 4.748.028)			
745.249	Link REIT (Units) (REIT)	5.476.397	1,02
Indien - 6.306.411			
(31. Dezember 2021: 15.210.395)			
345.841	Infosys Ltd ADR	6.306.411	1,18
Irland - 23.785.305			
(31. Dezember 2021: 6.383.495)			
160.608	Johnson Controls International plc	10.355.201	1,93
172.568	Medtronic Plc	13.430.104	2,51
Italien - 8.042.171			
(31. Dezember 2021: -)			
1.483.815	Enel SpA	8.042.171	1,50
Republik Korea - 11.977.057			
(31. Dezember 2021: 9.268.104)			
300.198	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	11.977.057	2,23
Spanien - 10.271.623			
(31. Dezember 2021: 8.060.079)			
384.677	Industria de Diseno Textil SA	10.271.623	1,92
Schweden - 9.996.915			
(31. Dezember 2021: 7.709.802)			
984.389	Svenska Handelsbanken AB	9.996.915	1,87
Schweiz - 43.213.549			
(31. Dezember 2021: 47.457.512)			
73.106	Garmin Ltd	6.786.795	1,27
84.197	Nestle SA	9.829.676	1,84
43.956	Roche Holding AG	13.941.713	2,60
26.229	Zurich Insurance Group AG	12.655.365	2,36
Vereinigtes Königreich - 73.987.500			
(31. Dezember 2021: 79.201.790)			
83.328	AstraZeneca Plc	11.281.838	2,11
1.254.699	BAE Systems Plc	12.945.272	2,42
297.610	British American Tobacco Plc	11.789.632	2,20
609.430	Informa Plc	4.569.443	0,85
557.068	RELX Plc	15.411.647	2,88
897.030	Sage Group Plc/The	8.063.878	1,50
201.318	Smiths Group Plc	3.880.901	0,72

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
4.949.319	Taylor Wimpey Plc	6.044.889	1,13
Vereinigte Staaten von Amerika - 239.875.764			
(31. Dezember 2021: 158.131.073)			
84.479	AbbVie Inc	13.734.173	2,56
16.659	Broadcom Inc	9.291.641	1,73
66.289	Chesapeake Energy Corp	6.269.282	1,17
422.609	Cisco Systems Inc	20.071.814	3,75
70.405	CME Group Inc	11.906.894	2,22
154.216	CMS Energy Corp	9.896.812	1,85
130.847	Comerica Inc	8.722.915	1,63
182.421	Dominion Energy Inc	11.243.518	2,10
83.615	Emerson Electric Co	8.057.560	1,50
302.369	Exelon Corp	13.038.151	2,43
55.683	FedEx Corp	9.777.656	1,83
107.478	Fidelity National Information Services Inc	7.299.368	1,36
188.492	Flowserve Corp	5.791.417	1,08
96.852	Gilead Sciences Inc	8.253.243	1,54
25.948	Goldman Sachs Group Inc/The	8.908.078	1,66
435.242	Hewlett Packard Enterprise Co	6.931.229	1,29
411.438	Interpublic Group of Cos Inc/The	13.814.031	2,58
49.405	JPMorgan Chase & Co	6.581.487	1,23
232.050	Kraft Heinz Co/The	9.438.634	1,76
80.727	Marathon Petroleum Corp	9.373.616	1,75
120.180	MetLife Inc	8.732.880	1,63
235.308	Organon & Co	6.629.803	1,24
67.510	PepsiCo Inc	12.281.082	2,29
26.837	Procter & Gamble Co/The	4.095.192	0,77
60.110	Sysco Corp	4.619.153	0,86
31.005	Texas Instruments Inc	5.116.135	0,96
Gesamtanlagen in Aktien		522.967.349	97,62
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 152.005 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 33.009)		152.005	0,03
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		523.119.354	97,65
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (5.308) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (2.591))		(5.308)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(5.308)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		12.619.644	2,35
Summe Nettovermögen		535.733.690	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		97,33	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,03	
Sonstiges Umlaufvermögen		2,64	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	73.115	77.762	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	300
Euro	US-Dollar	8.084	8.606	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31
Euro	US-Dollar	166.127	176.791	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	705
Euro	US-Dollar	46.814	49.779	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	239
Euro	US-Dollar	15.000	15.943	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	83
Euro	US-Dollar	46.058	48.838	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	372
Euro	US-Dollar	141.721	150.830	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	589
Euro	US-Dollar	24.997	26.687	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	46.180	49.323	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	29.286	31.215	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	75
Euro	US-Dollar	5.761.877	6.095.527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60.644
					USD	63.075
					EUR	59.078
US-Dollar	Euro	176.685	166.127	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(681)
US-Dollar	Euro	8.600	8.084	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
US-Dollar	Euro	58.650	54.942	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Euro	77.808	73.115	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(310)
US-Dollar	Euro	61.829	58.170	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(322)
US-Dollar	Euro	39.828	37.439	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(173)
US-Dollar	Euro	179.498	168.918	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(979)
US-Dollar	Euro	17.645	16.548	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Euro	33.367	31.353	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(131)
US-Dollar	Euro	126.496	119.033	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(683)
US-Dollar	Euro	39.456	37.012	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(89)
					USD	(3.487)
					EUR	(3.266)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	10.859	11.549	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	44
Euro	US-Dollar	45.411	48.287	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	232
Euro	US-Dollar	44.960	47.674	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	363
Euro	US-Dollar	50.000	53.314	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	108
Euro	US-Dollar	43.909	46.898	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	27.830	29.662	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	72
Euro	US-Dollar	5.484.326	5.801.903	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57.723
					USD	58.558
					EUR	54.848
US-Dollar	Euro	55.875	52.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(50)
US-Dollar	Euro	11.556	10.859	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(46)
US-Dollar	Euro	2.667	2.509	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	38.318	36.020	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(166)
US-Dollar	Euro	30.801	28.942	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(121)
US-Dollar	Euro	116.779	109.890	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(631)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	37.324	35.012	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(84)
US-Dollar	Euro	7.590	7.110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	6.092	5.752	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)
					USD	(1.171)
					EUR	(1.097)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	14.836	15.794	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57
Euro	US-Dollar	21.205	22.547	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	108
Euro	US-Dollar	20.681	21.929	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	167
Euro	US-Dollar	20.548	21.946	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	13.339	14.217	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34
Euro	US-Dollar	24.990	26.471	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	229
Euro	US-Dollar	2.530.131	2.676.642	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26.630
					USD	27.233
					EUR	25.507
US-Dollar	Euro	15.784	14.836	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Euro	25.649	24.028	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Euro	17.523	16.472	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(76)
US-Dollar	Euro	511	481	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	20.273	19.013	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(41)
US-Dollar	Euro	14.165	13.310	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Euro	54.470	51.256	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(294)
US-Dollar	Euro	17.355	16.280	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(39)
					USD	(588)
					EUR	(551)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	2.466	2.623	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	13
Euro	US-Dollar	82	88	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	2.410	2.555	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	2.372	2.534	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	1.539	1.640	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	294.720	311.786	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.102
					USD	3.139
					EUR	2.940
US-Dollar	Euro	2.969	2.782	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	2.027	1.906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	1.170	1.101	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	1.628	1.529	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	6.281	5.910	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(34)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	2.000	1.876	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
						<u>(62)</u>
						<u>(58)</u>

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen				
Australien - 287.285				
(31. Dezember 2021: 263.557)		287.285	0,26	
310.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 6.125% 15-Apr-2032	287.285	0,26	
Bermudas - 246.181				
(31. Dezember 2021: 327.302)		246.181	0,22	
44.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026	34.680	0,03	
245.000	NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Feb-2027	211.501	0,19	
Kanada - 2.014.614				
(31. Dezember 2021: 2.959.724)		2.014.614	1,83	
410.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029	354.137	0,32	
333.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028	300.758	0,27	
360.000	Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026	318.846	0,29	
290.000	GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028	255.333	0,23	
300.000	GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028	258.000	0,24	
378.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025	335.475	0,31	
80.000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.875% 01-Jun-2024	77.600	0,07	
130.000	Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026	114.465	0,10	
Tschechische Republik - 732.837				
(31. Dezember 2021: -)		732.837	0,67	
760.000	Allwyn International AS 'REGS' 3.875% 15-Feb-2027	732.837	0,67	
Dänemark - 417.341				
(31. Dezember 2021: 464.011)		417.341	0,38	
415.000	Norican A/S 4.500% 15-May-2023	417.341	0,38	
Finnland - 179.247				
(31. Dezember 2021: 619.534)		179.247	0,16	
220.000	Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028	179.247	0,16	
Frankreich - 2.361.997				
(31. Dezember 2021: 5.229.963)		2.361.997	2,15	
340.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028	264.438	0,24	
380.000	Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029	289.696	0,26	
280.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	281.311	0,26	
470.000	Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028	424.216	0,39	
230.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	247.711	0,22	
300.000	iliad SA 5.375% 14-Jun-2027	318.591	0,29	
286.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS' 5.125% 15-May-2025	207.783	0,19	
340.000	Loxam SAS 3.750% 15-Jul-2026	328.251	0,30	
Deutschland - 1.899.068				
(31. Dezember 2021: 4.789.218)		1.899.068	1,73	
530.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	441.649	0,40	
205.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029	174.478	0,16	
450.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.875% 15-May-2027	404.708	0,37	
300.000	Schaeffler AG 'EMTN' 3.375% 12-Oct-2028	278.558	0,25	
407.000	Standard Profil Automotive GmbH 'REGS' 6.250% 30-Apr-2026	262.052	0,24	
381.000	TUI Cruises GmbH 'REGS' 6.500% 15-May-2026	337.623	0,31	
Irland - 2.461.113				
(31. Dezember 2021: 2.184.552)		2.461.113	2,24	
255.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026	220.718	0,20	
500.000	Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 8.166% 15-Mar-2032	431.947	0,39	
350.000	eircom Finance DAC 2.625% 15-Feb-2027	315.986	0,29	
500.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 6.146% 15-Mar-2032	465.179	0,42	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Irland Forts.				
300.000	Harvest CLO XXI DAC FRN 7.568% 15-Jul-2031	260.327	0,24	
480.000	Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029	430.173	0,39	
345.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	336.783	0,31	
Italien - 1.988.255				
(31. Dezember 2021: 4.392.880)		1.988.255	1,81	
515.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 6.934% 30-Sep-2024	520.973	0,47	
470.000	Nexi SpA 2.125% 30-Apr-2029	407.561	0,37	
566.000	Shiba Bidco SpA 'REGS' 4.500% 31-Oct-2028	515.623	0,47	
580.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	544.098	0,50	
Liberia - 703.628				
(31. Dezember 2021: 1.172.080)		703.628	0,64	
258.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026	218.016	0,20	
411.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 8.250% 15-Jan-2029	413.620	0,38	
70.000	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.250% 15-Jan-2029	71.992	0,06	
Luxemburg - 6.419.175				
(31. Dezember 2021: 12.190.256)		6.419.175	5,84	
310.000	Altice Financing SA 'REGS' 4.250% 15-Aug-2029	267.544	0,24	
780.000	Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028	621.653	0,57	
237.000	Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028	139.877	0,13	
430.000	Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027	325.876	0,30	
465.000	Altice France Holding SA 'REGS' 4.000% 15-Feb-2028	318.698	0,29	
390.000	ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027	279.377	0,25	
190.000	B&M European Value Retail SA 3.625% 15-Jul-2025	214.672	0,20	
417.000	Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028	408.730	0,37	
670.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026	624.038	0,57	
429.000	Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028	366.259	0,33	
230.000	Consolidated Energy Finance SA 'REGS' 5.000% 15-Oct-2028	206.631	0,19	
625.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025	584.438	0,53	
360.000	Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	299.716	0,27	
302.000	Matterhorn Telecom SA 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027	295.046	0,27	
723.000	PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	727.588	0,66	
500.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	454.261	0,41	
130.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	86.852	0,08	
240.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	197.919	0,18	
Niederlande - 4.955.628				
(31. Dezember 2021: 7.371.092)		4.955.628	4,51	
400.000	Elastic NV '144A' 4.125% 15-Jul-2029	323.590	0,29	
545.000	Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029	468.149	0,43	
680.000	Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028	487.725	0,44	
605.000	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.375% 01-Mar-2027	603.129	0,55	
460.000	Q-Park Holding I BV 'REGS' 2.000% 01-Mar-2027	410.316	0,37	
240.000	Sensata Technologies BV '144A' 5.875% 01-Sep-2030	227.249	0,21	
259.537	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	202.264	0,18	
321.870	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	249.207	0,23	
320.000	United Group BV 'REGS' 3.125% 15-Feb-2026	274.514	0,25	
690.000	UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031	580.990	0,53	
150.000	Villa Dutch Bidco BV 'REGS' 9.000% 03-Nov-2029	150.893	0,14	
573.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029	470.654	0,43	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Niederlande Forts.				
610.000	Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030	506.948	0,46	
Panama - 533.949				
(31. Dezember 2021: 1.788.647)				
150.000	Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029	99.821	0,09	
254.000	Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026	201.786	0,19	
270.000	Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026	232.342	0,21	
Südafrika - 220.534				
(31. Dezember 2021: -)				
240.000	Sappi Papier Holding GmbH 'REGS' 3.625% 15-Mar-2028	220.534	0,20	
Spanien - 431.829				
(31. Dezember 2021: 1.399.739)				
450.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	431.829	0,39	
Schweden - 652.438				
(31. Dezember 2021: 864.789)				
310.000	Intrum AB 'REGS' 9.250% 15-Mar-2028	322.881	0,29	
220.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	212.886	0,19	
110.000	Verisure Holding AB 'REGS' FRN 6.378% 15-Apr-2025	116.671	0,11	
Vereinigtes Königreich - 4.203.353				
(31. Dezember 2021: 8.212.245)				
230.000	BCP V Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028	205.169	0,19	
410.000	eG Global Finance Plc 'REGS' 3.625% 07-Feb-2024	413.366	0,38	
720.000	Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC 'REGS' 4.750% 15-Sep-2024	808.265	0,74	
290.000	International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029	270.472	0,25	
460.000	International Game Technology Plc 'REGS' 2.375% 15-Apr-2028	425.555	0,39	
420.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 'REGS' 5.875% 15-Nov-2024	422.526	0,38	
478.000	Maison Finco Plc 'REGS' 6.000% 31-Oct-2027	417.848	0,38	
490.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.625% 15-Nov-2027	520.134	0,47	
174.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026	157.618	0,14	
480.000	Victoria Plc 3.750% 15-Mar-2028	400.379	0,36	
190.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 3.250% 31-Jan-2031	162.021	0,15	
Vereinigte Staaten von Amerika - 74.253.254				
(31. Dezember 2021: 96.020.449)				
140.000	Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028	133.476	0,12	
520.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029	427.494	0,39	
170.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025	156.344	0,14	
374.000	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026	371.698	0,34	
210.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC '144A' 8.625% 30-Sep-2027	212.136	0,19	
535.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027	482.998	0,44	
300.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028	247.410	0,22	
393.000	Ally Financial Inc 8.000% 01-Nov-2031	407.929	0,37	
193.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	206.352	0,19	
170.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	163.874	0,15	
355.000	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029	324.673	0,30	
420.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027	387.908	0,35	
295.000	AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029	250.824	0,23	
345.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027	327.440	0,30	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
265.000	Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030	244.101	0,22	
124.000	Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029	125.769	0,11	
112.000	API Group DE Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2029	97.812	0,09	
329.000	APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029	273.070	0,25	
400.000	Aramark International Finance Sarl 'REGS' 3.125% 01-Apr-2025	408.910	0,37	
100.000	Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028	78.616	0,07	
525.000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028	492.555	0,45	
205.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.750% 15-Jul-2027	169.437	0,15	
346.000	AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029	285.772	0,26	
882.000	AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	652.780	0,59	
550.000	Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031	438.625	0,40	
370.000	Bank of America Corp FRN (Perpetual) 5.125% 20-Dec-2171	345.271	0,31	
340.000	Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030	317.220	0,29	
290.000	Belden Inc 'REGS' 3.875% 15-Mar-2028	282.555	0,26	
605.000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027	589.405	0,54	
314.000	Blackstone Mortgage Trust Inc '144A' 3.750% 15-Jan-2027	271.045	0,25	
195.000	Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028	169.958	0,15	
395.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026	381.150	0,35	
214.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025	213.148	0,19	
170.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 6.500% 02-Oct-2025	172.625	0,16	
205.000	Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025	208.166	0,19	
320.000	Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028	286.070	0,26	
273.000	Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031	229.758	0,21	
320.000	Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028	285.647	0,26	
479.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd '144A' 10.375% 01-May-2028	491.322	0,45	
240.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029	189.483	0,17	
350.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2027	327.537	0,30	
453.000	CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026	422.865	0,38	
755.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	632.343	0,58	
70.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027	65.429	0,06	
240.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029	214.033	0,19	
375.000	CDI Escrow Issuer Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2030	336.483	0,31	
147.000	Chart Industries Inc '144A' 7.500% 01-Jan-2030	148.470	0,13	
220.000	Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031	187.596	0,17	
230.000	Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029	206.917	0,19	
270.000	Chesapeake Energy Corp '144A' 6.750% 15-Apr-2029	258.995	0,24	
152.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Nov-2028	132.577	0,12	
180.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	175.418	0,16	
430.000	Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028	384.656	0,35	
440.000	Citigroup Inc FRN (Perpetual) 5.000% 12-Mar-2171	393.250	0,36	
220.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	216.886	0,20	
350.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	341.915	0,31	
550.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027	476.762	0,43	
150.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028	108.826	0,10	
435.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	424.728	0,39	
294.000	CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026	270.803	0,25	
155.000	Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030	125.506	0,11	
554.000	Covanta Holding Corp '144A' 4.875% 01-Dec-2029	449.989	0,41	
870.000	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	763.782	0,69	
390.000	Crocs Inc '144A' 4.250% 15-Mar-2029	333.928	0,30	
600.000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	486.440	0,44	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028	135.060	0,12	
693.000	CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	638.589	0,58	
389.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028	342.674	0,31	
340.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	320.720	0,29	
350.000	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	313.495	0,29	
530.000	DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	496.112	0,45	
252.000	DISH Network Corp '144A' 11.750% 15-Nov-2027	259.799	0,24	
607.000	Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029	532.398	0,48	
535.000	Eco Material Technologies Inc '144A' 7.875% 31-Jan-2027	519.140	0,47	
410.000	Encore Capital Group Inc 'REGS' 4.250% 01-Jun-2028	379.859	0,35	
343.000	EnLink Midstream LLC '144A' 6.500% 01-Sep-2030	340.319	0,31	
779.000	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	696.535	0,63	
185.000	EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031	150.596	0,14	
676.000	Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029	581.000	0,53	
453.000	Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028	410.736	0,37	
97.000	Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046	74.086	0,07	
490.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028	403.938	0,37	
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024	194.539	0,18	
200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030	164.365	0,15	
404.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027	359.490	0,33	
420.000	Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027	380.827	0,35	
240.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN' 4.535% 06-Mar-2025	274.833	0,25	
189.845	Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029	147.358	0,13	
280.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027	258.784	0,24	
385.000	Frontier Communications Holdings LLC '144A' 8.750 % 15-May-2030	393.139	0,36	
470.000	Gen Digital Inc '144A' 6.750% 30-Sep-2027	463.561	0,42	
380.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027	362.053	0,33	
330.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026	325.775	0,30	
475.000	Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028	396.594	0,36	
479.000	Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	344.097	0,31	
389.000	Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028	353.831	0,32	
223.000	Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027	177.295	0,16	
513.000	HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029	454.128	0,41	
500.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031	416.250	0,38	
421.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027	385.277	0,35	
460.000	iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026	422.823	0,38	
420.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028	400.850	0,36	
470.000	Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026	408.900	0,37	
470.000	Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028	422.800	0,38	
367.000	Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029	319.101	0,29	
470.000	JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 4.600% 01-Aug-2171	420.039	0,38	
245.000	KB Home 4.000% 15-Jun-2031	196.020	0,18	
562.000	Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026	487.736	0,44	
443.000	LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026	419.972	0,38	
93.000	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	74.142	0,07	
460.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025	434.364	0,40	
160.000	Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030	138.601	0,13	
286.000	Levi Strauss & Co '144A' 3.500% 01-Mar-2031	227.367	0,21	
296.000	Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034	206.007	0,19	
380.000	Macy's Retail Holdings LLC '144A' 5.875% 01-Apr-2029	338.492	0,31	
573.000	Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	553.340	0,50	
690.000	Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	638.292	0,58	
218.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024	212.373	0,19	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
792.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025	733.938	0,67	
420.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co 'REGS' 4.750% 15-Apr-2024	429.721	0,39	
279.000	Medline Borrower LP '144A' 3.875% 01-Apr-2029	224.178	0,20	
205.000	Medline Borrower LP '144A' 5.250% 01-Oct-2029	163.634	0,15	
470.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028	431.352	0,39	
390.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028	305.487	0,28	
380.000	MSCI Inc '144A' 3.625% 01-Sep-2030	316.217	0,29	
505.000	Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026	482.613	0,44	
405.000	Neptune Bidco US Inc '144A' 9.290% 15-Apr-2029	382.545	0,35	
527.000	Newell Brands Inc 4.450% 01-Apr-2026	498.832	0,45	
91.000	Newell Brands Inc 5.625% 01-Apr-2036	78.432	0,07	
405.000	Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028	352.604	0,32	
182.000	NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028	155.171	0,14	
160.000	NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028	132.382	0,12	
316.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027	274.525	0,25	
347.000	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028	267.722	0,24	
370.000	Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030	329.317	0,30	
271.000	NRG Energy Inc '144A' 3.625 % 15-Feb-2031	206.150	0,19	
250.000	NRG Energy Inc '144A' 5.250% 15-Jun-2029	218.835	0,20	
115.000	Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031	116.539	0,11	
725.000	Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036	740.917	0,67	
230.000	Occidental Petroleum Corp 8.875 % 15-Jul-2030	258.755	0,24	
245.000	Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250 % 01-Oct-2029	186.518	0,17	
450.000	Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028	390.855	0,36	
440.000	OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	425.965	0,39	
360.000	OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028	329.508	0,30	
605.000	Option Care Health Inc '144A' 4.375% 31-Oct-2029	536.124	0,49	
200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028	176.554	0,16	
508.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031	442.773	0,40	
280.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027	253.740	0,23	
290.000	Ovintiv Inc 8.125% 15-Sep-2030	319.770	0,29	
500.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC '144A' 4.000% 15-Oct-2027	444.655	0,40	
555.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029	461.491	0,42	
375.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028	337.012	0,31	
330.000	PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026	315.546	0,29	
363.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025	329.131	0,30	
135.000	PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031	107.336	0,10	
140.000	Permian Resources Operating LLC '144A' 5.375% 15-Jan-2026	128.321	0,12	
450.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028	408.587	0,37	
250.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029	233.223	0,21	
100.000	Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028	87.587	0,08	
367.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 3.500% 01-Mar-2032	285.886	0,26	
650.000	Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029	582.790	0,53	
189.000	Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027	182.385	0,17	
306.000	Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025	259.055	0,24	
528.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026	509.362	0,46	
360.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028	328.342	0,30	
568.000	Primo Water Holdings Inc '144A' 4.375% 30-Apr-2029	494.799	0,45	
201.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	147.992	0,13	
492.000	Rithm Capital Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025	439.208	0,40	
374.000	RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029	303.655	0,28	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
777.000	Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029	709.793	0,65
781.000	SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	653.111	0,59
841.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	718.611	0,65
420.000	Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029	405.531	0,37
150.000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 4.375% 01-Nov-2026	138.204	0,13
710.000	Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	668.426	0,61
700.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030	582.760	0,53
151.000	Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7.625% 01-Apr-2026	150.997	0,14
361.000	Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029	332.642	0,30
180.000	Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030	163.849	0,15
450.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025	445.500	0,41
121.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 9.375% 30-Nov-2029	127.734	0,12
620.000	Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	646.436	0,59
485.000	Sprint LLC 7.625% 01-Mar-2026	511.612	0,47
122.000	SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028	109.214	0,10
200.000	SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029	160.064	0,15
443.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	399.347	0,36
410.000	Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026	351.243	0,32
430.000	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	314.438	0,29
510.000	Starwood Property Trust Inc '144A' 3.750% 31-Dec-2024	480.149	0,44
380.000	Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028	330.288	0,30
600.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.875% 01-Feb-2031	541.992	0,49
113.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030	98.438	0,09
400.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028	358.064	0,33
530.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028	470.780	0,43
645.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027	618.813	0,56
20.000	Tenet Healthcare Corp 'REGS' 6.250% 01-Feb-2027	19.188	0,02
379.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030	332.320	0,30
424.000	TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029	370.370	0,34
310.000	TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027	291.400	0,26
248.000	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	245.756	0,22
575.000	TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029	493.919	0,45
500.000	Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029	430.825	0,39
570.000	UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029	465.686	0,42
774.000	United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028	744.921	0,68
400.000	United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030	343.143	0,31
304.000	United Rentals North America Inc '144A' 6.000% 15-Dec-2029	302.685	0,28
590.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033	483.060	0,44
536.000	Versco Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Aug-2026	526.277	0,48
480.000	Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025	445.482	0,41
599.000	Vistra Corp '144A' FRN (Perpetual) 7.000% 15-Jun-2171	548.367	0,50
380.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029	326.475	0,30
580.000	Western Digital Corp 4.750% 15-Feb-2026	547.462	0,50
470.000	Western Midstream Operating LP 4.300 % 01-Feb-2030	410.007	0,37
527.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029	452.588	0,41
391.000	XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029	319.173	0,29
497.000	Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	460.247	0,42
220.000	Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030	202.400	0,18
Gesamtanlagen in Anleihen		104.961.726	95,52

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Vereinigte Staaten von Amerika - 19.131			
	(31. Dezember 2021: 69.741)	19.131	0,02
4.200	Altice USA Inc	19.131	0,02
Gesamtanlagen in Aktien		19.131	0,02
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)			
Luxemburg - 322.575			
	(31. Dezember 2021: -)	322.575	0,29
330.000	Altice Financing S.A. Term Loan 0.000% 31-Oct-2027	322.575	0,29
Vereinigte Staaten von Amerika - 1.436.545			
	(31. Dezember 2021: 7.136.922)	1.436.545	1,31
110.104	Asurion LLC Term Loan 0.000% 15-Jan-2029	86.500	0,08
620.000	Asurion LLC Term Loan 9.321% 03-Feb-2028	486.235	0,44
619.515	CCI Buyer Inc Term Loan 7.553% 17-Dec-2027	593.960	0,54
280.000	Russell Investments U.S. Institutional H Term Loan 0.000% 30-May-2025	269.850	0,25
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		1.759.120	1,60
	Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 325.072 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 102.431)	325.072	0,30
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		107.065.049	97,44
	Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (565.872) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (163.678))	(565.872)	(0,52)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(565.872)	(0,52)
Nettoumlaufvermögen		3.384.066	3,08
Summe Nettovermögen		109.883.243	100,00
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		93,75	
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		1,57	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,29	
Sonstiges Umlaufvermögen		4,39	
Gesamtvermögen		109.883.243	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
Euro	US-Dollar	660.000	702.955	31. Jan. 23	Barclays Bank PLC	3.138
Euro	US-Dollar	550.000	581.653	31. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	6.757
US-Dollar	Pfund Sterling	243.690	200.000	31. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	2.718
US-Dollar	Pfund Sterling	304.846	250.000	31. Jan. 23	Goldman Sachs	3.630
US-Dollar	Pfund Sterling	61.591	50.000	31. Jan. 23	Goldman Sachs	1.348
US-Dollar	Pfund Sterling	3.704.490	3.060.000	31. Jan. 23	Barclays Bank PLC	17.609
					USD	35.200
US-Dollar	Euro	213.249	200.000	31. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(718)
US-Dollar	Euro	747.775	700.000	31. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(1.110)
US-Dollar	Euro	848.681	800.000	31. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(7.189)
US-Dollar	Euro	315.060	300.000	31. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(5.891)
US-Dollar	Euro	20.314.221	19.480.000	31. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(526.201)
					USD	(541.109)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	7180	7.669	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	936.843	991.092	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.860
					USD	9.863
					EUR	9.238
US-Dollar	Euro	6.114	5.758	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)
US-Dollar	Euro	9.386	8.820	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)
					USD	(74)
					EUR	(69)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	93.862	100.250	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	35
Euro	US-Dollar	12.192.045	12.898.043	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	128.322
					USD	128.357
					EUR	120.224
US-Dollar	Euro	79.399	74.769	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(486)
US-Dollar	Euro	121.713	114.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(479)
					USD	(965)
					EUR	(904)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	112.879	120.561	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	42
Euro	US-Dollar	14.391.605	15.224.971	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	151.472
					USD	151.514
					EUR	141.913
US-Dollar	Euro	92.868	87.452	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(569)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	141.456	132.917	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(557)
					USD	(1.126)
					EUR	(1.055)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Pfund Sterling	6.042	5.005	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
US-Dollar	Pfund Sterling	5.861	4.852	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18
US-Dollar	Pfund Sterling	8.884	7.290	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	105
					USD	138
					GBP	115
Pfund Sterling	US-Dollar	6.224	7.732	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(237)
Pfund Sterling	US-Dollar	800.567	986.439	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22.361)
					USD	(22.598)
					GBP	(18.771)

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Belgien - 1.506.890			
(31. Dezember 2021: 9.397.066)			
156.465	Proximus SADP	1.506.890	1,23
Kanada - 2.538.138			
(31. Dezember 2021: 17.686.339)			
64.928	Enbridge Inc	2.538.138	2,08
China - 3.271.089			
(31. Dezember 2021: 5.599.449)			
3.586.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	3.271.089	2,68
Frankreich - 21.755.705			
(31. Dezember 2021: 25.294.919)			
246.867	Bouygues SA	7.411.142	6,06
269.536	Engie SA	3.863.927	3,16
576.202	Orange SA	5.725.715	4,68
47.602	Vinci SA	4.754.921	3,89
Deutschland - 6.520.007			
(31. Dezember 2021: 1.794.787)			
172.669	Deutsche Post AG	6.520.007	5,33
Italien - 9.267.733			
(31. Dezember 2021: 19.939.937)			
921.067	Enel SpA	4.959.855	4,06
775.033	Italgas SpA	4.307.878	3,52
Norwegen - 1.179.714			
(31. Dezember 2021: 1.591.995)			
128.021	SFL Corp Ltd	1.179.714	0,96
Spanien - 10.593.785			
(31. Dezember 2021: 43.327.016)			
195.927	Enagas SA	3.259.207	2,67
149.113	Endesa SA	2.814.466	2,30
259.734	Red Electrica Corp SA	4.520.112	3,70
Vereinigtes Königreich - 12.374.507			
(31. Dezember 2021: 10.921.833)			
506.870	Drax Group Plc	4.301.719	3,52
390.099	SSE Plc	8.072.788	6,60
Vereinigte Staaten von Amerika - 52.290.106			
(31. Dezember 2021: 87.930.381)			
795.135	Antero Midstream Corp	8.575.531	7,02
127.073	Clearway Energy Inc	4.050.452	3,31
68.128	Dominion Energy Inc	4.179.312	3,42
179.482	Hess Midstream LP - Class A	5.371.896	4,39
573.266	Medical Properties Trust Inc (REIT)	6.383.317	5,22
126.947	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	3.548.803	2,90
82.584	ONEOK Inc	5.426.182	4,44
145.989	PPL Corp	4.266.529	3,49
59.603	Verizon Communications Inc	2.348.656	1,92
245.142	Vistra Corp	5.688.520	4,65

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
74.507	Williams Cos Inc/The	2.450.908	2,01
Gesamtanlagen in Aktien		121.297.674	99,21
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 169.662 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.813.323)		169.662	0,14
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		121.467.336	99,35
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (55.727) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (48.500))		(55.727)	(0,05)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(55.727)	(0,05)
Nettoumlaufvermögen		848.917	0,70
Summe Nettovermögen		122.260.526	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,97	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,14	
Sonstiges Umlaufvermögen		0,89	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	7.544	8.070	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		11
Euro	US-Dollar	3.039	3.239	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		17
Euro	US-Dollar	8.277	8.776	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		90
Euro	US-Dollar	6.390	6.824	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		21
Euro	US-Dollar	4.058	4.332	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		15
Euro	US-Dollar	605.993	641.117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		8.041
						USD	8.195
						EUR	7.656
US-Dollar	Euro	5.547	5.209	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(33)
US-Dollar	Euro	5.612	5.268	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(31)
US-Dollar	Euro	9.758	9.184	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(80)
US-Dollar	Euro	11.703	10.973	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(52)
						USD	(196)
						EUR	(183)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	18.789	20.099	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		28
Euro	US-Dollar	7.569	8.066	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		42
Euro	US-Dollar	20.613	21.858	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		224
Euro	US-Dollar	15.914	16.996	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		52
Euro	US-Dollar	10.107	10.789	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		38
Euro	US-Dollar	1.509.218	1.596.693	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		20.026
						USD	20.410
						EUR	19.067
US-Dollar	Euro	13.977	13.121	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(79)
US-Dollar	Euro	24.302	22.872	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(199)
US-Dollar	Euro	29.146	27.328	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(129)
US-Dollar	Euro	13.815	12.973	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(82)
						USD	(489)
						EUR	(457)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	126	135	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	51	55	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	138	147	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
Euro	US-Dollar	107	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	69	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.080	10.664	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		134
US-Dollar	Euro	92	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	136
						EUR	127
Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	91	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	162	152	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	194	182	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(3)
						EUR	(3)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	121	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	49	53	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	134	142	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
Euro	US-Dollar	103	110	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	66	71	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	9.726	10.290	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		129
US-Dollar	Euro	87	82	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	89	84	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	131
						EUR	122
US-Dollar	Euro	156	147	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	187	176	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(2)
						EUR	(2)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)							
Singapur-Dollar	US-Dollar	17.821	13.306	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.135	5.300	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		28
Singapur-Dollar	US-Dollar	19.508	14.420	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		148
Singapur-Dollar	US-Dollar	500	368	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		5
Singapur-Dollar	US-Dollar	14.970	11.117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		62
Singapur-Dollar	US-Dollar	992	732	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		8
Singapur-Dollar	US-Dollar	9.171	6.824	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		24
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.382.761	1.023.474	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		9.096
						USD	9.373
						SGD	12.554
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.487	11.430	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(48)
US-Dollar	Singapur-Dollar	9.151	12.357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(76)
US-Dollar	Singapur-Dollar	15.240	20.688	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(208)
US-Dollar	Singapur-Dollar	17.863	24.226	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(228)
						USD	(560)
						SGD	(750)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged)							
Singapur-Dollar	US-Dollar	247.680	184.926	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		28

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged) Forts.						
Singapur-Dollar	US-Dollar	99.156	73.659	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	385
Singapur-Dollar	US-Dollar	271.122	200.405	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.054
Singapur-Dollar	US-Dollar	208.132	154.563	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	858
Singapur-Dollar	US-Dollar	127.595	94.944	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	337
Singapur-Dollar	US-Dollar	19.238.486	14.239.684	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	126.551
					USD	130.213
					SGD	174.407
US-Dollar	Singapur-Dollar	117.953	158.851	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(668)
US-Dollar	Singapur-Dollar	127.185	171.735	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.057)
US-Dollar	Singapur-Dollar	211.887	287.628	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.897)
US-Dollar	Singapur-Dollar	248.347	336.815	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.168)
					USD	(7.790)
					SGD	(10.434)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	28.602	34.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	32
Pfund Sterling	US-Dollar	11.846	14.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Pfund Sterling	US-Dollar	31.248	37.619	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	170
US-Dollar	Pfund Sterling	23.645	19.439	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	138
US-Dollar	Pfund Sterling	41.044	33.686	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	308
US-Dollar	Pfund Sterling	49.489	40.467	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	552
					USD	1.204
					GBP	996
Pfund Sterling	US-Dollar	23.898	29.718	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(818)
Pfund Sterling	US-Dollar	15.106	18.784	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(517)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.243.698	2.758.550	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(45.249)
US-Dollar	Pfund Sterling	22.068	18.334	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(103)
					USD	(46.687)
					GBP	(38.618)

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
	Australien - 1.775.018		
	(31. Dezember 2021: 2.430.773)	1.775.018	3,82
9.060	CSL Ltd	1.775.018	3,82
	Dänemark - 2.365.981		
	(31. Dezember 2021: 3.086.481)	2.365.981	5,09
17.500	Novo Nordisk A/S	2.365.981	5,09
	Frankreich - 4.719.140		
	(31. Dezember 2021: 5.959.341)	4.719.140	10,15
7.660	Air Liquide SA	1.085.716	2,34
5.200	L'Oreal SA	1.857.071	3,99
2.440	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.776.353	3,82
	Hongkong - 2.558.420		
	(31. Dezember 2021: 2.438.141)	2.558.420	5,50
229.800	AIA Group Ltd	2.558.420	5,50
	Japan - 1.882.292		
	(31. Dezember 2021: 3.893.124)	1.882.292	4,05
4.800	Keyence Corp	1.882.292	4,05
	Niederlande - 1.779.844		
	(31. Dezember 2021: 2.574.834)	1.779.844	3,83
3.300	ASML Holding NV	1.779.844	3,83
	Spanien - 617.260		
	(31. Dezember 2021: 1.302.277)	617.260	1,33
23.200	Industria de Diseno Textil SA	617.260	1,33
	Schweiz - 1.906.866		
	(31. Dezember 2021: 2.788.051)	1.906.866	4,10
6.070	Roche Holding AG	1.906.866	4,10
	Taiwan - 1.318.650		
	(31. Dezember 2021: 2.707.087)	1.318.650	2,83
17.700	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.318.650	2,83
	Vereinigte Staaten von Amerika - 26.924.024		
	(31. Dezember 2021: 35.415.551)	26.924.024	57,90
5.000	Adobe Inc	1.682.550	3,62
3.300	Alphabet Inc	292.859	0,63
12.800	Alphabet Inc	1.135.936	2,44
26.600	Amphenol Corp - Class A	2.025.457	4,36
9.200	Automatic Data Processing Inc	2.197.006	4,73
20.700	Edwards Lifesciences Corp	1.543.909	3,32
35.600	Fastenal Co	1.684.236	3,62
7.600	Illumina Inc	1.536.150	3,30
8.520	Intuitive Surgical Inc	2.260.228	4,86
3.800	Mastercard Inc	1.321.697	2,84
2.600	Mastercard Inc	904.319	1,95
7.300	Microsoft Corp	1.750.722	3,77
8.400	NIKE Inc	983.052	2,11
5.700	NIKE Inc	667.071	1,43
3.150	Old Dominion Freight Line Inc	893.498	1,92
10.300	Texas Instruments Inc	1.701.869	3,66
14.500	TJX Cos Inc/The	1.154.345	2,48
15.700	TJX Cos Inc/The	1.249.877	2,69

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien Forts.			
	Vereinigte Staaten von Amerika Forts.		
8.240	West Pharmaceutical Services Inc	1.939.243	4,17
Gesamtanlagen in Aktien		45.847.495	98,60
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 6.607 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 7.178)		6.607	0,01
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		45.854.102	98,61
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (989) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (562))		(989)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(989)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		644.324	1,39
Summe Nettovermögen		46.497.437	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,49
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,01
Sonstiges Umlaufvermögen	1,50
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK H (Acc) (Hedged)						
Dänische Krone	US-Dollar	1.693	241	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Dänische Krone	US-Dollar	1.894	272	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	781	112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Dänische Krone	US-Dollar	127.903	18.197	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	230
					USD	234
					DKK	1.626
US-Dollar	Dänische Krone	17.895	125.230	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(147)
US-Dollar	Dänische Krone	171	1.198	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	199	1.392	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Dänische Krone	638	4.450	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
					USD	(153)
					DKK	(1.063)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged)						
Dänische Krone	US-Dollar	1.749	249	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Dänische Krone	US-Dollar	1.951	280	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	820	118	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Dänische Krone	US-Dollar	131.487	18.707	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	237
					USD	242
					DKK	1.681
US-Dollar	Dänische Krone	18.405	128.796	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(151)
US-Dollar	Dänische Krone	174	1.219	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Dänische Krone	204	1.427	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Dänische Krone	655	4.567	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
					USD	(157)
					DKK	(1.091)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	3.352	3.585	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	2.505	2.656	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27
Euro	US-Dollar	2.807	2.998	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9
Euro	US-Dollar	1.159	1.237	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	189.463	200.445	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.514
					USD	2.559
					EUR	2.391
US-Dollar	Euro	2.010	1.888	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Euro	2.216	2.085	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Euro	1.889	1.773	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	2.189	2.060	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	7.043	6.604	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
					USD	(89)
					EUR	(83)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	US-Dollar	35.282	3.588	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
Norwegische Krone	US-Dollar	26.218	2.656	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	21
Norwegische Krone	US-Dollar	1.965.726	197.473	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.263
					USD	3.299
					NOK	32.320
Norwegische Krone	US-Dollar	28.528	2.929	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)
Norwegische Krone	US-Dollar	11.799	1.210	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.945	19.218	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Norwegische Krone	2.181	21.565	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Norwegische Krone	1.895	18.723	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Norwegische Krone	2.152	21.302	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Norwegische Krone	6.933	68.282	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(40)
					USD	(141)
					NOK	(1.381)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	US-Dollar	2.775	282	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Norwegische Krone	US-Dollar	2.068	210	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Norwegische Krone	US-Dollar	947	97	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Norwegische Krone	US-Dollar	154.245	15.495	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	256
					USD	259
					NOK	2.537
Norwegische Krone	US-Dollar	2.243	230	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Norwegische Krone	150	1.478	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Norwegische Krone	171	1.687	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Norwegische Krone	147	1.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Norwegische Krone	168	1.667	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Norwegische Krone	543	5.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
					USD	(10)
					NOK	(98)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)						
Schwedische Krone	US-Dollar	1.925	184	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Schwedische Krone	139	1.456	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schwedische Krone	131	1.360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schwedische Krone	154	1.596	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Schwedische Krone	495	5.111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
					USD	7
					SEK	73
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.552	245	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.147	211	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	869	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	145.437	14.153	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(207)
US-Dollar	Schwedische Krone	153	1.599	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(216)
					SEK	(2.254)
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)						
Schwe- dische Krone	US-Dollar	1.994	191	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Schwedische Krone	133	1.387	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schwedische Krone	158	1.639	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Schwedische Krone	509	5.255	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Schwedische Krone	141	1.471	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	7
					SEK	73
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.635	254	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	2.217	218	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	916	90	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Schwe- dische Krone	US-Dollar	149.826	14.580	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(213)
US-Dollar	Schwedische Krone	157	1.643	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(223)
					SEK	(2.327)

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
China - 255.376			
(31. Dezember 2021: 291.740)			
38.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	255.376	0,94
Dänemark - 296.540			
(31. Dezember 2021: 531.933)			
5.867	Novozymes A/S	296.540	1,09
Deutschland - 1.157.907			
(31. Dezember 2021: 1.435.011)			
7.150	Bayer AG	372.601	1,37
7.625	SAP SE	785.306	2,90
Hongkong - 907.554			
(31. Dezember 2021: 762.219)			
81.400	AIA Group Ltd	907.554	3,35
Indien - 569.700			
(31. Dezember 2021: 645.133)			
28.906	HDFC Bank Ltd	569.700	2,10
Japan - 1.776.435			
(31. Dezember 2021: 2.700.132)			
9.000	Ebara Corp	322.600	1,19
1.800	FANUC Corp	270.820	1,00
8.500	Sony Group Corp	648.064	2,39
16.500	Suzuki Motor Corp	534.951	1,97
Niederlande - 2.275.569			
(31. Dezember 2021: 2.615.990)			
28.821	Relx Plc	797.732	2,94
33.798	Universal Music Group NV	817.132	3,01
6.268	Wolters Kluwer NV	660.705	2,44
Republik Korea - 616.631			
(31. Dezember 2021: 773.642)			
1.316	Samsung SDI Co Ltd	616.631	2,28
Schweiz - 1.303.025			
(31. Dezember 2021: 1.829.076)			
886	Lonza Group AG	440.311	1,63
2.720	Roche Holding AG	862.714	3,18
Taiwan - 297.481			
(31. Dezember 2021: 575.993)			
3.915	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	297.481	1,10
Vereinigtes Königreich - 2.906.661			
(31. Dezember 2021: 3.913.520)			
4.455	AstraZeneca Plc	603.165	2,22
252.782	Barclays Plc	483.998	1,79
18.613	Diageo Plc	818.292	3,02
50.314	Informa Plc	377.249	1,39
30.291	SSE Plc	623.957	2,30
Vereinigte Staaten von Amerika - 13.962.605			
(31. Dezember 2021: 19.393.143)			
5.097	Abbott Laboratories	562.327	2,07
2.705	Accenture Plc - Class A	725.981	2,68
9.028	Alphabet Inc - Class A	798.346	2,95
7.242	Amazon.com Inc	609.342	2,25
7.451	Apple Inc	965.538	3,56
4.984	Applied Materials Inc	484.046	1,79
2.773	Chubb Ltd	615.814	2,27
3.707	CME Group Inc	626.928	2,31
2.023	Cooper Cos Inc/The	676.572	2,50
2.379	Ecolab Inc	351.378	1,30
19.465	Exelon Corp	839.331	3,10
2.246	Goldman Sachs Group Inc/The	771.063	2,84
2.861	Hubbell Inc - Class B	673.608	2,48
2.526	Mastercard Inc	879.654	3,24
9.574	Medtronic Plc	745.097	2,75

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
6.481	Microsoft Corp	1.561.824	5,76
6.087	TE Connectivity Ltd	703.931	2,60
3.514	Texas Instruments Inc	579.845	2,14
4.649	Trane Technologies Plc	791.980	2,92
Gesamtanlagen in Aktien		26.325.484	97,11
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 2.548 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 608)		2.548	0,01
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		26.328.032	97,12
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (307) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (51))		(307)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(307)	(0,00)
Nettoumlaufvermögen		780.489	2,88
Summe Nettovermögen		27.108.214	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,86
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,01
Sonstiges Umlaufvermögen	3,13
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Euro	US-Dollar	2.200	2.333	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		18
Euro	US-Dollar	2.297	2.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	1.633	1.741	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		4
Euro	US-Dollar	205.929	217.854	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.167
						USD	2.190
						EUR	2.051
US-Dollar	Euro	2.095	1.962	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
US-Dollar	Euro	2.616	2.459	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(11)
US-Dollar	Euro	1.434	1.346	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(4)
US-Dollar	Euro	2.135	2.006	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(8)
US-Dollar	Euro	5.666	5.332	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(31)
US-Dollar	Euro	2.084	1.954	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(5)
US-Dollar	Euro	1.118	1.058	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(12)
						USD	(73)
						EUR	(68)
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
Euro	US-Dollar	107	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	140	149	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.000	10.593	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		92
Euro	US-Dollar	25.207	26.666	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		265
US-Dollar	Euro	100	94	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	69	65	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	103	97	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	101	95	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	358
						EUR	335
US-Dollar	Euro	127	119	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	275	259	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
US-Dollar	Euro	26.700	25.206	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(231)
						USD	(234)
						EUR	(219)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 8.932.738			
(31. Dezember 2021: 13.681.925)			
9.385.999	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	8.932.738	0,42
Irland - 83.597.958			
(31. Dezember 2021: 14.947.842)			
225.705	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	20.710.624	0,98
8.494	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF - ETF	1.150.842	0,06
684.846	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	61.736.492	2,93
Vereinigtes Königreich - 4.823.698			
(31. Dezember 2021: 4.710.306)			
5.597.852	Riverstone Credit Opportunities Income Plc/The Fund	4.823.698	0,23
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		97.354.394	4,62
Anleihen			
Australien - 71.993.005			
(31. Dezember 2021: -)			
45.681.000	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	28.878.118	1,37
41.177.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	20.858.693	0,99
36.986.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	22.256.194	1,06
Brasilien - 16.363.056			
(31. Dezember 2021: -)			
132.044.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	16.363.056	0,78
Frankreich - 26.882.217			
(31. Dezember 2021: 19.129.345)			
2.192.000	Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028	1.650.982	0,08
3.450.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029	2.614.841	0,12
5.797.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	4.423.459	0,21
1.987.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	1.869.807	0,09
2.359.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 25-Sep-2171	2.141.429	0,10
4.521.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 23-Mar-2171	4.209.653	0,20
5.488.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	4.977.753	0,24
5.378.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	4.994.293	0,24
Deutschland - 101.334.377			
(31. Dezember 2021: 4.508.453)			
101.702.099	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	97.466.959	4,63
4.346.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	3.867.418	0,18
Ungarn - 11.568.133			
(31. Dezember 2021: -)			
6.325.000	Hungary Government International Bond 1.250% 22-Oct-2025	5.804.800	0,28
6.140.000	Hungary Government International Bond 5.375% 21-Feb-2023	5.763.333	0,27
Irland - 7.484.213			
(31. Dezember 2021: 8.666.890)			
8.175.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Apr-2171	7.484.213	0,36
Italien - 88.500.523			
(31. Dezember 2021: 26.437.519)			
11.036.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7.700% 17-Mar-2171	9.420.186	0,45
40.627.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	40.073.660	1,90

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Italien Forts.			
26.170.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	26.111.831	1,24
9.962.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2171	7.414.219	0,35
6.100.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2171	5.480.627	0,26
Luxemburg - 5.361.016			
(31. Dezember 2021: 6.582.618)			
6.300.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	5.361.016	0,26
Mexiko - 21.345.265			
(31. Dezember 2021: -)			
480.510.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	21.345.265	1,01
Niederlande - 2.109.324			
(31. Dezember 2021: -)			
2.336.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2171	2.109.324	0,10
Spanien - 27.152.714			
(31. Dezember 2021: 30.494.158)			
6.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-Dec-2171	6.377.778	0,30
8.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jun-2171	8.426.366	0,40
8.400.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.750% 19-Jun-2171	7.373.184	0,35
5.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Dec-2171	4.975.386	0,24
Schweden - 9.755.843			
(31. Dezember 2021: -)			
2.200.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.250% 01-Mar-2171	2.012.948	0,09
8.600.000	Swedbank AB FRN (Perpetual) 5.625% 17-Mar-2171	7.742.895	0,37
Schweiz - 6.963.687			
(31. Dezember 2021: -)			
6.060.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 5.250% 11-Feb-2171	3.730.844	0,18
1.688.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Mar-2171	1.142.262	0,05
2.266.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.000% 31-Jul-2171	2.090.581	0,10
Vereinigtes Königreich - 65.293.794			
(31. Dezember 2021: 32.595.690)			
2.117.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.125% 15-Sep-2171	2.267.807	0,11
1.957.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.250% 15-Jun-2171	2.181.921	0,10
2.344.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.750% 15-Dec-2171	2.142.564	0,10
10.793.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 8.875% 15-Sep-2171	12.015.017	0,57
4.359.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	4.442.584	0,21
3.803.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	4.448.240	0,21
5.113.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	5.476.900	0,26
20.000.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2171	19.133.500	0,91
5.595.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 27-Jun-2171	5.136.193	0,25
9.113.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	8.049.068	0,38
Vereinigte Staaten von Amerika - 115.588.108			
(31. Dezember 2021: 49.700.321)			
10.411.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	10.425.933	0,50
836.000	AT&T Inc 2.900 % 04-Dec-2026	869.769	0,04
7.726.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	5.710.283	0,27
3.648.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	3.285.744	0,16
8.048.419	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	7.110.961	0,34

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
7.192.966	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6.500% 20-Jun-2027	6.684.640	0,32	
5.512.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	6.169.471	0,29	
4.493.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	4.307.335	0,20	
1.335.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	1.161.628	0,05	
23.073.100	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	21.378.178	1,02	
58.531.900	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	48.484.166	2,30	
Gesamtanlagen in Anleihen		577.695.275	27,44	
Aktien				
Australien - 12.024.916				
(31. Dezember 2021: 16.182.426)				
339.049	OZ Minerals Ltd	6.023.332	0,29	
5.301.617	Star Entertainment Grp Ltd/The	6.001.584	0,28	
Brasilien - 7.084.474				
(31. Dezember 2021: -)				
3.021.920	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	7.084.474	0,34	
China - 3.882.237				
(31. Dezember 2021: 23.970.995)				
681.744	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	3.882.237	0,18	
Dänemark - 6.813.819				
(31. Dezember 2021: 33.236.724)				
79.552	Orsted AS '144A'	6.813.819	0,32	
Finnland - 10.404.228				
(31. Dezember 2021: 13.233.865)				
239.508	Neste Oyj	10.404.228	0,49	
Frankreich - 24.841.316				
(31. Dezember 2021: 103.992.905)				
16.616	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	11.455.070	0,54	
147.800	Sanofi	13.386.246	0,64	
Deutschland - 20.218.029				
(31. Dezember 2021: 116.690.913)				
414.219	Bayer AG	20.218.029	0,96	
Guernsey - 2.465.072				
(31. Dezember 2021: 2.020.415)				
5.790.966	Amedeo Air Four Plus Ltd	2.465.072	0,12	
Hongkong - 29.266.825				
(31. Dezember 2021: 46.297.470)				
1.790.800	AIA Group Ltd	18.701.057	0,89	
1.535.100	Link REIT (Units) (REIT)	10.565.768	0,50	
Indien - 11.849.416				
(31. Dezember 2021: 22.615.910)				
396.072	Housing Development Finance Corp Ltd	11.849.416	0,56	
Indonesien - 8.160.314				
(31. Dezember 2021: -)				
13.648.300	Bank Mandiri Persero Tbk PT	8.160.314	0,39	
Irland - 87.800.747				
(31. Dezember 2021: 175.729.128)				
11.161.030	Greencoat Renewables Plc	12.695.671	0,60	
77.557	ICON Plc	14.429.015	0,68	
49.933	Linde Plc	15.426.536	0,73	
180.805	Medtronic Plc	13.179.545	0,63	
246.901	Ryanair Holdings Plc ADR	17.383.541	0,83	
92.043	Trane Technologies Plc	14.686.439	0,70	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Aktien Forts.				
Japan - 10.518.963				
(31. Dezember 2021: 81.860.778)				
147.300	Sony Group Corp	10.518.963	0,50	
Niederlande - 26.258.026				
(31. Dezember 2021: 58.603.997)				
25.003	ASML Holding NV	12.745.279	0,61	
596.721	Universal Music Group NV	13.512.747	0,64	
Republik Korea - 10.753.735				
(31. Dezember 2021: 23.691.757)				
24.503	Samsung SDI Co Ltd	10.753.735	0,51	
Schweiz - 36.358.421				
(31. Dezember 2021: 133.202.817)				
20.691	Lonza Group AG	9.631.152	0,46	
190.703	Nestle SA	20.853.115	0,99	
54.231	TE Connectivity Ltd	5.874.154	0,28	
Vereinigtes Königreich - 245.658.959				
(31. Dezember 2021: 343.171.805)				
673.586	3i Group Plc	10.162.740	0,48	
333.994	Anglo American Plc	12.186.396	0,58	
276.180	AstraZeneca Plc	35.022.889	1,66	
2.741.312	BAE Systems Plc	26.491.159	1,26	
360.086	Diageo Plc	14.827.534	0,70	
8.555.568	Impact Healthcare Reit Plc (REIT) - Class B	10.255.192	0,49	
1.977.431	Informa Plc	13.887.102	0,66	
6.955.748	Melrose Industries Plc	10.514.105	0,50	
1.739.759	Prudential Plc	22.295.653	1,06	
706.138	Relx Plc	18.306.628	0,87	
1.850.364	Shell Plc	48.798.069	2,32	
484.848	Unilever Plc	22.911.492	1,09	
Vereinigte Staaten von Amerika - 263.527.194				
(31. Dezember 2021: 720.241.563)				
543.552	Bank of America Corp	16.874.463	0,80	
9.362	Booking Holdings Inc	17.564.230	0,83	
84.571	CME Group Inc	13.396.374	0,64	
213.402	ConocoPhillips	23.267.031	1,11	
46.343	Cooper Cos Inc/The	14.516.877	0,69	
343.337	Dominion Energy Inc	19.820.694	0,94	
45.218	Eli Lilly & Co	15.544.115	0,74	
900.157	Exelon Corp	36.355.311	1,73	
38.337	Goldman Sachs Group Inc/The	12.327.332	0,59	
93.206	Hess Corp	12.297.528	0,58	
62.267	Hubbell Inc - Class B	13.731.509	0,65	
44.445	Lockheed Martin Corp	20.275.509	0,96	
80.253	Marathon Petroleum Corp	8.728.115	0,42	
87.151	Microsoft Corp	19.671.308	0,93	
133.903	NextEra Energy Inc	10.544.549	0,50	
370.41	Norfolk Southern Corp	8.612.249	0,41	
Gesamtanlagen in Aktien		817.886.691	38,85	
Kapitalbeteiligungsinstrumente				
Guernsey - 93.160.020				
(31. Dezember 2021: 119.250.810)				
5.982.482	Bluefield Solar Income Fund Ltd	9.191.356	0,43	
12.862.848	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	12.582.539	0,60	
17.406.549	International Public Partnerships Ltd	29.755.931	1,41	
6.227.081	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	8.369.942	0,40	
22.602.338	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	33.260.252	1,58	
Luxemburg - 10.304.208				
(31. Dezember 2021: 13.353.511)				
5.827.830	BBGI Global Infrastructure SA	10.304.208	0,49	
Vereinigtes Königreich - 69.380.866				
(31. Dezember 2021: 77.385.503)				
21.437.821	BioPharma Credit Plc/The Fund	19.155.781	0,91	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Kapitalbeteiligungsinstrumente Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
22.921.072	Greencoat UK Wind Plc/Funds	39.337.906	1,87
10.005.214	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	10.887.179	0,52
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		172.845.094	8,21
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 76.982.128			
(31. Dezember 2021: -)			
246.554	Amundi Physical Gold ETC	16.712.964	0,80
191.881	Invesco Physical Gold ETC	31.582.662	1,50
864.350	Ishares Physical Gold ETC	28.686.502	1,36
Jersey - 14.172.384		14.172.384	0,67
(31. Dezember 2021: -)			
158.454	WisdomTree Copper - ETC	5.039.388	0,24
1.079.380	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	9.132.996	0,43
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		91.154.512	4,33
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Vereinigte Staaten von Amerika - 28.642.266			
(31. Dezember 2021: -)			
307.893	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	28.642.266	1,36
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		28.642.266	1,36
Optionsscheine			
Luxemburg - 45.220.630			
(31. Dezember 2021: 44.051.853)			
403.000	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	45.220.630	2,15
Vereinigtes Königreich - 114.475.946			
(31. Dezember 2021: 139.975.593)			
572.186	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	57.240.808	2,72
588.479	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	57.235.138	2,72
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		159.696.576	7,59
Indexoptionen - 18.713.558			
(31. Dezember 2021: 26.754.878)			
1.157	CBOE S&P 500 Index Call 19-Jan-2023 4,000.000	2.226.979	0,10
5.405	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,850.000	12.150.440	0,58
2.465	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,550.000	4.336.139	0,21
Indexoptionen insgesamt		18.713.558	0,89

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 23.815.255				
(31. Dezember 2021: 1.619.234)				
(179)	DAX Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(62.712.650)	1.639.728	0,08
(1.894)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(343.422.015)	9.412.918	0,45
(4.313)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(164.713.470)	4.515.695	0,21
216	Hang Seng Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	25.846.597	156.934	0,01

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(561)	NASDAQ 100 E-Mini Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(115.943.787)	8.089.980	0,38
Offene Terminkontrakte insgesamt			23.815.255	1,13

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 23.546.268 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 2.678.463)			23.546.268	1,12
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			2.011.349.889	95,54

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Aktioptionen - (78.171)			
(31. Dezember 2021:)			
(230)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA Put 20-Jan-2023 630.000	(67.620)	(0,00)
(751)	Nike Inc Class B Put 20-Jan-2023 95.000	(10.551)	(0,00)
Aktioptionen insgesamt			(78.171)

Indexoptionen - (9.782.956)			
(31. Dezember 2021: (18.691.421))			
(115)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Jan-2023 3,750.000	(411.141)	(0,02)
(2.702)	EURO STOXX 50 Index Call 20-Jan-2023 4,100.000	(59.444)	(0,00)
(5.405)	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,550.000	(6.437.355)	(0,31)
(2.465)	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,750.000	(1.709.439)	(0,08)
(670)	Hang Seng Index Put 20-Jan-2023 18,000.000	(358.290)	(0,02)
(39)	NASDAQ 100 Index Put 19-Jan-2023 10,750.000	(807.287)	(0,04)
Indexoptionen insgesamt			(9.782.956)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (8.472.229)				
(31. Dezember 2021: (2.277.516))				
390	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	52.076.700	(1.266.151)	(0,06)
1.020	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	75.147.032	(4.210.877)	(0,20)
1.576	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	185.255.361	(2.995.201)	(0,14)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(8.472.229)	(0,40)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (7.204.631) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (44.019.460))			(7.204.631)	(0,34)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(25.537.987)	(1,21)

Nettoumlaufvermögen	119.371.212	5,67
Summe Nettovermögen	2.105.183.114	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Aktioptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.

Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	88,93
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,33
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,97
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,09
Sonstiges Umlaufvermögen	6,68
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
Euro	Pfund Sterling	4.585.976	4.003.482	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	73.593
Euro	Pfund Sterling	612.824	533.757	13. Jan. 23	State Street Bank	11.218
Euro	Pfund Sterling	383.851.383	338.626.397	13. Jan. 23	State Street Bank	2.180.623
Euro	Pfund Sterling	2.214.127	1.935.734	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	32.333
Euro	Pfund Sterling	6.185.431	5.425.223	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	70.583
Euro	US-Dollar	48.376.034	47.314.519	13. Jan. 23	State Street Bank	4.091.892
Euro	Hongkong-Dollar	25.360.949	201.628.972	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1.182.255
Euro	US-Dollar	264.699.004	267.927.803	15. Feb. 23	State Street Bank	14.509.509
Euro	US-Dollar	331.290	344.533	15. Feb. 23	UBS AG	9.567
Euro	US-Dollar	13.799.464	14.347.684	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	401.677
Euro	US-Dollar	8.082.786	8.481.444	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	162.861
Euro	US-Dollar	3.601.503	3.800.554	15. Feb. 23	UBS AG	52.566
Euro	US-Dollar	5.935.230	6.294.303	15. Feb. 23	State Street Bank	57.645
Ungarischer Forint	Euro	8.589.678.493	20.682.770	15. Feb. 23	UBS AG	432.052
Japanischer Yen	Euro	66.106.776	461.497	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	9.804
Schweizer Franken	Euro	2.719.983	2.765.485	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	928
Euro	Australischer Dollar	94.754.707	148.670.609	16. Mrz. 23	UBS AG	266.843
EUR						23.545.949
Pfund Sterling	Euro	4.300.084	4.872.377	13. Jan. 23	State Street Bank	(25.690)
Pfund Sterling	Euro	3.453.942	4.009.796	13. Jan. 23	UBS AG	(116.807)
Pfund Sterling	Euro	8.305.645	9.644.668	13. Jan. 23	State Street Bank	(283.254)
Schwedische Krone	Euro	547.428.166	49.808.806	13. Jan. 23	UBS AG	(399.510)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	13.239.997	95.261.780	13. Jan. 23	State Street Bank	(473.352)
Euro	Japanischer Yen	13.482.530	1.966.493.273	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(537.377)
Euro	Schweizer Franken	40.140.720	39.599.503	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(134.746)
Hongkong-Dollar	Euro	15.997.426	1.963.421	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(45.061)
Hongkong-Dollar	Euro	51.603.840	6.253.332	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(65.166)
Hongkong-Dollar	Euro	471.178.21	5.705.071	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	(54.854)
Japanischer Yen	Euro	1.900.386.497	13.583.676	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(35.072)
Schweizer Franken	Euro	1.629.086	1.661.611	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(4.716)
Schweizer Franken	Euro	1.229.541	1.256.874	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(6.345)
US-Dollar	Euro	58.660.509	57.953.591	15. Feb. 23	State Street Bank	(3.176.733)
US-Dollar	Euro	19.368.607	18.533.412	15. Feb. 23	State Street Bank	(44.711.4)
US-Dollar	Euro	13.930.229	13.361.740	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	(353.770)
US-Dollar	Euro	5.597.211	5.360.898	15. Feb. 23	State Street Bank	(134.254)
US-Dollar	Euro	19.817.683	18.638.193	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(132.550)
US-Dollar	Euro	14.030.347	13.268.444	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(166.984)
US-Dollar	Euro	10.725.495	10.051.485	15. Feb. 23	State Street Bank	(36.077)
US-Dollar	Euro	13.821.715	13.395.043	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(488.402)
EUR						(7.117.834)

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilklasse CHF W (Acc) (Hedged)

Euro	Schweizer Franken	4.311	4.242	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
EUR						3
CHF						3
Schweizer Franken	Euro	725.163	738.747	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.225)
EUR						(2.225)
CHF						(2.192)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilklasse SGD H (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	Euro	14.913	10.387	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30
EUR						30
SGD						43
Euro	Singapur-Dollar	5.140	7.385	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
Euro	Singapur-Dollar	10.257	14.687	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Singapur-Dollar	Euro	21.000	14.699	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
Singapur-Dollar	Euro	2.875.675	2.013.148	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.560)
EUR						(4.611)
SGD						(6.598)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilklasse Sterling H (Acc) (Hedged)						
Euro	Pfund Sterling	7.211	6.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	85
Euro	Pfund Sterling	18.113	15.892	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	201
EUR						286
GBP						254
Pfund Sterling	Euro	1.193.757	1.390.812	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(45.311)
EUR						(45.311)
GBP						(40.183)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilklasse USD H (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	3.593.967	3.398.432	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(34.650)
EUR						(34.650)
USD						(36.994)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 213.088			
(31. Dezember 2021: 280.659)			
252.474	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	213.088	0,35
Irland - 2.261.901			
(31. Dezember 2021: 313.692)			
6.603	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	537.320	0,89
267	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF - ETF	32.081	0,05
211.711	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	1.692.500	2,81
Vereinigtes Königreich - 263.517			
(31. Dezember 2021: 209.528)			
161.915	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	263.517	0,43
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		2.738.506	4,53
Anleihen			
Australien - 1.017.015			
(31. Dezember 2021: -)			
1.095.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	491.909	0,81
984.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	525.106	0,87
Brasilien - 477.281			
(31. Dezember 2021: -)			
4.343.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	477.281	0,79
Frankreich - 699.675			
(31. Dezember 2021: 239.363)			
145.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	98.122	0,16
200.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 23-Mar-2171	165.150	0,27
133.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	106.982	0,18
400.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	329.421	0,55
Deutschland - 78.917			
(31. Dezember 2021: 87.130)			
100.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	78.917	0,13
Irland - 162.378			
(31. Dezember 2021: 178.087)			
200.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Apr-2171	162.378	0,27
Italien - 498.198			
(31. Dezember 2021: 558.492)			
200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7.700% 17-Mar-2171	151.396	0,25
284.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2171	187.446	0,31
200.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2171	159.356	0,27
Luxemburg - 150.175			
(31. Dezember 2021: 174.638)			
199.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	150.175	0,25
Mexiko - 622.830			
(31. Dezember 2021: -)			
15.810.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	622.830	1,03
Neuseeland - 1.178.576			
(31. Dezember 2021: -)			
2.378.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	1.178.576	1,95

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Spanien - 500.861			
(31. Dezember 2021: 534.766)			
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-Dec-2171	171.393	0,28
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jun-2171	173.784	0,29
200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.750% 19-Jun-2171	155.684	0,26
Schweden - 159.688			
(31. Dezember 2021: -)			
200.000	Swedbank AB FRN (Perpetual) 5.625% 17-Mar-2171	159.688	0,26
Schweiz - 299.036			
(31. Dezember 2021: -)			
248.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 5.250% 11-Feb-2171	135.402	0,23
200.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.000% 31-Jul-2171	163.634	0,27
Vereinigtes Königreich - 7.728.724			
(31. Dezember 2021: 4.025.858)			
200.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.750% 15-Dec-2171	162.123	0,27
400.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 8.875% 15-Sep-2171	394.894	0,66
135.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	122.017	0,20
118.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	122.400	0,20
155.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	147.241	0,24
276.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2171	234.160	0,39
400.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 27-Jun-2171	325.641	0,54
5.642.600	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jan-2025	5.243.753	8,69
850.000	United Kingdom Gilt 0.750% 22-Jul-2023	838.636	1,39
176.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	137.859	0,23
Vereinigte Staaten von Amerika - 4.988.737			
(31. Dezember 2021: 1.149.862)			
250.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	222.025	0,37
186.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	121.914	0,20
200.944	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	157.446	0,26
180.012	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6.500% 20-Jun-2027	148.357	0,25
215.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026	131.489	0,22
150.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	148.891	0,25
131.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	111.374	0,18
33.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	25.465	0,04
2.601.100	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	2.137.274	3,54
564.200	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	455.627	0,76
1.809.000	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	1.328.875	2,20
Gesamtanlagen in Anleihen		18.562.091	30,76
Aktien			
Australien - 156.634			
(31. Dezember 2021: -)			
9.942	OZ Minerals Ltd	156.634	0,26
Brasilien - 207.006			
(31. Dezember 2021: -)			
99.568	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	207.006	0,34
China - 95.548			
(31. Dezember 2021: 476.898)			
18.920	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	95.548	0,16

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Dänemark - 193.011			
(31. Dezember 2021: 722.170)			
2.541	Orsted AS '144A'	193.011	0,32
Finnland - 294.668			
(31. Dezember 2021: 271.121)			
7.649	Neste Oyj	294.668	0,49
Frankreich - 686.740			
(31. Dezember 2021: 2.243.887)			
515	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	314.859	0,52
4.630	Sanofi	371.881	0,62
Deutschland - 561.679			
(31. Dezember 2021: 2.326.830)			
12.976	Bayer AG	561.679	0,93
Guernsey - 50.366			
(31. Dezember 2021: 35.653)			
133.420	Amedeo Air Four Plus Ltd	50.366	0,08
Hongkong - 780.365			
(31. Dezember 2021: 902.209)			
55.000	AIA Group Ltd	509.355	0,84
44.400	Link REIT (Units) (REIT)	271.010	0,45
Indien - 329.070			
(31. Dezember 2021: 492.928)			
12.403	Housing Development Finance Corp Ltd	329.070	0,55
Indonesien - 232.455			
(31. Dezember 2021: -)			
438.400	Bank Mandiri Persero Tbk PT	232.455	0,39
Irland - 2.368.650			
(31. Dezember 2021: 3.403.783)			
342.341	Greencoat Renewables Plc	345.341	0,57
2.382	ICON Plc	393.003	0,65
1.574	Linde Plc	431.245	0,71
5.585	Medtronic Plc	361.037	0,60
6.446	Ryanair Holdings Plc ADR	402.480	0,67
3.078	Trane Technologies Plc	435.544	0,72
Japan - 272.318			
(31. Dezember 2021: 1.682.065)			
4.300	Sony Group Corp	272.318	0,45
Niederlande - 760.480			
(31. Dezember 2021: 1.180.298)			
755	ASML Holding NV	341.305	0,57
20.873	Universal Music Group NV	419.175	0,69
Republik Korea - 295.407			
(31. Dezember 2021: 491.842)			
759	Samsung SDI Co Ltd	295.407	0,49
Schweiz - 1.004.886			
(31. Dezember 2021: 2.872.366)			
645	Lonza Group AG	266.253	0,44
5.924	Nestle SA	574.469	0,95
1.709	TE Connectivity Ltd	164.164	0,28
Vereinigtes Königreich - 6.607.523			
(31. Dezember 2021: 6.818.158)			
22.134	3i Group Plc	296.153	0,49
10.945	Anglo American Plc	354.153	0,59
9.229	AstraZeneca Plc	1.037.893	1,72
80.167	BAE Systems Plc	687.031	1,14
11.061	Diageo Plc	403.920	0,67
282.156	Impact Healthcare Reit Plc (REIT) - Class B	299.932	0,50
64.503	Informa Plc	401.725	0,67
53.048	Prudential Plc	602.891	1,00

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigtes Königreich Forts.			
22.177	Relx Plc	509.870	0,84
58.638	Shell Plc	1.371.396	2,27
15.333	Unilever Plc	642.559	1,06
Vereinigte Staaten von Amerika - 7.382.954			
(31. Dezember 2021: 15.012.880)			
16.979	Bank of America Corp	467.455	0,77
297	Booking Holdings Inc	494.146	0,82
2.834	CME Group Inc	398.111	0,66
6.727	ConocoPhillips	650.433	1,08
1.436	Cooper Cos Inc/The	398.916	0,66
10.553	Dominion Energy Inc	540.272	0,89
1.502	Eli Lilly & Co	457.892	0,76
27.583	Exelon Corp	987.937	1,64
1.254	Goldman Sachs Group Inc/The	357.591	0,59
2.879	Hess Corp	336.864	0,56
1.963	Hubbell Inc - Class B	383.901	0,64
1.392	Lockheed Martin Corp	563.153	0,93
2.557	Marathon Petroleum Corp	246.620	0,41
2.342	Microsoft Corp	468.798	0,78
425	Microsoft Corp	85.072	0,14
4.151	NextEra Energy Inc	289.887	0,48
1.176	Norfolk Southern Corp	242.482	0,40
215	Ryanair Holdings Plc ADR	13.424	0,02
Gesamtanlagen in Aktien		22.279.760	36,92
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 1.997.060			
(31. Dezember 2021: 2.230.900)			
132.810	Bluefield Solar Income Fund Ltd	180.954	0,30
334.750	Hipnosis Songs Fund Ltd/The Fund	290.396	0,48
392.207	International Public Partnerships Ltd	594.586	0,99
148.549	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	177.070	0,29
577.819	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	754.054	1,25
Luxemburg - 221.240			
(31. Dezember 2021: 246.440)			
141.097	BBGI Global Infrastructure SA	221.240	0,37
Vereinigtes Königreich - 1.758.680			
(31. Dezember 2021: 1.762.163)			
650.986	BioPharma Credit Plc/The Fund	515.857	0,85
461.346	Greencoat UK Wind Plc/Funds	702.168	1,16
560.264	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	540.655	0,90
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		3.976.980	6,59
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 2.258.069			
(31. Dezember 2021: -)			
7.422	Amundi Physical Gold ETC	446.170	0,74
5.682	Invesco Physical Gold ETC	829.385	1,37
33.382	Ishares Physical Gold ETC	982.514	1,63
Jersey - 385.393			
(31. Dezember 2021: -)			
4.823	WisdomTree Copper - ETC	136.029	0,23
33.232	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	249.364	0,41
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		2.643.462	4,38
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Vereinigte Staaten von Amerika - 815.250			
(31. Dezember 2021: -)			
9.882	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	815.250	1,35
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		815.250	1,35

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Optionsscheine			
Luxemburg - 1.144.373			
(31. Dezember 2021: 890.024)			
11.500	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	1.144.373	1,90
Vereinigtes Königreich - 2.970.127			
(31. Dezember 2021: 2.795.889)			
16.740	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	1.485.123	2,46
17.217	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	1.485.004	2,46
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		4.114.500	6,82
Indeoptionen - 538.395			
(31. Dezember 2021: 540.005)			
37	CBOE S&P 500 Index Call 19-Jan-2023 4,000.000	63.157	0,10
175	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,850.000	348.878	0,58
81	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,550.000	126.360	0,21
Indeoptionen insgesamt		538.395	0,89

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 670.945				
(31. Dezember 2021: 29.700)				
(5)	DAX Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.553.497)	40.083	0,07
(62)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(9.969.610)	273.527	0,45
(132)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(4.470.560)	122.571	0,20
6	Hang Seng Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	636.706	3.865	0,01
(18)	NASDAQ 100 E-Mini Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(3.299.100)	230.899	0,38
Offene Terminkontrakte insgesamt			670.945	1,11
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.037.076 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 208.957)			1.037.076	1,72
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			57.376.965	95,07

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Aktioptionen - (2.124)			
(31. Dezember 2021:)			
(7)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA Put 20- Jan-2023 630.000	(1.825)	(0,00)
(24)	Nike Inc Class B Put 20-Jan-2023 95.000	(299)	(0,00)
Aktioptionen insgesamt		(2.124)	(0,00)
Indeoptionen - (274.177)			
(31. Dezember 2021: (376.900))			
(3)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Jan-2023 3,750.000	(9.512)	(0,02)
(87)	EURO STOXX 50 Index Call 20-Jan-2023 4,100.000	(1.697)	(0,00)
(175)	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,550.000	(184.837)	(0,31)
(81)	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,750.000	(49.815)	(0,08)
(21)	Hang Sang Index Put 20-Jan-2023 18,000.000	(9.959)	(0,02)
(1)	NASDAQ 100 Index Put 19-Jan-2023 10,750.000	(18.357)	(0,03)
Indeoptionen insgesamt		(274.177)	(0,46)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement GBP	Beizulegender Zeitwert GBP	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (219.868)				
(31. Dezember 2021: (46.560))				
12	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.421.014	(34.550)	(0,05)
26	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.698.726	(95.188)	(0,16)
51	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	5.316.467	(90.130)	(0,15)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(219.868)	(0,36)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (608.741) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (180.785))			(608.741)	(1,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(1.104.910)	(1,83)
Nettoumlaufvermögen			4.076.494	6,76
Summe Nettovermögen			60.348.549	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Aktioptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Indeoptionen ist die UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	87,67
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,32
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,95
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	1,67
Sonstiges Umlaufvermögen	7,39
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
Chinesischer Yuan	US-Dollar	2.374.543	342.597	13. Jan. 23	State Street Bank	30
Euro	Pfund Sterling	931.265	821.187	13. Jan. 23	State Street Bank	5.051
Euro	Pfund Sterling	195.675	170.821	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	2.786
Euro	Pfund Sterling	355.434	309.928	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	5.420
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	1.242.915	129.780	15. Feb. 23	UBS AG	2.648
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	3.827.495	407.600	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	207
Hongkong-Dollar	Pfund Sterling	1.511.595	157.811	15. Feb. 23	UBS AG	3.245
Ungarischer Forint	Pfund Sterling	270.337.131	571.065	15. Feb. 23	UBS AG	19.377
Japanischer Yen	Pfund Sterling	2.159.568	13.075	15. Feb. 23	State Street Bank	605
Japanischer Yen	Pfund Sterling	52.889.753	334.127	15. Feb. 23	The Bank of New York Mellon	904
Neuseeländischer Dollar	Pfund Sterling	76.218	39.121	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	1.043
Pfund Sterling	Hongkong-Dollar	576.645	5.215.562	15. Feb. 23	UBS AG	20.944
Pfund Sterling	US-Dollar	18.671.705	21.418.126	15. Feb. 23	State Street Bank	901.471
Pfund Sterling	US-Dollar	354.985	417.876	15. Feb. 23	UBS AG	8.281
Pfund Sterling	US-Dollar	400.160	477.606	15. Feb. 23	State Street Bank	3.899
Pfund Sterling	US-Dollar	51.571	61.123	15. Feb. 23	UBS AG	859
Pfund Sterling	US-Dollar	1.412.738	1.684.341	15. Feb. 23	JPMorgan Chase Bank	15.270
Schweizer Franken	Pfund Sterling	79.727	71.413	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	634
Schweizer Franken	Pfund Sterling	82.418	73.809	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	671
US-Dollar	Pfund Sterling	1.808.190	1.484.207	15. Feb. 23	UBS AG	16.016
US-Dollar	Pfund Sterling	723.601	588.231	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	12.128
US-Dollar	Pfund Sterling	382.084	312.890	15. Feb. 23	UBS AG	4.119
US-Dollar	Pfund Sterling	422.303	342.425	15. Feb. 23	State Street Bank	7.953
US-Dollar	Pfund Sterling	344.161	282.029	15. Feb. 23	UBS AG	3.515
GBP						1.037.076
Pfund Sterling	Euro	981.517	1.136.895	13. Jan. 23	Canadian Imperial Bank	(27.161)
Pfund Sterling	Euro	14.456	16.521	13. Jan. 23	UBS AG	(202)
Pfund Sterling	Euro	211.696	239.670	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(944)
Pfund Sterling	Euro	62.788	71.732	13. Jan. 23	JPMorgan Chase Bank	(854)
Pfund Sterling	Euro	147.845	171.403	13. Jan. 23	UBS AG	(4.228)
Pfund Sterling	Euro	6.334.021	7.179.957	13. Jan. 23	State Street Bank	(36.189)
Pfund Sterling	Euro	99.615	115.729	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(3.063)
Pfund Sterling	Koreanischer Won	358.554	566.243.423	13. Jan. 23	State Street Bank	(14.357)
US-Dollar	Chinesischer Yuan	330.027	2.374.543	13. Jan. 23	State Street Bank	(10.469)
US-Dollar	Euro	5.030.495	5.143.356	13. Jan. 23	State Street Bank	(385.990)
Pfund Sterling	Hongkong-Dollar	425.203	4.001.500	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(1.144)
Pfund Sterling	Japanischer Yen	332.602	55.049.321	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(16.108)
Pfund Sterling	Neuseeländischer Dollar	1.206.194	2.340.331	15. Feb. 23	State Street Bank	(27.072)
Pfund Sterling	Schweizer Franken	926.572	1.040.648	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(13.835)
Pfund Sterling	US-Dollar	151.223	183.420	15. Feb. 23	State Street Bank	(957)
Pfund Sterling	US-Dollar	306.209	371.172	15. Feb. 23	State Street Bank	(1.746)
Pfund Sterling	US-Dollar	79.637	97.499	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(1.257)
Pfund Sterling	US-Dollar	159.424	196.577	15. Feb. 23	UBS AG	(3.672)
US-Dollar	Pfund Sterling	243.067	201.985	15. Feb. 23	State Street Bank	(316)
US-Dollar	Pfund Sterling	344.279	300.516	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(14.874)
US-Dollar	Pfund Sterling	590.417	493.658	15. Feb. 23	UBS AG	(3.800)
US-Dollar	Pfund Sterling	414.347	350.438	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(6.662)
Pfund Sterling	Australischer Dollar	1.181.239	2.138.774	16. Mrz. 23	Barclays Bank PLC	(28.074)
Pfund Sterling	Dänische Krone	213.621	1.832.713	16. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(5.767)
GBP						(608.741)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 966.661			
(31. Dezember 2021: 1.419.211)		966.661	0,28
951.352	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	966.661	0,28
Irland - 13.823.866			
(31. Dezember 2021: 2.104.475)		13.823.866	3,99
32.231	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	3.157.549	0,91
1.387	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF - ETF	200.636	0,06
108.740	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	10.465.681	3,02
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		14.790.527	4,27
Anleihen			
Australien - 4.863.870			
(31. Dezember 2021: -)		4.863.870	1,40
4.351.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	2.353.156	0,68
3.908.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	2.510.714	0,72
Brasilien - 2.696.897			
(31. Dezember 2021: -)		2.696.897	0,78
20.384.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional (Zero Coupon) 0.000% 01-Jan-2026	2.696.897	0,78
Frankreich - 3.317.357			
(31. Dezember 2021: 1.903.546)		3.317.357	0,96
346.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029	279.983	0,08
505.000	Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029	411.414	0,12
179.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	179.838	0,05
365.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 25-Sep-2171	353.751	0,10
682.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Perpetual) 7.875% 23-Mar-2171	677.993	0,20
621.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028	601.367	0,17
820.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	813.011	0,24
Deutschland - 393.333			
(31. Dezember 2021: 486.102)		393.333	0,11
414.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	393.333	0,11
Ungarn - 976.098			
(31. Dezember 2021: -)		976.098	0,28
974.000	Hungary Government International Bond 5.375% 21-Feb-2023	976.098	0,28
Irland - 996.005			
(31. Dezember 2021: 1.222.753)		996.005	0,29
1.019.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Apr-2171	996.005	0,29
Italien - 2.365.342			
(31. Dezember 2021: 2.941.634)		2.365.342	0,68
945.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7.700% 17-Mar-2171	861.210	0,25
897.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2171	712.755	0,20
825.000	UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2171	791.377	0,23
Luxemburg - 526.035			
(31. Dezember 2021: 684.740)		526.035	0,15
579.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	526.035	0,15
Mexiko - 3.518.156			
(31. Dezember 2021: -)		3.518.156	1,02
74.180.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	3.518.156	1,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Niederlande - 348.022			
(31. Dezember 2021: -)		348.022	0,10
361.000	ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2171	348.022	0,10
Neuseeland - 6.574.743			
(31. Dezember 2021: -)		6.574.743	1,90
11.019.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	6.574.743	1,90
Spanien - 3.602.000			
(31. Dezember 2021: 4.298.514)		3.602.000	1,04
600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-Dec-2171	619.022	0,18
800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jun-2171	836.876	0,24
1.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.750% 19-Jun-2171	1.124.569	0,32
1.000.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Dec-2171	1.021.533	0,30
Schweden - 1.736.493			
(31. Dezember 2021: -)		1.736.493	0,50
400.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.250% 01-Mar-2171	390.750	0,11
1.400.000	Swedbank AB FRN (Perpetual) 5.625% 17-Mar-2171	1.345.743	0,39
Schweiz - 1.145.795			
(31. Dezember 2021: -)		1.145.795	0,33
945.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 5.250% 11-Feb-2171	621.149	0,18
249.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Mar-2171	179.896	0,05
350.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.000% 31-Jul-2171	344.750	0,10
Vereinigtes Königreich - 7.100.120			
(31. Dezember 2021: 1.173.322)		7.100.120	2,05
327.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.125% 15-Sep-2171	373.992	0,11
303.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.250% 15-Jun-2171	360.678	0,11
362.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 7.750% 15-Dec-2171	353.276	0,10
1.593.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 8.875% 15-Sep-2171	1.893.334	0,55
675.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	734.483	0,21
589.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	735.540	0,21
909.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	1.039.566	0,30
852.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 27-Jun-2171	835.045	0,24
821.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	774.206	0,22
Vereinigte Staaten von Amerika - 62.024.833			
(31. Dezember 2021: 30.746.845)		62.024.833	17,90
100.000	AT&T Inc 2.900 % 04-Dec-2026	111.078	0,03
659.000	Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030	520.017	0,15
465.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	447.158	0,13
114.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	107.535	0,03
513.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	613.035	0,18
468.000	Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	479.013	0,14
134.000	United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026	124.486	0,04
34.301.200	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	34.320.793	9,90
8.100.000	United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.323% 30-Apr-2024	8.082.152	2,33
9.904.500	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	9.629.418	2,78
8.582.500	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	7.590.148	2,19
Gesamtanlagen in Anleihen		102.185.099	29,49

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 1.487.567			
(31. Dezember 2021: 1.236.276)		1.487.567	0,43
50.770	OZ Minerals Ltd	962.965	0,28
434.053	Star Entertainment Grp Ltd/The	524.602	0,15
Brasilien - 1.165.105			
(31. Dezember 2021: -)		1.165.105	0,34
465.491	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.165.105	0,34
China - 485.777			
(31. Dezember 2021: 3.092.822)		485.777	0,14
79.900	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	485.777	0,14
Dänemark - 1.287.754			
(31. Dezember 2021: 5.344.629)		1.287.754	0,37
14.082	Orsted AS '144A'	1.287.754	0,37
Finnland - 1.635.546			
(31. Dezember 2021: 1.818.287)		1.635.546	0,47
35.265	Neste Oyj	1.635.546	0,47
Frankreich - 4.273.715			
(31. Dezember 2021: 14.541.771)		4.273.715	1,23
2.741	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.017.481	0,58
23.333	Sanofi	2.256.234	0,65
Deutschland - 2.956.315			
(31. Dezember 2021: 16.099.000)		2.956.315	0,85
56.730	Bayer AG	2.956.315	0,85
Guernsey - 250.954			
(31. Dezember 2021: 204.450)		250.954	0,07
552.187	Amedeo Air Four Plus Ltd	250.954	0,07
Hongkong - 4.726.170			
(31. Dezember 2021: 5.719.117)		4.726.170	1,36
293.200	AIA Group Ltd	3.268.980	0,94
198.300	Link REIT (Units) (REIT)	1.457.190	0,42
Indien - 1.972.756			
(31. Dezember 2021: 3.019.964)		1.972.756	0,57
61.762	Housing Development Finance Corp Ltd	1.972.756	0,57
Indonesien - 1.352.279			
(31. Dezember 2021: -)		1.352.279	0,39
2.118.400	Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.352.279	0,39
Irland - 14.051.083			
(31. Dezember 2021: 24.209.117)		14.051.083	4,05
1.383.685	Greencoat Renewables Plc	1.680.420	0,48
12.484	ICON Plc	2.479.697	0,72
8.475	Linde Plc	2.795.437	0,81
29.158	Medtronic Plc	2.269.221	0,65
31.877	Ryanair Holdings Plc ADR	2.396.194	0,69
14.265	Trane Technologies Plc	2.430.114	0,70
Japan - 1.723.089			
(31. Dezember 2021: 10.885.248)		1.723.089	0,50
22.600	Sony Group Corp	1.723.089	0,50
Niederlande - 4.398.457			
(31. Dezember 2021: 7.565.565)		4.398.457	1,27
3.835	ASML Holding NV	2.087.141	0,60
95.600	Universal Music Group NV	2.311.316	0,67
Republik Korea - 1.893.938			
(31. Dezember 2021: 3.316.789)		1.893.938	0,55
4.042	Samsung SDI Co Ltd	1.893.938	0,55
Schweiz - 6.552.228			
(31. Dezember 2021: 19.246.384)		6.552.228	1,89
3.425	Lonza Group AG	1.702.105	0,49

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Schweiz Forts.			
32.426	Nestle SA	3.785.611	1,09
9.205	TE Connectivity Ltd	1.064.512	0,31
Vereinigtes Königreich - 39.807.803			
(31. Dezember 2021: 41.881.840)		39.807.803	11,49
102.278	3i Group Plc	1.647.514	0,48
51.543	Anglo American Plc	2.007.870	0,58
42.543	AstraZeneca Plc	5.759.928	1,66
412.589	BAE Systems Plc	4.256.859	1,23
57.138	Diageo Plc	2.511.984	0,72
1.153.565	Impact Healthcare Reit Plc (REIT) - Class B	1.476.271	0,43
263.672	Informa Plc	1.976.985	0,57
264.486	Prudential Plc	3.618.786	1,04
115.815	Relx Plc	3.205.625	0,93
330.314	Shell Plc	9.300.400	2,68
80.187	Unilever Plc	4.045.581	1,17
Vereinigte Staaten von Amerika - 45.692.770			
(31. Dezember 2021: 106.426.720)		45.692.770	13,19
70.283	Bank of America Corp	2.329.530	0,67
1.493	Booking Holdings Inc	2.990.539	0,86
12.500	CME Group Inc	2.114.000	0,61
36.219	ConocoPhillips	4.216.073	1,22
10.702	Cooper Cos Inc/The	3.579.177	1,03
53.472	Dominion Energy Inc	3.295.747	0,95
6.966	Eli Lilly & Co	2.556.626	0,74
145.519	Exelon Corp	6.274.779	1,81
5.584	Goldman Sachs Group Inc/The	1.917.015	0,55
15.032	Hess Corp	2.117.482	0,61
10.568	Hubbell Inc - Class B	2.488.183	0,72
7.016	Lockheed Martin Corp	3.417.178	0,99
13.916	Marathon Petroleum Corp	1.615.856	0,47
13.682	Microsoft Corp	3.297.157	0,95
20.956	NextEra Energy Inc	1.761.876	0,51
6.401	Norfolk Southern Corp	1.588.952	0,46
1.764	Ryanair Holdings Plc ADR	132.600	0,04
Gesamtanlagen in Aktien		135.713.306	39,16
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 11.801.868			
(31. Dezember 2021: 14.071.017)		11.801.868	3,40
893.934	Bluefield Solar Income Fund Ltd	1.466.334	0,42
1.199.266	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	1.252.495	0,36
1.888.446	International Public Partnerships Ltd	3.446.629	0,99
890.181	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	1.277.454	0,37
2.774.477	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	4.358.956	1,26
Luxemburg - 1.873.853			
(31. Dezember 2021: 1.571.801)		1.873.853	0,54
992.656	BBGI Global Infrastructure SA	1.873.853	0,54
Vereinigtes Königreich - 9.704.884			
(31. Dezember 2021: 11.149.726)		9.704.884	2,80
2.361.664	BioPharma Credit Plc/The Fund	2.253.028	0,65
2.291.173	Greencoat UK Wind Plc/Funds	4.198.202	1,21
2.800.614	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	3.253.654	0,94
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		23.380.605	6,74
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 13.654.880			
(31. Dezember 2021: -)		13.654.880	3,94
38.432	Amundi Physical Gold ETC	2.781.401	0,80
31.626	Invesco Physical Gold ETC	5.557.637	1,60
150.022	Ishares Physical Gold ETC	5.315.842	1,54
Jersey - 2.318.069			
(31. Dezember 2021: -)		2.318.069	0,67
24.242	WisdomTree Copper - ETC	823.137	0,24

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Börsengehandelte Rohstoffe Forts.			
Jersey Forts.			
165.483	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	1.494.932	0,43
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		15.972.949	4,61
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Vereinigte Staaten von Amerika - 8.345.860			
(31. Dezember 2021: -)			
84.030	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	8.345.860	2,41
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		8.345.860	2,41
Optionsscheine			
Luxemburg - 7.247.965			
(31. Dezember 2021: 5.660.056)			
60.500	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	7.247.965	2,09
Vereinigtes Königreich - 16.669.861			
(31. Dezember 2021: 16.322.758)			
79.137	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	8.452.346	2,44
79.137	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	8.217.515	2,37
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		23.917.826	6,90
Indexoptionen - 3.078.593			
(31. Dezember 2021: 3.645.801)			
179	CBOE S&P 500 Index Call 19-Jan-2023 4,000.000	367.845	0,11
836	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,850.000	2.006.466	0,58
375	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,550.000	704.282	0,20
Indexoptionen insgesamt		3.078.593	0,89

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - 3.968.295				
(31. Dezember 2021: 189.596)				
(27)	DAX Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(10.099.388)	263.881	0,07
(292)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(56.527.550)	1.549.533	0,45
(720)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(29.356.975)	804.818	0,23
33	Hang Seng Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	4.215.923	25.599	0,01
(86)	NASDAQ 100 E-Mini Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(18.976.330)	1.324.464	0,38
Offene Terminkontrakte insgesamt		3.968.295	1,14	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 811.455 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.191.163)				
			811.455	0,24
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		332.164.515	95,85	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktioptionen - (12.741)			
(31. Dezember 2021:)			
(35)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA Put 20-Jan-2023 630.000	(10.986)	(0,00)
(117)	Nike Inc Class B Put 20-Jan-2023 95.000	(1.755)	(0,00)
Aktioptionen insgesamt		(12.741)	(0,00)

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Indexoptionen - (1.606.798)			
(31. Dezember 2021: (2.544.192))			
(17)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Jan-2023 3,750.000	(64.889)	(0,02)
(418)	EURO STOXX 50 Index Call 20-Jan-2023 4,100.000	(9.818)	(0,00)
(836)	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,550.000	(1.063.034)	(0,31)
(375)	FTSE 100 Index Call 17-Mar-2023 7,750.000	(277.650)	(0,08)
(103)	Hang Sang Index Put 20-Jan-2023 18,000.000	(58.807)	(0,02)
(6)	NASDAQ 100 Index Put 19-Jan-2023 10,750.000	(132.600)	(0,04)
Indexoptionen insgesamt		(1.606.798)	(0,47)

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement USD	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (1.257.323)				
(31. Dezember 2021: (316.381))				
60	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	8.553.803	(207.132)	(0,06)
126	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	9.910.861	(555.357)	(0,16)
243	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	30.496.500	(494.834)	(0,14)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(1.257.323)	(0,36)	

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (18.323.199) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (362.098))		(18.323.199)	(5,29)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(21.200.061)	(6,12)
Nettoumlaufvermögen		35.573.162	10,27
Summe Nettovermögen		346.537.616	100,00

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.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	85,26
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,25
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,90
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,22
Sonstiges Umlaufvermögen	10,37
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
Euro	US-Dollar	1.844.028	1.838.276	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	131.941
Euro	US-Dollar	5.109.936	5.154.148	13. Jan. 23	HSBC Bank plc	305.469
Euro	US-Dollar	677.688	698.329	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	25.734
Euro	US-Dollar	1.118.258	1.190.372	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	4.410
Euro	US-Dollar	2.033.877	2.162.459	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	10.599
Pfund Sterling	US-Dollar	2.033.955	2.355.884	13. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	93.495
Pfund Sterling	US-Dollar	3.177.296	3.666.107	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	160.135
US-Dollar	Pfund Sterling	581.301	476.771	13. Jan. 23	State Street Bank	7.152
US-Dollar	Pfund Sterling	162.599	133.704	13. Jan. 23	UBS AG	1.587
US-Dollar	Pfund Sterling	585.118	479.545	13. Jan. 23	UBS AG	7.629
US-Dollar	Pfund Sterling	240.622	195.392	13. Jan. 23	State Street Bank	5.323
Hongkong-Dollar	US-Dollar	6.663.543	855.345	15. Feb. 23	UBS AG	380
Hongkong-Dollar	US-Dollar	6.529.477	836.784	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1.725
Japanischer Yen	US-Dollar	308.483.638	2.350.436	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	4.797
Schweizer Franken	US-Dollar	229.856	234.987	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	15.368
Schweizer Franken	US-Dollar	383.829	395.137	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	22.922
US-Dollar	Australischer Dollar	1.155.408	1.675.531	16. Mrz. 23	State Street Bank	12.789
USD						811.455
US-Dollar	Chinesischer Yuan	1.869.103	13.448.196	13. Jan. 23	State Street Bank	(71.398)
US-Dollar	Euro	1.301.942	1.223.447	13. Jan. 23	State Street Bank	(5.227)
US-Dollar	Euro	107.802.055	110.220.626	13. Jan. 23	State Street Bank	(9.961.126)
US-Dollar	Euro	5.167.724	5.201.668	13. Jan. 23	Canadian Imperial Bank	(389.902)
US-Dollar	Euro	440.771	439.211	13. Jan. 23	State Street Bank	(28.496)
US-Dollar	Euro	956.867	923.288	13. Jan. 23	UBS AG	(29.603)
US-Dollar	Euro	369.764	353.207	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	(7.614)
US-Dollar	Euro	540.884	514.453	13. Jan. 23	State Street Bank	(8.774)
US-Dollar	Euro	295.866	281.006	13. Jan. 23	State Street Bank	(4.370)
US-Dollar	Euro	499.025	472.199	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	(5.488)
US-Dollar	Euro	783.928	734.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(895)
US-Dollar	Euro	724.252	680.813	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.936)
US-Dollar	Indische Rupie	3.301.846	275.578.667	13. Jan. 23	State Street Bank	(29.161)
US-Dollar	Pfund Sterling	73.116.295	66.037.534	13. Jan. 23	State Street Bank	(6.409.053)
US-Dollar	Pfund Sterling	369.821	308.019	13. Jan. 23	UBS AG	(1.110)
US-Dollar	Pfund Sterling	1.501.457	1.270.705	13. Jan. 23	UBS AG	(28.784)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	6.594.043	847.647	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	(847)
US-Dollar	Hongkong- Dollar	231.020	1.804.958	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(771)
US-Dollar	Hongkong- Dollar	4.404.824	34.536.678	15. Feb. 23	UBS AG	(30.339)
US-Dollar	Hongkong- Dollar	45.481	355.098	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(120)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.143.855	308.483.638	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(211.378)
US-Dollar	Koreanischer Won	1.702.908	2.312.293.068	15. Feb. 23	State Street Bank	(142.180)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	6.233.115	10.503.893	15. Feb. 23	State Street Bank	(438.305)
US-Dollar	Schweizer Franken	6.563.184	6.385.086	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(391.328)
US-Dollar	Australischer Dollar	9.343.692	13.855.438	16. Mrz. 23	State Street Bank	(104.941)
US-Dollar	Dänische Krone	1.445.801	10.146.160	16. Mrz. 23	HSBC Bank plc	(19.053)
USD						(18.323.199)

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Supranational - 21.060.000			
(31. Dezember 2021: 73.536.026)			
21.060.000	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	21.060.000	3,93
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		21.060.000	3,93
Anleihen			
Australien - 16.404.263			
(31. Dezember 2021: 17.487.860)			
13.950.000	Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026	8.706.513	1,62
8.200.000	Perenti Finance Pty Ltd 'REGS' 6.500% 07-Oct-2025	7.697.750	1,44
Brasilien - 18.003.600		18.003.600	3,36
(31. Dezember 2021: 17.710.970)			
9.000.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025	9.051.840	1,69
9.000.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026	8.951.760	1,67
Ägypten - 1.583.963		1.583.963	0,30
(31. Dezember 2021: 1.695.121)			
1.700.000	Energiean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027	1.583.963	0,30
Finnland - 4.688.392		4.688.392	0,88
(31. Dezember 2021: 8.168.377)			
5.000.000	PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026	4.688.392	0,88
Frankreich - 61.374.097		61.374.097	11,47
(31. Dezember 2021: 48.614.912)			
5.000.000	Altice France SA/France 'REGS' 2.125% 15-Feb-2025	4.749.137	0,89
2.500.000	Altice France SA/France 'REGS' 2.500% 15-Jan-2025	2.410.934	0,45
8.805.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	8.913.023	1,67
7.088.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	7.674.002	1,43
9.000.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	9.393.305	1,75
3.000.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	2.984.059	0,56
6.000.000	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	6.114.840	1,14
2.000.000	Lion/Polaris Lux 4 SA 'REGS' FRN 6.046% 01-Jul-2026	2.006.662	0,38
6.500.000	Paprec Holding SA 'REGS' 4.000% 31-Mar-2025	6.749.191	1,26
4.000.000	Parts Europe SA 'REGS' 6.500% 16-Jul-2025	4.289.574	0,80
1.785.000	Parts Europe SA 'REGS' FRN 5.456% 20-Jul-2027	1.859.274	0,35
4.600.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	4.230.096	0,79
Deutschland - 48.359.070		48.359.070	9,03
(31. Dezember 2021: 57.210.930)			
6.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 1.125% 05-Nov-2079	6.444.318	1,20
5.250.000	IHO Verwaltungs GmbH 'REGS' 3.625% 15-May-2025	5.138.263	0,96
10.000.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	9.239.380	1,73
10.000.000	Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025	10.140.201	1,89
9.671.177	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS' 6.000% 30-Jul-2026	9.769.412	1,83
8.000.000	TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027	7.627.496	1,42
Ghana - 1.815.292		1.815.292	0,34
(31. Dezember 2021: 2.456.685)			
3.000.000	Tullow Oil Plc '144A' 7.000% 01-Mar-2025	1.815.292	0,34
Guatemala - 2.319.391		2.319.391	0,43
(31. Dezember 2021: -)			
25.000.000	Millicom International Cellular SA FRN 4.757% 20-Jan-2027	2.319.391	0,43
Israel - 7.254.375		7.254.375	1,36
(31. Dezember 2021: 6.045.000)			
7.500.000	Energiean Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024	7.254.375	1,36

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Italien - 15.394.275			
(31. Dezember 2021: 22.662.909)			
310.000	Fiber Bidco Spa 'REGS' 11.000% 25-Oct-2027	352.795	0,07
5.305.040	Fiber Bidco Spa 'REGS' FRN 7.950% 25-Oct-2027	5.656.580	1,06
9.250.000	Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 6.934% 30-Sep-2024	9.384.900	1,75
Luxemburg - 42.295.364		42.295.364	7,90
(31. Dezember 2021: 57.493.354)			
11.000.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	10.838.848	2,02
6.500.000	Altice France Holding SA '144A' 8.000% 15-May-2027	5.158.616	0,96
5.000.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2.875% 01-May-2026	4.635.924	0,87
6.382.000	Monitchem HoldCo 2 SA 'REGS' 9.500% 15-Sep-2026	6.388.671	1,19
1.500.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' 5.250% 15-Mar-2025	1.547.312	0,29
2.000.000	Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' FRN 7.296% 15-Mar-2025	2.082.714	0,39
5.000.000	PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	5.064.314	0,95
8.019.368	Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027	6.578.965	1,23
Niederlande - 52.381.853		52.381.853	9,79
(31. Dezember 2021: 73.377.816)			
4.052.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024	4.289.220	0,80
12.850.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 6.007% 01-Apr-2024	13.717.453	2,56
2.306.991	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	1.806.997	0,34
4.404.531	Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025	3.449.938	0,65
10.605.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026	10.419.197	1,95
2.000.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' FRN 5.548% 15-Aug-2026	2.044.561	0,38
4.000.000	United Group BV 'REGS' FRN 5.923% 15-May-2025	3.906.927	0,73
7.000.000	UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028	6.223.560	1,16
7.000.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027	6.524.000	1,22
Nigeria - 4.629.805		4.629.805	0,86
(31. Dezember 2021: 5.307.550)			
5.000.000	IHS Netherlands Holdco BV '144A' 8.000% 18-Sep-2027	4.426.200	0,82
230.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	203.605	0,04
Norwegen - 7.199.824		7.199.824	1,34
(31. Dezember 2021: 10.402.719)			
4.703.000	DNO ASA '144A' 7.875% 09-Sep-2026	4.350.275	0,81
2.856.691	DNO ASA '144A' 8.375% 29-May-2024	2.849.549	0,53
Polen - 2.088.757		2.088.757	0,39
(31. Dezember 2021: -)			
2.352.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	2.088.757	0,39
Spanien - 26.431.335		26.431.335	4,94
(31. Dezember 2021: 8.041.306)			
7.000.000	Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026	7.117.897	1,33
7.000.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	6.942.606	1,30
5.000.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 3.250% 12-Nov-2024	5.159.465	0,96
2.500.000	Lorca Telecom Bondco SA '144A' 4.000% 18-Sep-2027	2.398.465	0,45
5.000.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	4.812.902	0,90
Schweden - 3.888.733		3.888.733	0,73
(31. Dezember 2021: 14.584.806)			
4.000.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	3.888.733	0,73

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Tansania - 8.788.500				
(31. Dezember 2021: 9.879.975)				
9.450.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025	8.788.500	1,64	1,64
Vereinigtes Königreich - 87.101.398				
(31. Dezember 2021: 115.263.612)				
2.500.000	Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026	2.532.599	0,47	
1.250.000	CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027	1.262.748	0,24	
8.475.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	9.305.283	1,74	
3.000.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	3.362.562	0,63	
4.000.000	EC Finance Plc 'REGS' 3.000% 15-Oct-2026	3.888.115	0,73	
2.203.390	EnQuest Plc 9.000% 27-Oct-2027	2.490.176	0,47	
6.015.000	esure Group Plc 6.750% 19-Dec-2024	6.607.371	1,23	
1.000.000	Greene King Finance Plc FRN 5.322% 15-Dec-2034	933.309	0,17	
5.050.000	Harbour Energy Plc 'REGS' 5.500% 15-Oct-2026	4.535.077	0,85	
11.500.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	10.172.668	1,90	
17.000.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026	16.761.468	3,13	
3.250.000	Marston's Issuer Plc FRN 5.549% 16-Jul-2035	2.928.554	0,55	
6.000.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025	5.639.723	1,05	
4.000.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 6.375% 15-Feb-2025	4.197.716	0,78	
4.800.000	Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026	4.931.559	0,92	
2.685.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' FRN 7.512% 31-Jul-2025	2.635.066	0,49	
5.000.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	4.917.404	0,92	
Vereinigte Staaten von Amerika - 83.606.929				
(31. Dezember 2021: 140.595.550)				
7.000.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	6.862.479	1,28	
5.300.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025	5.055.706	0,94	
4.500.000	Avantor Funding Inc 'REGS' 2.625% 01-Nov-2025	4.560.346	0,85	
4.000.000	Avis Budget Finance Plc 'REGS' 4.750% 30-Jan-2026	4.016.716	0,75	
6.021.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2025	6.206.658	1,16	
6.000.000	CITGO Petroleum Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	5.881.080	1,10	
8.000.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027	7.856.197	1,47	
3.000.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026	2.966.324	0,55	
5.000.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	4.905.891	0,92	
3.000.000	Fenix Marine Service Holdings Ltd 8.000% 15-Jan-2024	2.997.735	0,56	
5.450.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	6.091.259	1,14	
11.400.000	OI European Group BV 'REGS' 2.875% 15-Feb-2025	11.781.654	2,20	
7.000.000	Smyrna Ready Mix Concrete LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028	6.277.530	1,17	
3.250.000	Spectrum Brands Inc 'REGS' 4.000% 01-Oct-2026	3.273.810	0,61	
2.571.000	Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026	2.089.426	0,39	
1.000.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2025	988.499	0,19	
1.762.000	Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027	1.795.619	0,34	
Gesamtanlagen in Anleihen		495.609.216	92,59	

Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)				
Vereinigtes Königreich - 10.067.485				
(31. Dezember 2021: 19.924.007)				
3.500.000	Constellation Automotive Group Limited Term Loan 9.190% 15-Jul-2029	1.748.447	0,33	
5.000.000	Parkdean Resorts Richmond UK Holdco Limited Term Loan 7.210% 03-Mar-2024	5.435.228	1,01	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts.				
Vereinigtes Königreich Forts.				
2.887.000	Zephyr Bidco Limited Term Loan 7.709% 06-Jun-2025	2.883.810	0,54	
Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans)		10.067.485	1,88	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.616.361 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 11.959.722)		3.616.361	0,67	
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		530.353.062	99,07	
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (28.018.215) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (1.769.339))		(28.018.215)	(5,23)	
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(28.018.215)	(5,23)	
Nettoumlaufvermögen		32.946.413	6,16	
Summe Nettovermögen		535.281.260	100,00	

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	91,55
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,78
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,64
Sonstiges Umlaufvermögen	6,03
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							
Euro	US-Dollar	230.000	228.795	6. Jan. 23	Morgan Stanley	17.462	
Euro	US-Dollar	2.587.000	2.706.681	10. Jan. 23	Morgan Stanley	63.985	
Euro	US-Dollar	517.000	537.303	10. Jan. 23	HSBC Bank plc	16.402	
US-Dollar	Pfund Sterling	2.251.449	1.839.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	27.099	
US-Dollar	Pfund Sterling	2.585.665	2.101.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	44.416	
Euro	US-Dollar	1.754.000	1.869.432	24. Jan. 23	Morgan Stanley	11.006	
Euro	US-Dollar	3.802.000	3.933.072	24. Jan. 23	Morgan Stanley	142.998	
Euro	US-Dollar	1.579.000	1.577.546	24. Jan. 23	Morgan Stanley	115.277	
Euro	US-Dollar	1.702.000	1.813.956	3. Feb. 23	Morgan Stanley	12.045	
Euro	US-Dollar	1.331.000	1.396.857	3. Feb. 23	Morgan Stanley	31.115	
Euro	US-Dollar	3.060.000	3.100.531	3. Feb. 23	Morgan Stanley	182.409	
						USD	664.214
US-Dollar	Euro	1.899.533	1.825.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(55.034)	
US-Dollar	Euro	6.910.773	6.700.000	10. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	(264.898)	
US-Dollar	Euro	297.076	288.000	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	(11.371)	
US-Dollar	Euro	56.414.868	57.746.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(5.430.847)	
US-Dollar	Euro	1.764.024	1.747.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(107.005)	
US-Dollar	Euro	2.784.707	2.839.000	10. Jan. 23	RBC Capital Markets	(255.850)	
US-Dollar	Euro	2.519.101	2.493.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(150.891)	
US-Dollar	Schwedische Krone	2.166.473	23.357.000	10. Jan. 23	Morgan Stanley	(72.856)	
US-Dollar	Australischer Dollar	8.687.936	13.118.000	19. Jan. 23	Morgan Stanley	(249.748)	
Pfund Sterling	US-Dollar	135.000	164.198	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(909)	
US-Dollar	Pfund Sterling	49.049.549	43.575.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(3.656.277)	
US-Dollar	Pfund Sterling	2.521.437	2.240.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(187.939)	
US-Dollar	Pfund Sterling	459.920	410.000	20. Jan. 23	Morgan Stanley	(35.992)	
US-Dollar	Euro	36.534.803	37.290.000	24. Jan. 23	UBS AG	(3.443.272)	
US-Dollar	Euro	36.541.546	37.300.000	24. Jan. 23	HSBC Bank plc	(3.447.250)	
US-Dollar	Euro	1.820.608	1.711.000	24. Jan. 23	UBS AG	(13.730)	
US-Dollar	Euro	3.247.217	3.071.000	24. Jan. 23	Morgan Stanley	(45.158)	
US-Dollar	Euro	1.064.977	1.050.000	3. Feb. 23	Morgan Stanley	(61.522)	
US-Dollar	Euro	3.430.535	3.217.000	3. Feb. 23	Morgan Stanley	(20.844)	
US-Dollar	Euro	70.409.305	71.367.000	3. Feb. 23	HSBC Bank plc	(6.157.229)	
US-Dollar	Euro	1.170.047	1.186.000	3. Feb. 23	HSBC Bank plc	(102.360)	
US-Dollar	Euro	72.092.050	69.013.000	14. Feb. 23	Morgan Stanley	(2.002.014)	
US-Dollar	Euro	2.054.068	1.935.000	14. Feb. 23	HSBC Bank plc	(23.396)	
						USD	(25.796.392)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)							
Schweizer Franken	US-Dollar	8.651	9.323	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	45	
Schweizer Franken	US-Dollar	27.678	29.894	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	74	
Schweizer Franken	US-Dollar	1.068	1.147	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10	
Schweizer Franken	US-Dollar	8.733	9.367	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	88	
Schweizer Franken	US-Dollar	1.504.332	1.617.332	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11.504	
US-Dollar	Schweizer Franken	5.708	5.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20	
						USD	11.741
						CHF	10.856
Schweizer Franken	US-Dollar	34.969	37.998	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(135)	
US-Dollar	Schweizer Franken	4.509	4.170	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Schweizer Franken	11.155	10.367	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70)	
US-Dollar	Schweizer Franken	1.261	1.167	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Schweizer Franken	8.736	8.088	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)	
US-Dollar	Schweizer Franken	5.859	5.463	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(56)	
US-Dollar	Schweizer Franken	9.223	8.588	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(76)	
						USD	(368)
						CHF	(340)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	451.542	479.447	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.906	
Euro	US-Dollar	26.324	28.086	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	95	
Euro	US-Dollar	52.115	55.638	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	189	
Euro	US-Dollar	91.150	96.845	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	798	
Euro	US-Dollar	370.689	394.149	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.943	
Euro	US-Dollar	266.406	282.785	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.597	
Euro	US-Dollar	515.855	548.206	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.393	
Euro	US-Dollar	9.988	10.620	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	79	
Euro	US-Dollar	34.000	36.088	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	333	
Euro	US-Dollar	25.518	27.170	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	165	
Euro	US-Dollar	315.181	334.819	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.813	
Euro	US-Dollar	89.988	95.007	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.390	
Euro	US-Dollar	57.659.448	61.001.412	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	765.075	
						USD	784.776
						EUR	733.127
US-Dollar	Euro	96.783	91.150	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(789)	
US-Dollar	Euro	55.604	52.115	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(187)	
US-Dollar	Euro	28.103	26.324	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(96)	
US-Dollar	Euro	479.753	451.542	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.952)	
US-Dollar	Euro	63.111	59.355	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(471)	
US-Dollar	Euro	15.611	14.707	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(143)	
US-Dollar	Euro	21.315	20.046	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(159)	
US-Dollar	Euro	124.800	117.457	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.024)	
US-Dollar	Euro	159.942	150.686	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.477)	
US-Dollar	Euro	377.559	355.337	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.088)	
US-Dollar	Euro	18.223	17.026	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)	
US-Dollar	Euro	32.934	30.910	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(177)	
US-Dollar	Euro	60.186	56.967	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(838)	
US-Dollar	Euro	225.785	213.303	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.712)	
						USD	(15.129)
						EUR	(14.133)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	238	253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	US-Dollar	12.323	13.090	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	110	
Euro	US-Dollar	95	101	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	2.246.037	2.376.218	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	29.802	
						USD	29.915
						EUR	27.946
US-Dollar	Euro	253	238	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
US-Dollar	Euro	433.277	408.203	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.002)	
US-Dollar	Euro	14.746	13.878	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(121)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	3.035	2.851	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
					USD	(4.143)
					EUR	(3.870)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	355.000	377.468	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.819
Euro	US-Dollar	1.079.006	1.145.344	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10.519
Euro	US-Dollar	760.030	806.715	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7.451
Euro	US-Dollar	64.679	68.709	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	577
Euro	US-Dollar	200.000	213.102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.144
Euro	US-Dollar	80.000	84.521	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.177
Euro	US-Dollar	11.454.879	12.118.808	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	151.993
					USD	175.680
					EUR	164.118
US-Dollar	Euro	110.184	103.682	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(883)
US-Dollar	Euro	39.223	36.887	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(292)
US-Dollar	Euro	76.772	72.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(628)
					USD	(1.803)
					EUR	(1.684)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	22.902	24.329	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	204
Euro	US-Dollar	10.796	11.503	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	62
Euro	US-Dollar	4.108.690	4.346.831	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	54.518
					USD	54.784
					EUR	51.178
US-Dollar	Euro	26.950	25.364	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(220)
					USD	(220)
					EUR	(206)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	44.415	47.160	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	384
Euro	US-Dollar	16.343	17.437	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	4.235	4.521	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	45.015	47.559	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	662
Euro	US-Dollar	18.197	19.389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	104
Euro	US-Dollar	781.282	829.959	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.973
Euro	US-Dollar	761.580	815.120	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	707
Euro	US-Dollar	38.027	40.489	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	246
Euro	US-Dollar	62.276	66.101	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	611
Euro	US-Dollar	59.257	62.961	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	517
Euro	US-Dollar	7.829	8.325	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	62

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag Abrechnungs- (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	59.015	62.716	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	503
Euro	US-Dollar	108.263	114.920	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.055
Euro	US-Dollar	7.465	7.938	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	13.824	14.688	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	121
Euro	US-Dollar	25.229	26.705	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	321
Euro	US-Dollar	139.290.870	147.364.221	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.848.230
					USD	1.860.629
					EUR	1.738.174

US-Dollar	Euro	14.679	13.824	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(120)
US-Dollar	Euro	4.518	4.235	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	17.448	16.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(59)
US-Dollar	Euro	47.190	44.415	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(389)
US-Dollar	Euro	41.695	39.213	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(311)
US-Dollar	Euro	6.237	5.875	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57)
US-Dollar	Euro	402.070	378.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.222)
US-Dollar	Euro	29.948	28.164	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(223)
US-Dollar	Euro	32.600	30.713	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(301)
US-Dollar	Euro	913.840	860.053	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.473)
US-Dollar	Euro	21.965	20.629	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(134)
US-Dollar	Euro	38.567	36.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(33)
US-Dollar	Euro	3.018	2.833	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Euro	23.670	22.404	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(330)
US-Dollar	Euro	43.791	41.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(526)
					USD	(13.209)
					EUR	(12.340)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	1.209	1.283	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	243	259	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	6.648	7.062	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59
Euro	US-Dollar	1.185.302	1.254.002	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15.728
					USD	15.799
					EUR	14.759
US-Dollar	Euro	1.284	1.209	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	33.825	31.812	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(253)
US-Dollar	Euro	590	555	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	7.735	7.279	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(63)
US-Dollar	Euro	647	605	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(332)
					EUR	(310)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	11.558	13.925	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	48
----------------	-----------	--------	--------	------------	-----------------------------	----

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	310	374	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Pfund Sterling	US-Dollar	13.575	16.341	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	76
Pfund Sterling	US-Dollar	1.537	1.853	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6
Pfund Sterling	US-Dollar	28.202	34.043	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	62
Pfund Sterling	US-Dollar	79.211	95.437	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	353
Pfund Sterling	US-Dollar	38.982	47.138	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
US-Dollar	Pfund Sterling	893	739	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	5.835	4.762	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	76
US-Dollar	Pfund Sterling	2.250	1.833	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33
US-Dollar	Pfund Sterling	1.112	905	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18
US-Dollar	Pfund Sterling	7.365	5.952	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	167
US-Dollar	Pfund Sterling	2.952	2.373	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	82
US-Dollar	Pfund Sterling	3.190	2.618	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	25
US-Dollar	Pfund Sterling	217.462	178.477	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.630
US-Dollar	Pfund Sterling	4.128	3.392	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26
US-Dollar	Pfund Sterling	3.220	2.649	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16
US-Dollar	Pfund Sterling	13.891	11.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	101
					USD	2.723
					GBP	2.252
US-Dollar	Pfund Sterling	1.852	1.537	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Pfund Sterling	34.034	28.202	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(62)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.492	10.421	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(152)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.052	12.352	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(196)
Pfund Sterling	US-Dollar	4.405	5.451	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(123)
Pfund Sterling	US-Dollar	172.609	210.100	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.365)
Pfund Sterling	US-Dollar	29.519	36.720	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.023)
Pfund Sterling	US-Dollar	62.260	75.887	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(596)
Pfund Sterling	US-Dollar	31.521	38.364	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(246)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.530	12.797	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(63)
Pfund Sterling	US-Dollar	39.974	48.695	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(354)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.998	13.477	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(176)
Pfund Sterling	US-Dollar	30.544.459	37.553.365	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(615.989)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.595	5.474	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.821	17.297	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(96)
US-Dollar	Pfund Sterling	13.929	11.558	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(48)
US-Dollar	Pfund Sterling	374	310	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(620.520)
					GBP	(513.272)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	27.501	33.196	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	61
Pfund Sterling	US-Dollar	4.524	5.446	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	25
Pfund Sterling	US-Dollar	5.933	7.148	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27
Pfund Sterling	US-Dollar	6.322	7.644	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts.						
Pfund Sterling	US-Dollar	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	70	58	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	748	614	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Pfund Sterling	313	258	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	1.439	1.182	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9
US-Dollar	Pfund Sterling	25.115	20.613	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	188
US-Dollar	Pfund Sterling	476	390	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
					USD	321
					GBP	266
US-Dollar	Pfund Sterling	33.188	27.501	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(60)
Pfund Sterling	US-Dollar	9.946	12.116	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(88)
Pfund Sterling	US-Dollar	5.124	6.228	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
Pfund Sterling	US-Dollar	5.230	6.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(41)
Pfund Sterling	US-Dollar	2.037	2.483	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(20)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.228	1.527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(43)
Pfund Sterling	US-Dollar	19.946	24.279	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(158)
Pfund Sterling	US-Dollar	6.825	8.444	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(191)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.703	2.093	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(33)
Pfund Sterling	US-Dollar	889	1.091	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)
Pfund Sterling	US-Dollar	3.526.865	4.336.160	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71.126)
US-Dollar	Pfund Sterling	47.212	39.221	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(218)
					USD	(72.025)
					GBP	(59.576)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Pfund Sterling	128.001	105.054	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	959
					USD	959
					GBP	793
Pfund Sterling	US-Dollar	104.100	126.711	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(823)
Pfund Sterling	US-Dollar	18.138.748	22.300.968	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(365.803)
					USD	(366.626)
					GBP	(303.260)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Pfund Sterling	33.602	27.578	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	252
					USD	252
					GBP	208
Pfund Sterling	US-Dollar	27.353	33.295	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(216)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged) Forts.

Pfund Sterling	US-Dollar	4.762.784	5.855.680	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(96.051)
					USD	(96.267)
					GBP	(79.629)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Pfund Sterling	7.521	6.174	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	55
US-Dollar	Pfund Sterling	3.058	2.510	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
					USD	78
					GBP	65
Pfund Sterling	US-Dollar	2.443	2.974	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
Pfund Sterling	US-Dollar	431.374	530.360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8.700)
					USD	(8.719)
					GBP	(7.212)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	5.051	6.085	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	21
Pfund Sterling	US-Dollar	57	69	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	6	8	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Pfund Sterling	US-Dollar	93.175	112.260	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	416
Pfund Sterling	US-Dollar	197.895	238.212	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.102
Pfund Sterling	US-Dollar	6.552	7.909	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Pfund Sterling	US-Dollar	16.819	20.337	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	2.063	1.706	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	16.931	13.899	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	123
US-Dollar	Pfund Sterling	555	456	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
US-Dollar	Pfund Sterling	15.691	12.892	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	100
US-Dollar	Pfund Sterling	354.996	291.355	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.660
US-Dollar	Pfund Sterling	721	580	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20
US-Dollar	Pfund Sterling	404.203	326.675	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.155
US-Dollar	Pfund Sterling	9.725	7.914	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	155
US-Dollar	Pfund Sterling	6.514	5.308	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	95
US-Dollar	Pfund Sterling	31.243	25.497	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	409
US-Dollar	Pfund Sterling	27.567	22.617	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	216
US-Dollar	Pfund Sterling	69	57	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	14.490
					GBP	11.986
US-Dollar	Pfund Sterling	7.907	6.552	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)
Pfund Sterling	US-Dollar	36.147	44.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(320)
Pfund Sterling	US-Dollar	99.736	121.210	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(599)
Pfund Sterling	US-Dollar	17.343	21.108	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(135)
Pfund Sterling	US-Dollar	6.375	7.770	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(61)
Pfund Sterling	US-Dollar	30.472	37.906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.056)

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.

Pfund Sterling	US-Dollar	284.104	345.813	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.246)
Pfund Sterling	US-Dollar	139.894	173.094	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.921)
Pfund Sterling	US-Dollar	64.600	79.382	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.261)
Pfund Sterling	US-Dollar	12.523	15.345	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(201)
Pfund Sterling	US-Dollar	50.207.263	61.728.107	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.012.528)
US-Dollar	Pfund Sterling	6.087	5.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.124	4.257	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Pfund Sterling	20.199	16.765	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(75)
					USD	(1.022.462)
					GBP	(845.744)

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen			
Guernsey - 219.717			
(31. Dezember 2021: -)			
216.237	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	219.717	0,85
Norwegen - 156.127			
(31. Dezember 2021: 203.942)			
158.520	Aquila European Renewables Plc	156.127	0,61
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		375.844	1,46
Anleihen			
Australien - 401.704			
(31. Dezember 2021: 535.292)			
280.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	151.432	0,59
380.000	Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029	250.272	0,97
Österreich - 202.258			
(31. Dezember 2021: 339.714)			
190.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 3.150% 20-Jun-2044	202.258	0,78
Kaiman-Inseln - 154.734			
(31. Dezember 2021: 185.294)			
200.000	Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030	154.734	0,60
Kolumbien - 107.181			
(31. Dezember 2021: 148.726)			
608.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.500% 26-Aug-2026	107.181	0,41
Deutschland - 195.397			
(31. Dezember 2021: 241.446)			
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	99.606	0,39
100.000	Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Apr-2171	95.791	0,37
Mexiko - 282.507			
(31. Dezember 2021: 298.010)			
3.790.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	172.965	0,67
2.200.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	109.542	0,42
Neuseeland - 262.189			
(31. Dezember 2021: 305.970)			
320.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	262.189	1,02
Spanien - 153.074			
(31. Dezember 2021: 197.344)			
130.000	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028	153.074	0,59
Vereinigte Staaten von Amerika - 5.845.678			
(31. Dezember 2021: 3.079.027)			
100.000	American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025	106.918	0,41
20.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028	18.866	0,07
149.000	T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029	131.664	0,51
47.000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030	42.736	0,17
600.000	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	600.343	2,32
435.900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	423.921	1,64
532.329	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	507.858	1,97
525.538	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15-Apr-2032	601.894	2,33
855.500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	801.396	3,10
615.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	561.728	2,18
625.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	534.497	2,07
625.900	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	596.121	2,31

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
332.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	302.762	1,17
745.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	614.974	2,38
Gesamtanlagen in Anleihen		7.604.722	29,44
Aktien			
Australien - 175.865			
(31. Dezember 2021: 177.681)			
54.394	Insurance Australia Group Ltd	175.865	0,68
China - 182.411			
(31. Dezember 2021: 169.281)			
27.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	182.411	0,71
Dänemark - 116.503			
(31. Dezember 2021: 199.331)			
2.305	Novozymes A/S	116.503	0,45
Frankreich - 396.555			
(31. Dezember 2021: 756.311)			
4.101	Sanofi	396.555	1,54
Deutschland - 374.681			
(31. Dezember 2021: 678.022)			
3.638	SAP SE	374.681	1,45
Hongkong - 526.248			
(31. Dezember 2021: 502.097)			
47.200	AIA Group Ltd	526.248	2,04
Indien - 370.236			
(31. Dezember 2021: 277.455)			
5.414	HDFC Bank Ltd ADR	370.236	1,43
Irland - 569.378			
(31. Dezember 2021: 421.255)			
126.106	Greencoat Renewables Plc	153.150	0,59
4.530	Smurfit Kappa Group Plc	168.191	0,65
1.456	Trane Technologies Plc	248.037	0,96
Japan - 1.256.500			
(31. Dezember 2021: 1.909.502)			
1.200	FANUC Corp	180.546	0,70
6.000	Recruit Holdings Co Ltd	190.133	0,73
5.800	Sony Group Corp	442.209	1,71
9.300	Suzuki Motor Corp	301.518	1,17
12.200	Topcon Corp	142.094	0,55
Niederlande - 432.598			
(31. Dezember 2021: 319.324)			
17.893	Universal Music Group NV	432.598	1,67
Neuseeland - 97.038			
(31. Dezember 2021: 142.631)			
63.698	SKYCITY Entertainment Group Ltd	97.038	0,38
Republik Korea - 347.675			
(31. Dezember 2021: 431.210)			
742	Samsung SDI Co Ltd	347.675	1,35
Schweiz - 1.472.579			
(31. Dezember 2021: 1.081.752)			
3.342	Alcon Inc	230.672	0,89
717	Chubb Ltd	159.228	0,62
519	Lonza Group AG	257.925	1,00
845	Roche Holding AG	268.012	1,04
2.507	TE Connectivity Ltd	289.922	1,12
553	Zurich Insurance Group AG	266.820	1,03

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigtes Königreich - 2.560.912			
(31. Dezember 2021: 3.971.896)			
2.897	Ashtead Group Plc	165.526	0,64
2.169	AstraZeneca Plc	293.663	1,14
56.714	Barclays Plc	108.589	0,42
1.844	Ferguson Plc	231.212	0,90
97.981	Hays Plc	136.361	0,53
26.668	Informa Plc	199.954	0,77
1.265	Linde Plc	417.254	1,62
11.784	National Grid Plc	142.293	0,55
24.175	Prudential Plc	330.771	1,28
8.169	RELX Plc	226.001	0,87
2.219	Unilever Plc	111.927	0,43
160.720	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	197.361	0,76
Vereinigte Staaten von Amerika - 6.236.639			
(31. Dezember 2021: 9.580.897)			
2.994	Abbott Laboratories	330.313	1,28
1.322	Accenture Plc - Class A	354.805	1,38
1.391	Albermarle Corp	302.591	1,17
6.160	Alphabet Inc - Class A	544.729	2,11
2.400	Amazon.com Inc	201.936	0,78
3.250	Apple Inc	421.151	1,63
2.170	Applied Materials Inc	210.750	0,82
785	Assurant Inc	99.385	0,38
1.719	CME Group Inc	290.717	1,13
514	Cooper Cos Inc/The	171.902	0,67
884	Ecolab Inc	130.567	0,50
707	Eli Lilly & Co	259.480	1,00
4.939	Exelon Corp	212.970	0,82
678	Goldman Sachs Group Inc/The	232.761	0,90
1.297	Hubbell Inc - Class B	305.372	1,18
29.460	Laureate Education Inc	288.266	1,12
1.033	Mastercard Inc	359.732	1,39
5.086	Medtronic Plc	395.818	1,53
3.020	Microsoft Corp	727.775	2,82
3.057	Otis Worldwide Corp	241.732	0,94
3.053	Toll Brothers Inc	153.887	0,60
Gesamtanlagen in Aktien		15.115.818	58,52
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 145.002			
(31. Dezember 2021: 166.788)			
92.294	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	145.002	0,56
Vereinigtes Königreich - 912.637			
(31. Dezember 2021: 1.241.232)			
219.434	Greencoat UK Wind Plc/Funds	402.077	1,56
488.862	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	510.560	1,97
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		1.057.639	4,09

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 529.735			
(31. Dezember 2021: 1.499.596)			
14.950	iShares Physical Gold ETC	529.735	2,05
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		529.735	2,05
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 142.246 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 45.467)			
		142.246	0,55
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		24.826.004	96,11
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (132.984) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (136.007))			
		(132.984)	(0,51)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(132.984)	(0,51)
Nettoumlaufvermögen		1.136.296	4,40
Summe Nettovermögen		25.829.316	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			95,05
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,55
Sonstiges Umlaufvermögen			4,40
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
US-Dollar	Pfund Sterling	842.574	761.000	13. Jan. 23	State Street Bank	(73.856)
US-Dollar	Euro	462.383	456.811	15. Feb. 23	State Street Bank	(26.816)
US-Dollar	Neuseeländi- scher Dollar	242.843	409.232	15. Feb. 23	State Street Bank	(17.076)
US-Dollar	Australischer Dollar	474.287	703.304	16. Mrz. 23	State Street Bank	(5.327)
USD						(123.075)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	247.442	181.255	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.718
Kanadischer Dollar	US-Dollar	373.235	275.245	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	747
Kanadischer Dollar	US-Dollar	35.686.275	26.248.789	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	139.781
USD						142.246
CAD						192.373
US-Dollar	Kanadischer Dollar	184.536	249.964	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(302)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	162.412	220.655	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(754)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	147.183	200.411	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.013)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	152.846	208.409	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.264)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	385.016	527.488	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.040)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	176.225	240.392	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.536)
USD						(9.909)
CAD						(13.401)

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Grundstoffe - 826.329.000			
(31. Dezember 2021: -)			
381.500	ADEKA Corp	826.329.000	3,54
Kommunikationsdienstleistungen - 3.930.990.250			
(31. Dezember 2021: 2.614.136.450)			
386.100	Atrae Inc	450.578.700	1,93
721.600	Direct Marketing MiX Inc	1.121.727.200	4,80
260.900	Fibergate Inc/Japan	237.027.650	1,01
875.200	Vector Inc	1.171.455.200	5,02
676.300	Vision Inc/Tokyo Japan	950.201.500	4,07
Kommunikation - 631.309.500			
(31. Dezember 2021: -)			
238.500	Minkabu The Infonoid Inc	631.309.500	2,70
Nicht-Basiskonsumgüter - 2.254.983.200			
(31. Dezember 2021: 2.379.315.850)			
322.600	Nifco Inc/Japan	1.001.673.000	4,29
307.300	Resorttrust Inc	722.155.000	3,09
445.600	Yonex Co Ltd	531.155.200	2,27
Basiskonsumgüter - 906.457.000			
(31. Dezember 2021: 771.730.000)			
150.200	Ain Holdings Inc	906.457.000	3,88
Nicht-zyklische Konsumgüter - 681.472.000			
(31. Dezember 2021: -)			
266.200	Nakanishi Inc	681.472.000	2,92
Finanzwerte - 2.375.009.700			
(31. Dezember 2021: 2.239.146.500)			
1.093.300	Anicom Holdings Inc	635.753.950	2,72
580.900	Premium Group Co Ltd	1.009.313.750	4,32
144.400	Zenkoku Hosho Co Ltd	729.942.000	3,13
Gesundheitswesen - 300.997.400			
(31. Dezember 2021: 532.681.200)			
333.700	Japan Medical Dynamic Marketing Inc	300.997.400	1,29
Industrie - 2.478.808.000			
(31. Dezember 2021: 3.042.274.100)			
1.008.400	Aida Engineering Ltd	787.056.200	3,37
628.200	Insource Co Ltd	979.363.800	4,19
500.800	TRE Holdings Corp	712.388.000	3,05
Informationstechnologie - 6.205.405.000			
(31. Dezember 2021: 6.697.386.850)			
187.200	BrainPad Inc	138.621.600	0,59
1.020.200	MCJ Co Ltd	965.109.200	4,13
807.400	m-up Holdings Inc	1.157.811.600	4,96
463.600	Optoron Co Ltd	1.041.013.800	4,46
256.400	RS Technologies Co Ltd	911.502.000	3,90
86.300	Sanken Electric Co Ltd	565.696.500	2,42
591.100	TechMatrix Corp	1.088.215.100	4,66
577.800	Wacom Co Ltd	337.435.200	1,45
Grundstoffe - 1.535.684.250			
(31. Dezember 2021: 1.532.297.200)			
176.100	Dowa Holdings Co Ltd	729.494.250	3,12
767.800	Sakata INX Corp	806.190.000	3,45

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Versorger - 795.425.400			
(31. Dezember 2021: 700.434.000)			
382.600	Nippon Gas Co Ltd	795.425.400	3,40
Gesamtanlagen in Aktien		22.922.870.700	98,13
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 7.278.763 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 149.024.725)		7.278.763	0,03
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		22.930.149.463	98,16
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (205.976.575) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (10.069.632))		(205.976.575)	(0,88)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(205.976.575)	(0,88)
Nettoumlaufvermögen		634.722.234	2,72
Summe Nettovermögen		23.358.895.122	100,00
Portfolioanalyse			
% des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			96,99
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,03
Sonstiges Umlaufvermögen			2,98
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Schweizer Franken	1.224.107	8.325	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	35.542
Japanischer Yen	Schweizer Franken	2.345.669	16.030	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	57.049
Japanischer Yen	Schweizer Franken	2.077.349	14.142	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58.247
Schweizer Franken	Japanischer Yen	10.701	1.520.786	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7.057
					JPY	157.895
					CHF	1.106
Japanischer Yen	Schweizer Franken	1.907.717	13.420	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8.277)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	3.381.165	23.720	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.329)
Japanischer Yen	Schweizer Franken	5.374.159	37.958	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(45.118)
Schweizer Franken	Japanischer Yen	29.613	4.285.787	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57.933)
Schweizer Franken	Japanischer Yen	8.789	1.283.752	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28.939)
Schweizer Franken	Japanischer Yen	8.868	1.293.421	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27.363)
Schweizer Franken	Japanischer Yen	1.433.360	209.716.978	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.075.139)
					JPY	(5.248.098)
					CHF	(36.752)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	10.491	1.468.837	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5.929
Japanischer Yen	Euro	45.214.863	317.865	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	533.059
Japanischer Yen	Euro	1.805.593	12.815	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.222
Japanischer Yen	Euro	1.152.093	7.935	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	36.730
Japanischer Yen	Euro	2.139.977	14.805	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58.926
Japanischer Yen	Euro	1.969.566	13.611	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	56.313
					JPY	695.179
					EUR	4.942
Euro	Japanischer Yen	317.865	45.238.055	5. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(532.270)
Euro	Japanischer Yen	28.554	4.069.312	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(55.537)
Euro	Japanischer Yen	8.460	1.214.689	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25.411)
Euro	Japanischer Yen	8.443	1.211.326	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24.533)
Euro	Japanischer Yen	1.376.920	197.811.376	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.259.581)
Japanischer Yen	Euro	3.195.981	22.817	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11.387)
Japanischer Yen	Euro	5.076.733	36.445	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(46.307)
					JPY	(4.955.026)
					EUR	(35.225)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	20.848	2.918.761	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11.781
Japanischer Yen	Euro	3.609.998	25.621	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.440
Japanischer Yen	Euro	1.598.213	11.351	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.652
Japanischer Yen	Euro	2.340.350	16.118	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	74.613
Japanischer Yen	Euro	221	2	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Japanischer Yen	Euro	4.307.573	29.800	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	118.613

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.						
Japanischer Yen	Euro	3.968.992	27.428	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	113.480
					JPY	329.586
					EUR	2.343
Euro	Japanischer Yen	56.579	8.063.276	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(110.045)
Euro	Japanischer Yen	16.866	2.421.553	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(50.658)
Euro	Japanischer Yen	5.992	867.308	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25.057)
Euro	Japanischer Yen	16.800	2.410.336	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(48.818)
Euro	Japanischer Yen	25	3.608	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(94)
Euro	Japanischer Yen	2.752.071	395.368.576	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8.513.689)
Japanischer Yen	Euro	6.383.135	45.571	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22.743)
Japanischer Yen	Euro	10.176.864	73.058	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(92.828)
					JPY	(8.863.932)
					EUR	(63.014)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	30.028	4.204.003	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16.969
Japanischer Yen	Euro	5.167.831	36.678	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12.082
Japanischer Yen	Euro	3.297.433	22.710	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	105.125
Japanischer Yen	Euro	6.124.897	42.372	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	168.654
Japanischer Yen	Euro	5.637.159	38.956	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	161.175
					JPY	464.005
					EUR	3.299
Euro	Japanischer Yen	81.725	11.646.911	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(158.954)
Euro	Japanischer Yen	24.215	3.476.597	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(72.729)
Euro	Japanischer Yen	24.164	3.466.978	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70.219)
Euro	Japanischer Yen	3.940.929	566.162.470	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12.191.488)
Japanischer Yen	Euro	9.147.324	65.306	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32.592)
Japanischer Yen	Euro	14.530.288	104.311	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(132.538)
					JPY	(12.658.520)
					EUR	(89.989)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	Japanischer Yen	4.900	686.019	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.769
Japanischer Yen	Euro	842.007	5.976	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.969
Japanischer Yen	Euro	535.685	3.689	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17.078
Japanischer Yen	Euro	997.325	6.900	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27.462
Japanischer Yen	Euro	917.142	6.338	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26.222
					JPY	75.500
					EUR	537
Euro	Japanischer Yen	13.345	1.901.908	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25.956)
Euro	Japanischer Yen	3.952	567.449	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11.871)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	Japanischer Yen	3.944	565.853	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11.460)
Euro	Japanischer Yen	642.493	92.301.985	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.987.589)
Japanischer Yen	Euro	1.490.808	10.643	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.312)
Japanischer Yen	Euro	2.368.438	17.003	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21.604)
						JPY (2.063.792)
						EUR (14.671)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	Norwegische Krone	9.522	709	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33
Japanischer Yen	Norwegische Krone	16.671	1.245	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	13
Japanischer Yen	Norwegische Krone	6.187	448	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	190
Japanischer Yen	Norwegische Krone	10.847	789	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	288
Japanischer Yen	Norwegische Krone	10.570	770	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	262
Norwegische Krone	Japanischer Yen	572	7.652	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						JPY 788
						NOK 59
Japanischer Yen	Norwegische Krone	26.374	1.995	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(312)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	1.573	21.341	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(300)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	453	6.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(193)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	454	6.253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(179)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	75.677	1.034.192	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21.682)
						JPY (22.666)
						NOK (1.692)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	Norwegische Krone	9.889	737	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34
Japanischer Yen	Norwegische Krone	17.336	1.295	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Japanischer Yen	Norwegische Krone	6.332	459	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	195
Japanischer Yen	Norwegische Krone	11.228	817	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	298
Japanischer Yen	Norwegische Krone	10.901	795	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	270
Norwegische Krone	Japanischer Yen	599	8.007	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						JPY 813
						NOK 61
Japanischer Yen	Norwegische Krone	27.446	2.076	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(325)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	1.651	22.409	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(315)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	475	6.551	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(202)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	476	6.551	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(187)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	78.826	1.077.216	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22.584)
						JPY (23.613)
						NOK (1.763)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Schwedische Krone	6.074	461	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	226
Japanischer Yen	Schwedische Krone	11.099	847	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	358
Japanischer Yen	Schwedische Krone	10.654	801	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	488
Schwedische Krone	Japanischer Yen	595	7.517	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34
						JPY 1.106
						SEK 87
Japanischer Yen	Schwedische Krone	9.236	733	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(60)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	16.601	1.310	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(20)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	26.160	2.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(238)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.612	20.669	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(221)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	482	6.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(256)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	479	6.327	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(252)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	78.576	1.039.144	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(42.222)
						JPY (43.269)
						SEK (3.408)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	Schwedische Krone	6.206	471	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	230
Japanischer Yen	Schwedische Krone	11.466	875	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	370
Japanischer Yen	Schwedische Krone	10.963	825	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	502
Schwedische Krone	Japanischer Yen	622	7.851	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	36
						JPY 1.138
						SEK 90
Japanischer Yen	Schwedische Krone	9.573	759	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(63)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	17.230	1.360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
Japanischer Yen	Schwedische Krone	27.169	2.161	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(246)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.689	21.664	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(232)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	504	6.660	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(268)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	501	6.614	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(263)
Schwedische Krone	Japanischer Yen	81.683	1.080.225	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(43.891)
						JPY (44.984)
						SEK (3.543)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	Singapur-Dollar	491.707	4.908	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.868
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	503.190	4.979	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14.329
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	397.206	3.966	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7.770
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	294.902	2.929	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7.328
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	3.711	362.193	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.184
						JPY 41.479
						SGD 422

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged) Forts.						
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	441.327	4.499	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(399)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	766.564	7.856	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.783)
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	1.222.539	12.627	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17.229)
Singapur-Yen	Japanischer Dollar	10.033	996.627	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11.541)
Singapur-Yen	Japanischer Dollar	3.005	299.937	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4.902)
Singapur-Yen	Japanischer Dollar	3.043	304.261	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.452)
Singapur-Yen	Japanischer Dollar	485.277	48.823.962	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.177.596)
						JPY (1.221.902)
						SGD (12.430)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	46.242.289	349.139	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	307.551
Japanischer Yen	US-Dollar	80.398.464	609.553	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	202.007
Japanischer Yen	US-Dollar	28.972.596	212.365	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.032.649
Japanischer Yen	US-Dollar	51.523.111	378.798	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.686.159
Japanischer Yen	US-Dollar	51.424.314	375.650	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.001.570
						JPY 5.229.936
						USD 39.695
Japanischer Yen	US-Dollar	129.117.200	987.638	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(822.305)
US-Dollar	Japanischer Yen	794.665	106.499.905	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.949.074)
US-Dollar	Japanischer Yen	293.717	38.781.837	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(138.655)
US-Dollar	Japanischer Yen	240.182	32.287.065	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(687.277)
US-Dollar	Japanischer Yen	230.173	30.984.461	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(701.557)
US-Dollar	Japanischer Yen	37.422.557	5.082.069.684	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(158.536.181)
						JPY (162.835.049)
						USD (1.235.918)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged)

Japanischer Yen	US-Dollar	1.371.356	10.241	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	24.012
Japanischer Yen	US-Dollar	425.532	3.213	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.830
Japanischer Yen	US-Dollar	738.687	5.600	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.856
Japanischer Yen	US-Dollar	271.184	1.988	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.665
Japanischer Yen	US-Dollar	476.039	3.500	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15.579
Japanischer Yen	US-Dollar	477.108	3.485	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18.570
						JPY 72.512
						USD 550
US-Dollar	Japanischer Yen	10.241	1.373.053	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24.012)
Japanischer Yen	US-Dollar	1.185.330	9.067	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.549)
US-Dollar	Japanischer Yen	7.219	967.529	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17.707)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.679	353.773	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.264)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.188	294.139	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.261)
US-Dollar	Japanischer Yen	2.097	282.319	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.392)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Japanischer Yen	343.167	46.602.845	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.453.785)
						JPY (1.516.970)
						USD (11.514)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged)						
Japanischer Yen	US-Dollar	1.841.950	13.907	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12.251
Japanischer Yen	US-Dollar	3.200.917	24.268	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8.042
Japanischer Yen	US-Dollar	1.160.213	8.504	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	41.353
Japanischer Yen	US-Dollar	2.054.875	15.107	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	67.248
Japanischer Yen	US-Dollar	2.053.602	15.001	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	79.932
						JPY 208.826
						USD 1.585
Japanischer Yen	US-Dollar	5.139.249	39.311	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32.730)
US-Dollar	Japanischer Yen	31.528	4.225.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(77.328)
US-Dollar	Japanischer Yen	11.668	1.540.597	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.508)
US-Dollar	Japanischer Yen	9.537	1.282.071	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27.291)
US-Dollar	Japanischer Yen	9.140	1.230.406	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27.859)
US-Dollar	Japanischer Yen	1.489.016	202.211.806	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.308.038)
						JPY (6.478.754)
						USD (49.174)

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Australien - 27.398.684			
(31. Dezember 2021: 31.626.986)			
149.700	CSL Ltd	27.398.684	2,38
Kanada - 56.297.551			
(31. Dezember 2021: 55.033.648)			
698.935	Alimentation Couche-Tard Inc	28.673.215	2,49
249.034	Canadian National Railway Co	27.624.336	2,40
Dänemark - 48.752.169			
(31. Dezember 2021: 48.942.571)			
386.000	Novo Nordisk A/S	48.752.169	4,23
Finnland - 13.491.045			
(31. Dezember 2021: 20.904.778)			
279.000	Kone Oyj - Class B	13.491.045	1,17
Frankreich - 75.212.764			
(31. Dezember 2021: 94.660.281)			
575.500	Dassault Systemes SE	19.277.811	1,67
74.500	L'Oreal SA	24.855.063	2,16
45.699	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	31.079.890	2,70
Hongkong - 61.133.179			
(31. Dezember 2021: 48.098.811)			
3.092.200	AIA Group Ltd	32.160.498	2,79
127.200	Jardine Matheson Holdings Ltd	6.050.745	0,53
1.796.500	Prudential Plc	22.921.936	1,99
Japan - 69.821.364			
(31. Dezember 2021: 126.833.203)			
88.700	Keyence Corp	32.493.967	2,82
208.600	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	24.102.764	2,09
33.400	SMC Corp	13.224.633	1,15
Spanien - 12.974.310			
(31. Dezember 2021: 21.162.698)			
522.000	Industria de Diseno Textil SA	12.974.310	1,13
Schweiz - 64.413.885			
(31. Dezember 2021: 92.625.483)			
215.000	Nestle SA	23.279.180	2,02
84.900	Roche Holding AG	24.915.662	2,16
7.465	SGS SA	16.219.043	1,41
Taiwan - 28.859.172			
(31. Dezember 2021: 47.044.026)			
414.662	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	28.859.172	2,50
Vereinigtes Königreich - 88.306.687			
(31. Dezember 2021: 131.463.563)			
1.382.000	Compass Group Plc	29.987.044	2,61
699.471	Experian Plc	22.257.448	1,93
118.301	Linde Plc	36.062.195	3,13
Vereinigte Staaten von Amerika - 584.623.327			
(31. Dezember 2021: 854.936.136)			
87.010	Adobe Inc	27.352.719	2,38
302.360	Alphabet Inc	25.066.955	2,18
449.694	Amphenol Corp - Class A	31.988.350	2,78
145.117	Automatic Data Processing Inc	32.373.903	2,81
13.902	Booking Holdings Inc	26.180.602	2,27
541.568	Cisco Systems Inc	24.107.338	2,09
233.951	Cognex Corp	10.294.974	0,89
375.943	Cognizant Technology Solutions Corp	20.090.435	1,74
26.200	Costco Wholesale Corp	11.174.858	0,97
379.490	Edwards Lifesciences Corp	26.441.445	2,30
570.169	Fastenal Co	25.199.383	2,19
393.930	Fortinet Inc	17.989.870	1,56
57.473	Illumina Inc	10.852.187	0,94
114.116	Intuitive Surgical Inc	28.280.858	2,46
112.765	Mastercard Inc	36.640.044	3,18

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
182.419	Microsoft Corp	40.869.364	3,55
247.960	NIKE Inc	27.108.918	2,35
193.113	Paychex Inc	20.846.522	1,81
102.716	Stryker Corp	23.457.367	2,04
191.179	Texas Instruments Inc	29.509.540	2,56
373.687	TJX Cos Inc/The	27.791.307	2,41
192.587	Walt Disney Co/The	15.629.862	1,36
71.960	Waters Corp	23.017.170	2,00
101.700	West Pharmaceutical Services Inc	22.359.356	1,94
Gesamtanlagen in Aktien		1.131.284.137	98,22
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 77.797 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 40.171)		77.797	0,01
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		1.131.361.934	98,23
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (163.798) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (76.616))		(163.798)	(0,02)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(163.798)	(0,02)
Nettoumlaufvermögen		20.626.256	1,79
Summe Nettovermögen		1.151.824.392	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,05	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,01	
Sonstiges Umlaufvermögen		1,94	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse JPY J (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Euro	1.159.745	8.234	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26
Japanischer Yen	Euro	1.068.826	7.449	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	164
Japanischer Yen	Euro	111.215.060	774.319	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17.855
						EUR 18.045
						JPY 2.535.069
Euro	Japanischer Yen	6.589	932.717	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(54)
Euro	Japanischer Yen	6.098	860.050	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(28)
Euro	Japanischer Yen	7.260	1.019.567	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
Euro	Japanischer Yen	5.434	786.210	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(167)
Euro	Japanischer Yen	20.193	2.935.619	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(717)
Japanischer Yen	Euro	1.220.585	8.720	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)
						EUR (994)
						JPY (139.643)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)						
Euro	Singapur-Dollar	32.176	46.142	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11
Singapur-Dollar	Euro	400.000	276.247	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.590
Singapur-Dollar	Euro	28.723	19.974	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	48
						EUR 2.649
						SGD 3.798
Euro	Singapur-Dollar	30.301	43.562	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(66)
Euro	Singapur-Dollar	38.691	55.654	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(105)
Euro	Singapur-Dollar	29.176	42.083	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(160)
Euro	Singapur-Dollar	94.054	136.049	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(785)
Euro	Singapur-Dollar	19.345	27.970	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(153)
Singapur-Dollar	Euro	64.353	44.917	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57)
Singapur-Dollar	Euro	65.756	45.842	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
Singapur-Dollar	Euro	50.925	35.500	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Singapur-Dollar	Euro	5.483.894	3.839.856	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17.081)
						EUR (18.412)
						SGD (26.398)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged)						
Euro	Singapur-Dollar	2.395	3.434	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Singapur-Dollar	Euro	4.987	3.476	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Singapur-Dollar	Euro	2.340	1.627	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Singapur-Dollar	Euro	4.169	2.906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
						EUR 5
						SGD 7
Euro	Singapur-Dollar	2.194	3.164	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
Euro	Singapur-Dollar	7.626	11.032	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(64)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	Singapur-Dollar	1.563	2.260	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
Euro	Singapur-Dollar	2.284	3.283	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
Euro	Singapur-Dollar	2.905	4.178	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
Singapur-Dollar	Euro	4.873	3.401	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
Singapur-Dollar	Euro	444.986	311.582	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.386)
						EUR (1.491)
						SGD (2.138)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse USD W (Hedged)						
Euro	US-Dollar	14.276	15.203	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	84
Euro	US-Dollar	13.738	14.607	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	102
Euro	US-Dollar	17.210	18.335	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	95
Euro	US-Dollar	13.320	14.155	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	107
Euro	US-Dollar	8.951.195	9.530.983	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	53.946
Euro	US-Dollar	323.966	345.544	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.398
Euro	US-Dollar	94.716	100.000	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.366
						EUR 57.098
						USD 61.121
US-Dollar	Euro	21.863	20.439	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Euro	22.190	20.930	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(215)
US-Dollar	Euro	60.953	57.078	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(178)
US-Dollar	Euro	110.681	103.694	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(372)
US-Dollar	Euro	11.770.328	11.129.801	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(142.106)
						EUR (142.901)
						USD (152.969)

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Kanada - 7.846.187			
(31. Dezember 2021: 19.407.454)			
139.674	Magna International Inc (Units)	7.846.187	1,69
China - 28.229.600			
(31. Dezember 2021: 54.781.649)			
378.000	BYD Co Ltd 'H'	9.329.597	2,01
133.300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	7.577.878	1,64
37.837	NXP Semiconductors NV	5.980.327	1,29
918.370	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	5.341.798	1,15
Frankreich - 9.994.055			
(31. Dezember 2021: 19.247.064)			
359.296	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	9.994.055	2,16
Deutschland - 31.278.610			
(31. Dezember 2021: 68.096.501)			
499.996	Infineon Technologies AG	15.247.109	3,29
173.194	KION Group AG	4.978.800	1,07
100.550	Knorr-Bremse AG	5.491.477	1,19
84.592	Mercedes-Benz Group AG	5.561.224	1,20
Japan - 45.407.708			
(31. Dezember 2021: 61.659.728)			
231.600	Denso Corp	11.524.412	2,49
203.400	East Japan Railway Co	11.653.189	2,51
50.500	FANUC Corp	7.627.524	1,65
217.000	Suzuki Motor Corp	7.062.751	1,52
258.700	Taiyo Yuden Co Ltd	7.539.832	1,63
Niederlande - 4.376.744			
(31. Dezember 2021: 11.419.845)			
48.542	Alfen Beheer BV '144A'	4.376.744	0,94
Republik Korea - 18.792.497			
(31. Dezember 2021: 30.201.896)			
961.652	Hanon Systems	6.156.246	1,33
26.968	Samsung SDI Co Ltd	12.636.251	2,73
Singapur - 7.690.808			
(31. Dezember 2021: 23.356.036)			
217.733	STMicroelectronics NV	7.690.808	1,66
Schweden - 8.697.802			
(31. Dezember 2021: -)			
478.441	Epiroc AB	8.697.802	1,88
Schweiz - 16.289.080			
(31. Dezember 2021: 19.421.610)			
105.713	Landis+Gyr Group AG	7.457.017	1,61
76.931	TE Connectivity Ltd	8.832.063	1,90
Taiwan - 10.684.307			
(31. Dezember 2021: 28.628.420)			
525.000	MediaTek Inc	10.684.307	2,31
Vereinigtes Königreich - 16.799.877			
(31. Dezember 2021: 28.094.875)			
1.045.744	CNH Industrial NV	16.799.877	3,63
Vereinigte Staaten von Amerika - 241.273.854			
(31. Dezember 2021: 605.883.321)			
49.037	Albermarle Corp	10.629.996	2,29
71.633	Alphabet Inc	6.357.070	1,37
121.985	Amphenol Corp - Class A	9.288.548	2,01
71.254	ANSYS Inc	17.215.323	3,72
140.021	Aptiv Plc	13.036.655	2,81
37.680	Diodes Inc	2.871.028	0,62
89.513	Eaton Corp Plc	14.052.198	3,03
226.787	General Motors Co	7.627.981	1,65
54.164	Hubbell Inc - Class B	12.719.603	2,75
176.138	Lumentum Holdings Inc	9.191.761	1,98

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
117.534	Marvell Technology Inc	4.354.635	0,94
488.374	MP Materials Corp	11.860.163	2,56
29.644	NVIDIA Corp	4.332.767	0,94
133.158	ON Semiconductor Corp	8.305.730	1,79
502.452	Plug Power Inc	6.212.819	1,34
58.421	Power Integrations Inc	4.188.786	0,90
38.936	QUALCOMM Inc	4.281.013	0,92
62.828	Regal Rexnord Corp	7.539.674	1,63
16.501	Roper Technologies Inc	7.127.772	1,54
106.635	Schneider Electric SE	14.925.928	3,22
208.348	Semtech Corp	5.975.421	1,29
66.553	Skyworks Solutions Inc	6.065.640	1,31
110.990	Splunk Inc	9.552.909	2,06
214.944	Trimble Inc	10.864.344	2,35
143.257	Twilio Inc - Class A	7.014.579	1,51
312.543	Uber Technologies Inc	7.727.626	1,67
76.517	Visteon Corp	10.015.310	2,16
62.906	Wolfspeed Inc	4.342.401	0,94
564.992	Zuora Inc	3.596.174	0,78
Gesamtanlagen in Aktien		447.361.129	96,56
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.732.480 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 2.775.355)		1.732.480	0,38
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		449.093.609	96,94
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (309.404) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (284.872))		(309.404)	(0,07)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(309.404)	(0,07)
Nettoumlaufvermögen		14.507.751	3,13
Summe Nettovermögen		463.291.956	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,20	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,37	
Sonstiges Umlaufvermögen		3,43	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	142.483	153.339	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	936
Schweizer Franken	US-Dollar	100	108	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	22.914	24.749	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	62
Schweizer Franken	US-Dollar	100.600	107.892	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.034
Schweizer Franken	US-Dollar	19.982.471	21.483.487	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	152.806
US-Dollar	Schweizer Franken	347.512	320.620	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	357
					USD	155.195
					CHF	143.501
Schweizer Franken	US-Dollar	377.704	409.873	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(909)
Schweizer Franken	US-Dollar	255.732	277.629	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(732)
Schweizer Franken	US-Dollar	106.819	116.020	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(360)
US-Dollar	Schweizer Franken	442.186	411.762	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.655)
US-Dollar	Schweizer Franken	14.174	13.105	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Schweizer Franken	250.274	231.266	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(132)
US-Dollar	Schweizer Franken	348.084	323.494	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2184)
US-Dollar	Schweizer Franken	14.558	13.479	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Schweizer Franken	715.596	663.179	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.470)
US-Dollar	Schweizer Franken	117.831	109.353	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(572)
US-Dollar	Schweizer Franken	21.741	20.129	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Schweizer Franken	55.642	51.881	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(533)
					USD	(11.653)
					CHF	(10.775)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	129	140	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	48	52	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	87	95	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	36	39	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Schweizer Franken	US-Dollar	6.864	7.380	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	52
US-Dollar	Schweizer Franken	87	80	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schweizer Franken	41	38	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Schweizer Franken	121	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	52
					CHF	48
US-Dollar	Schweizer Franken	120	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Schweizer Franken	246	228	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Schweizer Franken	152	141	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(3)
					CHF	(3)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	24.911	26.810	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	164
Schweizer Franken	US-Dollar	3.531.806	3.792.104	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27.008

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Schweizer Franken	61.788	57.006	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63
US-Dollar	Schweizer Franken	7.547	6.946	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27
					USD	27.262
					CHF	25.208
Schweizer Franken	US-Dollar	66.423	72.081	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(160)
Schweizer Franken	US-Dollar	44.991	48.844	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(129)
Schweizer Franken	US-Dollar	18.493	20.086	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(62)
US-Dollar	Schweizer Franken	77.979	72.614	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(645)
US-Dollar	Schweizer Franken	44.355	40.986	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)
US-Dollar	Schweizer Franken	61.376	57.040	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(385)
US-Dollar	Schweizer Franken	126.144	116.904	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(435)
US-Dollar	Schweizer Franken	20.896	19.393	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(101)
					USD	(1.940)
					CHF	(1.794)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	2.085	2.243	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Schweizer Franken	US-Dollar	294.957	317.113	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.255
US-Dollar	Schweizer Franken	5.170	4.770	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
					USD	2.274
					CHF	2.103
Schweizer Franken	US-Dollar	5.558	6.031	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)
Schweizer Franken	US-Dollar	3.757	4.079	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
Schweizer Franken	US-Dollar	1.544	1.677	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Schweizer Franken	6.525	6.076	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Schweizer Franken	3.712	3.430	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Schweizer Franken	5.136	4.773	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32)
US-Dollar	Schweizer Franken	10.555	9.782	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.745	1.620	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
					USD	(161)
					CHF	(149)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	4.049	4.358	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27
Schweizer Franken	US-Dollar	581.693	625.388	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.448
US-Dollar	Schweizer Franken	9.926	9.158	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10
					USD	4.485
					CHF	4.147
Schweizer Franken	US-Dollar	10.753	11.668	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)
Schweizer Franken	US-Dollar	7.421	8.057	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
Schweizer Franken	US-Dollar	3.090	3.357	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(10)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Schweizer Franken	12.599	11.732	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(104)	
US-Dollar	Schweizer Franken	7.140	6.598	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)	
US-Dollar	Schweizer Franken	12.218	11.377	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(101)	
US-Dollar	Schweizer Franken	10.118	9.403	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(64)	
US-Dollar	Schweizer Franken	20.806	19.282	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(72)	
US-Dollar	Schweizer Franken	3.430	3.183	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)	
						USD	(419)
						CHF	(387)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	9.315	9.890	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	81	
Euro	US-Dollar	368.746	394.462	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	550	
Euro	US-Dollar	142.474	151.074	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.549	
Euro	US-Dollar	857	918	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	250.993	268.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	820	
Euro	US-Dollar	104.444	111.490	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	393	
Euro	US-Dollar	19.832.190	20.981.671	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	263.150	
						USD	266.544
						EUR	249.002
US-Dollar	Euro	9.896	9.315	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(82)	
US-Dollar	Euro	330.365	310.237	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.970)	
US-Dollar	Euro	56.141	52.800	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(419)	
US-Dollar	Euro	89.469	84.287	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(822)	
US-Dollar	Euro	423.167	398.073	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.261)	
US-Dollar	Euro	96.882	91.112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(720)	
US-Dollar	Euro	243.250	228.352	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.367)	
US-Dollar	Euro	164.363	154.851	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.518)	
US-Dollar	Euro	334.467	314.781	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.735)	
US-Dollar	Euro	691.496	648.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.052)	
US-Dollar	Euro	113.443	106.796	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(960)	
US-Dollar	Euro	12.923	12.240	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(189)	
						USD	(17.095)
						EUR	(15.970)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	14.100	15.083	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	21	
Euro	US-Dollar	5.387	5.713	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	59	
Euro	US-Dollar	9.396	10.035	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31	
Euro	US-Dollar	3.876	4.137	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15	
Euro	US-Dollar	742.800	785.853	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.856	
						USD	9.982
						EUR	9.325
US-Dollar	Euro	12.693	11.920	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(76)	

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	16.074	15.121	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(124)	
US-Dollar	Euro	9.221	8.656	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(52)	
US-Dollar	Euro	12.544	11.806	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(103)	
US-Dollar	Euro	25.924	24.307	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(114)	
US-Dollar	Euro	4.262	4.012	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)	
						USD	(505)
						EUR	(472)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	8.114	8.616	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	70	
Euro	US-Dollar	3.394	3.622	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12	
Euro	US-Dollar	117.039	124.935	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	441	
Euro	US-Dollar	56.374	59.559	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	830	
Euro	US-Dollar	289.386	309.053	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	946	
Euro	US-Dollar	1.100	1.172	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6	
Euro	US-Dollar	22.250	23.814	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	21	
Euro	US-Dollar	6.823	7.264	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	44	
Euro	US-Dollar	3.138	3.341	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20	
Euro	US-Dollar	798	847	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8	
Euro	US-Dollar	8.488	9.025	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	67	
Euro	US-Dollar	164.462	174.389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.788	
Euro	US-Dollar	4.950	5.260	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	42	
Euro	US-Dollar	496	527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	9.975	10.606	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	79	
Euro	US-Dollar	41.695	44.300	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	365	
Euro	US-Dollar	433.783	464.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	647	
Euro	US-Dollar	20.062	21.182	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	310	
Euro	US-Dollar	22.851.684	24.176.176	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	303.216	
						USD	308.917
						EUR	288.586
US-Dollar	Euro	44.272	41.695	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(361)	
US-Dollar	Euro	3.624	3.394	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)	
US-Dollar	Euro	8.621	8.114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71)	
US-Dollar	Euro	393.969	369.966	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.350)	
US-Dollar	Euro	716	674	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Euro	494.802	465.460	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.813)	
US-Dollar	Euro	79.265	74.602	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(650)	
US-Dollar	Euro	286.157	268.631	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.608)	
US-Dollar	Euro	387.417	364.614	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.168)	
US-Dollar	Euro	27.738	26.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(169)	
US-Dollar	Euro	800.802	750.854	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.535)	
US-Dollar	Euro	10.887	10.172	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	132.104	124.364	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.118)	
US-Dollar	Euro	12.063	11.322	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(65)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	3.808	3.605	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)
US-Dollar	Euro	1.024	967	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
					USD	(16.999)
					EUR	(15.880)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	8.338	8.919	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	3.169	3.360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	34
Euro	US-Dollar	5.555	5.932	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18
Euro	US-Dollar	2.250	2.402	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8
Euro	US-Dollar	440.028	465.532	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5.839
					USD	5.911
					EUR	5.522
US-Dollar	Euro	7.585	7.123	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(45)
US-Dollar	Euro	9.531	8.965	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Euro	5.496	5.160	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(31)
US-Dollar	Euro	7.441	7.003	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(61)
US-Dollar	Euro	15.367	14.409	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(68)
US-Dollar	Euro	2.537	2.388	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
					USD	(299)
					EUR	(279)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	15.303	16.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
Euro	US-Dollar	5.831	6.183	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	63
Euro	US-Dollar	10.197	10.890	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33
Euro	US-Dollar	4.166	4.447	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16
Euro	US-Dollar	806.943	853.714	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10.707
					USD	10.842
					EUR	10.128
US-Dollar	Euro	13.853	13.009	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(83)
US-Dollar	Euro	17.470	16.434	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(135)
US-Dollar	Euro	10.050	9.434	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(56)
US-Dollar	Euro	13.637	12.835	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(112)
US-Dollar	Euro	28.172	26.415	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(124)
US-Dollar	Euro	4.642	4.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(39)
					USD	(549)
					EUR	(513)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	292.278	312.661	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	436
Euro	US-Dollar	25.156	26.734	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	214

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	111.238	117.952	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.209
Euro	US-Dollar	13.726	14.596	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	108
Euro	US-Dollar	5.909	6.292	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	38
Euro	US-Dollar	195.715	209.016	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	640
Euro	US-Dollar	80.033	85.433	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	301
Euro	US-Dollar	15.501.907	16.400.404	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	205.692
					USD	208.638
					EUR	194.907
US-Dollar	Euro	264.574	248.454	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.578)
US-Dollar	Euro	9.148	8.618	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(84)
US-Dollar	Euro	333.861	314.063	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.572)
US-Dollar	Euro	18.404	17.308	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(137)
US-Dollar	Euro	191.776	180.031	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.078)
US-Dollar	Euro	260.238	244.921	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.128)
US-Dollar	Euro	27.356	25.692	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(166)
US-Dollar	Euro	538.339	504.762	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.376)
US-Dollar	Euro	75.709	70.736	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(66)
US-Dollar	Euro	89.097	83.876	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(754)
US-Dollar	Euro	13.925	13.180	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(194)
					USD	(11.133)
					EUR	(10.400)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	13.763	14.722	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	20
Euro	US-Dollar	5.346	5.669	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	58
Euro	US-Dollar	9.349	9.984	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31
Euro	US-Dollar	3.820	4.077	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Euro	US-Dollar	739.855	782.737	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9.817
					USD	9.940
					EUR	9.286
US-Dollar	Euro	12.461	11.702	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(74)
US-Dollar	Euro	15.713	14.781	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(121)
US-Dollar	Euro	14.420	13.569	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(116)
US-Dollar	Euro	9.214	8.650	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(52)
US-Dollar	Euro	12.504	11.768	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(102)
US-Dollar	Euro	25.830	24.219	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(114)
US-Dollar	Euro	4.256	4.007	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(36)
					USD	(615)
					EUR	(575)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	339.765	360.763	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.939
Euro	US-Dollar	24.621	26.285	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	89

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	271.855	290.196	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.023
Euro	US-Dollar	263	278	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	656.230	700.829	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.145
Euro	US-Dollar	1.262	1.345	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	32.556	34.845	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	30
Euro	US-Dollar	749	798	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	98	104	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	30.120	32.003	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	263
Euro	US-Dollar	321.875	342.257	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.544
Euro	US-Dollar	376.247	398.957	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.090
Euro	US-Dollar	46.547	49.466	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	396
Euro	US-Dollar	15.878	16.854	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	155
Euro	US-Dollar	3.883	4.129	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31
Euro	US-Dollar	6.241	6.631	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	55
Euro	US-Dollar	974.970	1.042.963	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.453
Euro	US-Dollar	8.999	9.501	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	139
Euro	US-Dollar	51.960.239	54.971.874	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	689.453
					USD	704.822
					EUR	658.435
US-Dollar	Euro	6.627	6.241	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Euro	26.269	24.621	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(89)
US-Dollar	Euro	72.801	68.585	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(669)
US-Dollar	Euro	360.993	339.765	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.974)
US-Dollar	Euro	7.841	7.407	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(94)
US-Dollar	Euro	47.725	45.204	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(698)
US-Dollar	Euro	65.879	62.355	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(918)
US-Dollar	Euro	5.102	4.788	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27)
US-Dollar	Euro	297.227	279.812	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.515)
US-Dollar	Euro	882.066	828.325	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.260)
US-Dollar	Euro	43.113	40.281	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)
US-Dollar	Euro	20.979	19.703	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(128)
US-Dollar	Euro	874.909	823.412	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.155)
US-Dollar	Euro	23.366	22.013	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(216)
US-Dollar	Euro	642.183	602.852	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.609)
US-Dollar	Euro	345.139	324.833	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.832)
US-Dollar	Euro	5.121	4.816	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(38)
US-Dollar	Euro	106.629	100.337	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(854)
US-Dollar	Euro	1.120.047	1.053.628	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8.630)
US-Dollar	Euro	1.809.076	1.696.240	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.986)
US-Dollar	Euro	4.286	4.031	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(32)
					USD	(44.815)
					EUR	(41.866)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	624	668	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	239	253	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	416	444	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	172	184	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	32.867	34.772	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	436
					USD	442
					EUR	413
US-Dollar	Euro	561	526	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	711	669	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	407	383	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	555	522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Euro	1.147	1.075	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Euro	188	177	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
					USD	(23)
					EUR	(21)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	19.923	14.875	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.860	5.810	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	60
Singapur-Dollar	US-Dollar	13.274	9.857	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	55
Singapur-Dollar	US-Dollar	5.191	3.863	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	14
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.029.042	761.662	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.769
					USD	6.900
					SGD	9.242
US-Dollar	Singapur-Dollar	12.135	16.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(69)
US-Dollar	Singapur-Dollar	15.425	20.857	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(150)
US-Dollar	Singapur-Dollar	9.112	12.304	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(76)
US-Dollar	Singapur-Dollar	11.894	16.146	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(163)
US-Dollar	Singapur-Dollar	24.582	33.339	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(314)
US-Dollar	Singapur-Dollar	4.013	5.462	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(66)
					USD	(838)
					SGD	(1.122)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	7.847	5.859	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.096	2.288	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
Singapur-Dollar	US-Dollar	5.229	3.883	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.045	1.522	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
Singapur-Dollar	US-Dollar	405.333	300.014	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.666
					USD	2.717
					SGD	3.639

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Singapur-Dollar	4.780	6.437	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(27)
US-Dollar	Singapur-Dollar	6.076	8.216	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(59)
US-Dollar	Singapur-Dollar	3.589	4.846	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(30)
US-Dollar	Singapur-Dollar	4.685	6.360	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(64)
US-Dollar	Singapur-Dollar	9.683	13.132	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(124)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.581	2.152	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(26)
					USD	(330)
					SGD	(442)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	158.464	191.453	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	177
Pfund Sterling	US-Dollar	62.272	74.968	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	338
US-Dollar	Pfund Sterling	10.125	8.331	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	50
US-Dollar	Pfund Sterling	119.687	98.394	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	699
US-Dollar	Pfund Sterling	161.294	132.378	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.209
US-Dollar	Pfund Sterling	340.262	278.234	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.795
US-Dollar	Pfund Sterling	54.414	44.707	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	350
					USD	6.618
					GBP	5.474
Pfund Sterling	US-Dollar	107.093	133.172	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.664)
Pfund Sterling	US-Dollar	43.233	53.760	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.479)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.408.416	10.337.859	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(169.572)
US-Dollar	Pfund Sterling	156.874	130.330	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(733)
US-Dollar	Pfund Sterling	179.030	148.593	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(663)
US-Dollar	Pfund Sterling	204.512	169.761	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(780)
					USD	(176.891)
					GBP	(146.318)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged)						
Pfund Sterling	US-Dollar	23.019	27.811	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26
Pfund Sterling	US-Dollar	8.826	10.626	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	48
US-Dollar	Pfund Sterling	17.184	14.127	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	100
US-Dollar	Pfund Sterling	23.042	18.911	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	173
US-Dollar	Pfund Sterling	48.571	39.716	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	542
US-Dollar	Pfund Sterling	7.801	6.409	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	50
					USD	939
					GBP	777
Pfund Sterling	US-Dollar	15.243	18.955	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(522)
Pfund Sterling	US-Dollar	6.036	7.506	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(206)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.199.403	1.474.624	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24.188)
US-Dollar	Pfund Sterling	23.043	19.144	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(108)

Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	29.231	24.264	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(112)
					USD	(25.136)
					GBP	(20.792)

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
Aktien			
Österreich - 647.931			
(31. Dezember 2021: 977.395)			
5.358	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	314.783	0,73
57.688	Telekom Austria AG - Class A	333.148	0,77
Belgien - 1.539.066			
(31. Dezember 2021: 1.560.866)			
32.734	Bekaert SA	1.191.845	2,76
1.442	Cofinimmo SA (REIT)	122.714	0,28
1.239	D'iereen Group	224.507	0,52
Dänemark - 446.651			
(31. Dezember 2021: 463.318)			
20.727	GN Store Nord AS	446.651	1,04
Finnland - 662.152			
(31. Dezember 2021: 3.660.707)			
97.034	Outokumpu Oyj	462.513	1,07
7.866	Valmet Oyj	199.639	0,46
Frankreich - 15.744.352			
(31. Dezember 2021: 24.258.807)			
11.964	Alten SA	1.411.752	3,27
9.029	Arkema SA	766.833	1,78
13.737	Cie Plastic Omnium SA	187.922	0,44
12.298	Covivio (REIT)	692.992	1,60
22.191	Eiffage SA	2.043.791	4,73
92.721	Ellis SA	1.288.358	2,98
6.551	Fnac Darty SA	225.617	0,52
32.029	JCDecaux SA	572.358	1,33
42.940	Klepierre SA (REIT)	939.957	2,18
28.959	Maisons du Monde SA '144A'	340.413	0,79
36.157	Metropole Television SA	555.010	1,29
15.938	Nexity SA	419.807	0,97
31.747	Publicis Groupe SA	1.896.248	4,39
66.038	Rexel SA	1.231.609	2,85
6.946	Sopra Steria Group SACA	992.931	2,30
8.253	Trigano SA	1.048.131	2,43
11.735	Ubisoft Entertainment SA	312.503	0,72
16.521	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	818.120	1,89
Deutschland - 10.090.037			
(31. Dezember 2021: 21.216.856)			
14.264	AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	258.250	0,60
10.304	Bechtle AG	340.599	0,79
19.967	Brenntag SE	1.190.832	2,76
3.404	Cewe Stiftung & Co KGAA	301.765	0,70
15.080	Covestro AG '144A'	552.531	1,28
9.695	Dermapharm Holding SE	363.950	0,84
40.160	Deutsche EuroShop AG	887.536	2,05
24.957	Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	181.437	0,42
62.324	Deutz AG	253.409	0,59
19.023	DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	576.587	1,33
12.775	flatexDEGIRO AG	81.287	0,19
103.256	Heidelberger Druckmaschinen AG	153.284	0,35
14.858	HelloFresh SE	308.304	0,71
20.100	HUGO BOSS AG	1.090.425	2,52
6.254	KION Group AG	168.420	0,39
8.702	Krones AG	914.145	2,12
5.248	Rheinmetall AG	991.478	2,30
793	Sartorius AG - Preference	296.503	0,69
4.327	Siltronic AG	296.075	0,69
382.181	Telefonica Deutschland Holding AG	883.220	2,04
Irland - 488.924			
(31. Dezember 2021: 1.156.726)			
454	ICON Plc	84.464	0,19
2.174	ICON Plc	404.460	0,94
Italien - 3.570.841			
(31. Dezember 2021: 9.324.949)			
211.173	Anima Holding SpA '144A'	791.054	1,83

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Italien Forts.			
39.322	Banca IFIS SpA	525.538	1,22
221.759	BPER Banca	425.611	0,99
10.203	Buzzi Unicem SpA	184.164	0,43
128.654	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT)	406.547	0,94
164.645	Iren SpA	244.004	0,56
188.869	Italgas SpA	993.923	2,30
Luxemburg - 585.211			
(31. Dezember 2021: 1.979.440)			
102.985	Corestate Capital Holding SA	44.721	0,11
7.910	Eurofins Scientific SE	540.490	1,25
Niederlande - 5.562.087			
(31. Dezember 2021: 8.864.172)			
11.101	Aalberts NV	407.185	0,94
265.997	Aegon NV	1.266.678	2,93
9.738	Arcadis NV	360.695	0,84
16.222	BE Semiconductor Industries NV	930.007	2,15
23.022	OCI NV	770.086	1,78
24.955	Signify NV '144A'	792.696	1,84
27.527	TKH Group NV Dutch Cert	1.034.740	2,40
Spanien - 3.001.643			
(31. Dezember 2021: 4.311.762)			
2.227	Acciona SA	386.162	0,89
44.635	Almirall SA	406.736	0,94
115.946	Gestamp Automocion SA '144A'	418.797	0,97
158.751	Mediaset Espana Comunicacion SA	526.418	1,22
484.111	Sacyr SA	1.263.530	2,93
Schweden - 470.635			
(31. Dezember 2021: 1.637.818)			
161.292	Scandic Hotels Group AB '144A'	470.635	1,09
Gesamtanlagen in Aktien		42.809.530	99,13
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		42.809.530	99,13
Nettoumlaufvermögen		377.610	0,87
Summe Nettovermögen		43.187.140	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,80
Sonstiges Umlaufvermögen	1,20
Gesamtvermögen	100,00

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Aktien			
Frankreich - 1.316.035			
(31. Dezember 2021: -)			
27.188	Sanofi ADR	1.316.035	5,67
Deutschland - 784.962			
(31. Dezember 2021: 389.077)			
4.038	Merck KGaA	784.962	3,38
Niederlande - 661.934			
(31. Dezember 2021: 107.485)			
29.218	uniQure NV	661.934	2,85
Vereinigtes Königreich - 987.538			
(31. Dezember 2021: 225.121)			
7.281	AstraZeneca Plc	987.538	4,26
Vereinigte Staaten von Amerika - 19.171.822			
(31. Dezember 2021: 3.687.724)			
8.772	10X Genomics Inc (Units)	319.783	1,38
4.705	AbbVie Inc	760.493	3,28
4.761	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.130.761	4,87
9.167	Beam Therapeutics Inc	358.751	1,55
3.171	Biogen Inc	877.923	3,78
18.744	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.939.067	8,35
5.956	Bio-Techne Corp	493.484	2,13
23.697	Cytokinetics Inc	1.086.152	4,68
4.079	Danaher Corp	1.082.995	4,67
27.893	Denali Therapeutics Inc	775.425	3,34
2.997	Eli Lilly & Co	1.096.198	4,72
4.460	illumina Inc	901.478	3,88
11.270	Intellia Therapeutics Inc	393.041	1,69
2.075	IQVIA Holdings Inc	424.929	1,83
16.757	Keros Therapeutics Inc	804.001	3,46
21.480	Kymera Therapeutics Inc	535.819	2,31
15.101	Legend Biotech Corp ADR	753.313	3,25
47.640	MeiraGTx Holdings plc	310.136	1,34
4.869	Moderna Inc	874.302	3,77
13.210	PTC Therapeutics Inc	504.160	2,17
1.112	Regeneron Pharmaceuticals Inc	802.436	3,46
3.550	Repligen Corp	600.820	2,59
6.502	Sarepta Therapeutics Inc	841.814	3,63
4.468	Seagen Inc	574.495	2,47
6.034	Twist Bioscience Corp	143.579	0,62
16.979	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	786.467	3,39
Gesamtanlagen in Aktien		22.922.291	98,77
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.454 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 6.800)		3.454	0,02
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		22.925.745	98,79
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.754) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (656))		(1.754)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(1.754)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		282.694	1,22
Summe Nettovermögen		23.206.685	100,00

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,62
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,01
Sonstiges Umlaufvermögen	1,37
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.680	1.797	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	854	906	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	1.059	1.125	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10	
Euro	US-Dollar	601	639	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	500	533	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	1.224	1.307	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	US-Dollar	1.256	1.341	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	69.809	73.856	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	926	
						USD	965
						EUR	901
US-Dollar	Euro	1.780	1.672	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)	
US-Dollar	Euro	1.120	1.051	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	1.603	1.504	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	584	549	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Euro	1.338	1.255	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	1.446	1.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)	
						USD	(54)
						EUR	(50)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.260	1.345	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	69.701	73.741	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	925	
Euro	US-Dollar	1.668	1.785	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	849	900	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	1.052	1.118	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	598	635	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	US-Dollar	1.224	1.307	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4	
						USD	960
						EUR	897
US-Dollar	Euro	1.756	1.649	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(10)	
US-Dollar	Euro	1.107	1.039	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	1.583	1.486	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
US-Dollar	Euro	577	543	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
US-Dollar	Euro	1.325	1.242	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	1.442	1.362	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)	
						USD	(53)
						EUR	(50)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.676	1.792	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	853	904	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Euro	US-Dollar	1.057	1.123	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10	
Euro	US-Dollar	601	638	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	1.229	1.313	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	1.266	1.351	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
Euro	US-Dollar	69.979	74.035	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	929
					USD	965
					EUR	901
US-Dollar	Euro	1.761	1.654	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	1.111	1.043	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	1.589	1.491	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	579	545	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Euro	1.330	1.247	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)
US-Dollar	Euro	1.447	1.367	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)
					USD	(54)
					EUR	(50)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.732	1.293	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Singapur-Dollar	US-Dollar	877	648	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.091	807	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Singapur-Dollar	US-Dollar	622	457	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.270	943	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.273	947	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Singapur-Dollar	US-Dollar	71.156	52.668	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	468
					USD	497
					SGD	666
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.236	1.665	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Singapur-Dollar	785	1.057	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.141	1.540	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Singapur-Dollar	401	544	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Singapur-Dollar	911	1.236	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12)
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.027	1.389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
					USD	(48)
					SGD	(64)

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)

Pfund Sterling	US-Dollar	1.732	2.092	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
Pfund Sterling	US-Dollar	890	1.072	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Pfund Sterling	1.554	1.271	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17
US-Dollar	Pfund Sterling	1.716	1.397	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	27
US-Dollar	Pfund Sterling	1.274	1.054	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	1.863	1.532	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Pfund Sterling	670	550	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5
					USD	67
					GBP	55
Pfund Sterling	US-Dollar	1.080	1.307	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	US-Dollar	618	752	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.262	1.569	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(43)
Pfund Sterling	US-Dollar	1.288	1.601	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(44)
Pfund Sterling	US-Dollar	71.555	87.975	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.443)
US-Dollar	Pfund Sterling	2.013	1.673	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
					USD	(1.545)
					GBP	(1.278)

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen				
Australischer Dollar - 5.239.416				
(31. Dezember 2021: 14.135.342)				
9.690.000	Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	3.583.382	1,07	
2.870.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Nov-2033	1.656.034	0,50	
Kanadischer Dollar - 29.614.868				
(31. Dezember 2021: 21.638.320)				
10.040.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	6.847.847	2,06	
10.550.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4.648% 15-Mar-2027	7.276.350	2,18	
9.920.000	Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	6.776.416	2,03	
8.110.000	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	5.593.260	1,68	
3.700.972	Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031	3.120.995	0,94	
Kolumbianischer Peso - 5.550.566				
(31. Dezember 2021: 5.782.363)				
22.726.500.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028	3.287.255	0,99	
17.180.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032	2.263.311	0,68	
Dänische Krone - 4.241.291				
(31. Dezember 2021: -)				
40.020.000	Denmark Government Bond 0.000% 15-Nov-2031	4.241.291	1,27	
Euro - 45.041.858				
(31. Dezember 2021: 78.202.419)				
2.180.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Dec-2171	2.033.940	0,61	
1.780.000	AT&T Inc 1.300% 05-Sep-2023	1.760.874	0,53	
2.200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Dec-2171	2.104.971	0,63	
921.000	Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025	866.679	0,26	
1.212.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028	934.973	0,28	
2.100.000	Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030	1.632.656	0,49	
1.800.000	Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	1.713.879	0,51	
1.800.000	CRH Finland Services Oyj 'EMTN' 0.875% 05-Nov-2023	1.765.278	0,53	
4.090.748	European Union 0.450% 04-Jul-2041	2.486.018	0,75	
1.350.000	Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029	1.193.913	0,36	
2.219.000	Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027	1.185.168	0,36	
2.650.000	Indonesia Government International Bond 1.750% 24-Apr-2025	2.531.532	0,76	
900.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025	839.650	0,25	
1.070.000	IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Sep-2025	1.034.669	0,31	
1.710.000	Johnson Controls International Plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.000% 15-Sep-2028	1.619.994	0,49	
970.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 13-Jan-2023	970.698	0,29	
935.000	Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027	840.392	0,25	
985.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 0.375% 03-Jan-2026	896.178	0,27	
1.070.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.625% 09-Jun-2023	1.064.473	0,32	
1.220.000	Nationwide Building Society 'EMTN' 0.500% 23-Feb-2024	1.182.153	0,36	
893.000	Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026	814.282	0,24	
891.000	Orsted AS 'EMTN' 3.250% 13-Sep-2031	854.580	0,26	
3.620.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025	3.396.230	1,02	
1.553.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0.000% 07-Jul-2023	1.531.724	0,46	
1.130.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Mar-2171	444.062	0,13	
633.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 'REGS' 5.625% 15-Dec-2026	586.474	0,18	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Euro Forts.				
2.830.000	Spain Government Bond '144A' 1.900% 31-Oct-2052	1.813.774	0,54	
452.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029	349.109	0,10	
1.729.000	Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026	1.406.619	0,42	
1.775.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2171	1.321.044	0,40	
1.850.000	Universal Music Group NV 'EMTN' 3.000% 30-Jun-2027	1.781.532	0,53	
1.100.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2171	918.500	0,28	
1.445.000	Ziggo BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2030	1.165.840	0,35	
Indische Rupie - 2.825.493				
(31. Dezember 2021: 3.086.932)				
252.960.000	International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024	2.825.493	0,85	
Indonesische Rupiah - 6.569.977				
(31. Dezember 2021: 4.819.858)				
28.716.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	1.665.183	0,50	
80.654.000.000	Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025	4.904.794	1,47	
Malaysischer Ringgit - 1.901.092				
(31. Dezember 2021: 3.276.698)				
9.210.000	Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034	1.901.092	0,57	
Mexikanischer neuer Peso - 8.174.470				
(31. Dezember 2021: 5.322.496)				
73.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	3.242.813	0,97	
39.000.000	Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	1.667.071	0,50	
70.000.000	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	3.264.586	0,98	
Neuseeländischer Dollar - 21.339.235				
(31. Dezember 2021: 8.464.480)				
2.480.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025	1.407.405	0,42	
12.510.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	6.991.409	2,10	
9.450.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	4.038.870	1,21	
5.490.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030	4.213.162	1,27	
2.620.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024	1.495.060	0,45	
3.400.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3.500% 14-Apr-2033	1.728.025	0,52	
2.460.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.500% 15-Apr-2023	1.465.304	0,44	
Peruanischer neuer Sol - 4.006.342				
(31. Dezember 2021: -)				
18.450.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	4.006.342	1,20	
Pfund Sterling - 39.522.627				
(31. Dezember 2021: 40.858.584)				
1.240.000	3i Group Plc 'EMTN' 6.875% 09-Mar-2023	1.402.265	0,42	
705.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025	731.861	0,22	
1.350.000	AT&T Inc 2.900% 04-Dec-2026	1.404.531	0,42	
1.617.000	Clarion Funding Plc 'EMTN' 2.625% 18-Jan-2029	1.576.666	0,47	
1.242.000	Coventry Building Society 'EMTN' 1.000% 21-Sep-2025	1.247.720	0,38	
1.800.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2171	1.929.301	0,58	
525.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	539.492	0,16	
612.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025	640.000	0,19	
3.500.000	Dexia Credit Local SA 0.500% 22-Jul-2023	3.868.635	1,16	
672.934	Gwyn t y Mor OFTO Plc 2.778% 17-Feb-2034	650.343	0,20	
751.000	Hiscox Ltd 6.000% 22-Sep-2027	844.203	0,25	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Pfund Sterling Forts.				
2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 0.500% 24-Jul-2023	2.546.966	0,77	
1.400.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2171	1.436.584	0,43	
1.590.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	1.656.381	0,50	
3.170.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	3.378.329	1,01	
620.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Mar-2171	644.497	0,19	
517.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.500% 20-Jan-2041	347.452	0,10	
960.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.550% 05-Dec-2023	1.028.122	0,31	
370.000	National Express Group Plc 2.375% 20-Nov-2028	345.056	0,10	
800.000	National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023	882.148	0,27	
1.282.000	National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025	1.206.574	0,36	
1.645.000	Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2171	1.759.865	0,53	
740.000	Orsted AS 'EMTN' 4.875% 12-Jan-2032	816.496	0,25	
262.000	Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021	202.323	0,06	
268.000	Travis Perkins Plc 3.750% 17-Feb-2026	267.040	0,08	
316.000	Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033	233.202	0,07	
1.350.000	UNITE USAF II Plc 3.374% 30-Jun-2023	1.505.104	0,45	
1.740.000	United Kingdom Gilt 4.250% 07-Dec-2046	2.019.660	0,61	
630.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	541.281	0,16	
597.000	Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078	632.830	0,19	
400.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN' 1.625% 10-Feb-2024	432.671	0,13	
1.220.000	Welltower Inc 4.800% 20-Nov-2028	1.274.655	0,38	
1.355.000	Yorkshire Building Society FRN 3.871% 19-Nov-2023	1.530.374	0,46	
US-Dollar - 130.594.809				
(31. Dezember 2021: 96.676.356)				
3.780.000	American Express Co 3.375% 03-May-2024	3.474.060	1,04	
1.498.000	Apple Inc 1.125% 11-May-2025	1.293.791	0,39	
3.780.000	Asian Development Bank 'GMTN' FRN 5.175% 27-Aug-2026	3.613.603	1,08	
1.190.000	Bahamas Government International Bond 'REGS' 8.950% 15-Oct-2032	895.155	0,27	
3.540.000	BNG Bank NV 'REGS' FRN 5.048% 05-Aug-2026	3.352.369	1,01	
1.400.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Feb-2171	1.298.495	0,39	
1.020.000	Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028	772.425	0,23	
810.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500 % 01-May-2026	729.565	0,22	
3.290.000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.214% 27-May-2025	2.966.195	0,89	
943.000	Dollar General Corp 4.625% 01-Nov-2027	869.527	0,26	
950.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 7.450% 30-Apr-2044	835.183	0,25	
81.087	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030	29.845	0,01	
283.750	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.500% 31-Jul-2040	109.328	0,03	
619.125	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2035	269.257	0,08	
3.570.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 3.978% 14-Apr-2026	3.349.195	1,01	
3.860.000	European Investment Bank 'REGS' FRN 4.884% 21-Jan-2026	3.675.068	1,10	
2.290.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023	2.114.352	0,63	
904.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	815.828	0,25	
4.092.000	Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 4.582% 20-Mar-2028	3.809.848	1,14	
2.070.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 15-Jan-2025	1.834.157	0,55	
4.090.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.448% 22-Nov-2028	3.798.155	1,14	
4.520.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.583% 19-Aug-2027	4.255.234	1,28	
US-Dollar - 130.594.809		130.594.809	39,20	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.				
3.970.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.696% 17-Jun-2024	3.731.281	1,12	
2.248.000	International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026	1.882.684	0,57	
3.260.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026	2.839.254	0,85	
1.470.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3.109% 22-Apr-2051	928.524	0,28	
3.496.000	Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 5.306% 17-Jun-2026	3.328.354	1,00	
1.566.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029	1.224.755	0,37	
2.520.000	Lowe's Cos Inc 3.000% 15-Oct-2050	1.540.254	0,46	
877.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' FRN 5.232% 21-Mar-2025	820.524	0,25	
2.553.000	Mexico Government International Bond 4.500% 22-Apr-2029	2.288.056	0,69	
1.240.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027	937.977	0,28	
636.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024	577.832	0,17	
2.000.000	National Australia Bank Ltd/New York 3.500% 09-Jun-2025	1.820.508	0,55	
690.000	NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 30-Sep-2171	637.086	0,19	
1.940.000	PepsiCo Inc 3.600% 01-Mar-2024	1.797.213	0,54	
1.940.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027	1.679.431	0,50	
110.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	102.152	0,03	
390.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	362.174	0,11	
1.270.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	1.421.486	0,43	
1.405.000	Sprint LLC 7.875% 15-Sep-2023	1.335.907	0,40	
3.550.000	Svensk Exportkredit AB 'GMTN' FRN 4.996% 03-Aug-2026	3.369.418	1,01	
1.739.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024	1.527.987	0,46	
499.000	Tunisian Republic 'REGS' 5.750% 30-Jan-2025	326.200	0,10	
3.937.600	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	3.686.707	1,11	
15.412.100	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	14.443.773	4,34	
7.160.717	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	6.636.875	1,99	
5.156.257	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	5.133.814	1,54	
8.837.400	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	7.753.944	2,33	
4.330.000	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	3.468.359	1,04	
6.218.100	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	4.846.285	1,45	
2.182.000	Verizon Communications Inc FRN 5.113% 20-Mar-2026	1.993.492	0,60	
226.000	Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024	209.351	0,06	
1.048.000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029	578.802	0,17	
1.760.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 3.788% 15-Mar-2025	1.576.900	0,47	
580.000	Warnermedia Holdings Inc '144A' 3.788% 15-Mar-2025	519.660	0,16	
1.450.000	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028	1.107.155	0,33	
Gesamtanlagen in Anleihen		304.622.044	91,43	
		Zugrunde liegendes Engagement EUR	Summe Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %
Bestände Beschreibung				
Offene Terminkontrakte - 1.150.143				
(31. Dezember 2021: 311.972)				
(69)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(7.549.290)	522.877	0,16

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
(365)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(38.496.550)	435.620	0,13
(46)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(5.169.922)	191.646	0,06
Offene Terminkontrakte insgesamt			1.150.143	0,35
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 14.690.440 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.546.746)			14.690.440	4,41
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			320.462.627	96,19
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (2.570.305) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (4.219.461))			(2.570.305)	(0,77)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(2.570.305)	(0,77)
Nettoumlaufvermögen			15.298.080	4,58
Summe Nettovermögen			333.190.402	100,00

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	87,23
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,33
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	4,21
Sonstiges Umlaufvermögen	8,23
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							
Australischer Dollar	Euro	378.985	239.021	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	2,043	
Euro	Australischer Dollar	9.083.315	14.084.280	15. Feb. 23	State Street Bank	124,621	
Euro	Kanadischer Dollar	402.891	560.147	15. Feb. 23	State Street Bank	16,022	
Euro	Kanadischer Dollar	31.552.728	42.887.685	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1.932,081	
Euro	Dänische Krone	4.230.941	31.446.804	15. Feb. 23	UBS AG	579	
Euro	Mexikanischer Peso	1.626.486	33.234.287	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	53,164	
Euro	Mexikanischer Peso	5.516.547	109.954.078	15. Feb. 23	State Street Bank	311,286	
Euro	Neuseeländischer Dollar	674.910	1.128.458	15. Feb. 23	State Street Bank	5,636	
Euro	Pfund Sterling	852.558	745.472	15. Feb. 23	UBS AG	13,542	
Euro	Pfund Sterling	288.540	255.276	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	1,231	
Euro	Pfund Sterling	1.705.835	1.492.922	15. Feb. 23	State Street Bank	25,576	
Euro	Pfund Sterling	256.216	224.164	15. Feb. 23	State Street Bank	3,923	
Euro	Pfund Sterling	1.232.357	1.064.490	15. Feb. 23	State Street Bank	34,290	
Euro	Pfund Sterling	36.125.121	31.636.214	15. Feb. 23	State Street Bank	519,074	
Euro	Pfund Sterling	5.101.201	4.460.000	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	81,543	
Euro	Pfund Sterling	5.410.246	4.701.336	15. Feb. 23	State Street Bank	118,968	
Euro	Pfund Sterling	361.591	315.803	15. Feb. 23	UBS AG	6,159	
Euro	US-Dollar	369.452	381.613	15. Feb. 23	State Street Bank	13,104	
Euro	US-Dollar	729.623	773.245	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	7,571	
Euro	US-Dollar	3.790.005	4.040.325	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	17,173	
Euro	US-Dollar	1.443.754	1.503.321	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	39,952	
Euro	US-Dollar	4.990.369	5.289.967	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	50,627	
Euro	US-Dollar	179.821.087	181.187.727	15. Feb. 23	State Street Bank	10.628,993	
Euro	US-Dollar	708.650	750.666	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	7,683	
Euro	US-Dollar	1.549.992	1.552.868	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	99,933	
Euro	US-Dollar	1.384.343	1.403.877	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	73,410	
Euro	US-Dollar	1.037.272	1.096.882	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	13,010	
Euro	US-Dollar	883.702	932.544	15. Feb. 23	UBS AG	12,898	
Indonesische Rupiah	Euro	5.654.869.408	339.756	15. Feb. 23	State Street Bank	2,171	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	66.303.630.000	4.229.087	15. Feb. 23	State Street Bank	60,013	
Indonesische Rupiah	US-Dollar	18.295.986.837	1.168.252	15. Feb. 23	State Street Bank	15,377	
Japanischer Yen	Euro	494.127.937	3.392.978	15. Feb. 23	State Street Bank	129,854	
Japanischer Yen	Euro	290.328.707	1.619.320	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	22,784	
Mexikanischer Peso	Euro	106.765.498	5.046.028	15. Feb. 23	State Street Bank	8,285	
Neuseeländischer Dollar	Euro	694.526	410.954	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	961	
Pfund Sterling	US-Dollar	4.360.000	5.018.234	15. Feb. 23	State Street Bank	221,111	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	589.589	2.874.248.716	15. Feb. 23	State Street Bank	1,625	
US-Dollar	Indische Rupie	3.142.794	259.044.824	15. Feb. 23	State Street Bank	13,409	
						EUR	14.689.682
Australischer Dollar	Euro	5.393.993	3.488.309	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(57,311)	
Chilenischer Peso	Euro	104.010.302	113.264	15. Feb. 23	State Street Bank	(543)	
Euro	Tschechische Krone	5.194.516	128.035.774	15. Feb. 23	UBS AG	(79,114)	
Euro	Japanischer Yen	2.435.275	353.608.262	15. Feb. 23	UBS AG	(85,738)	
Euro	Malaysischer Ringgit	297.364	1.401.800	15. Feb. 23	State Street Bank	(1,835)	
Euro	Mexikanischer Peso	1.391.944	29.496.567	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(4,433)	
Euro	Neuseeländischer Dollar	2.463.374	4.213.089	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(35,357)	
Euro	Neuseeländischer Dollar	18.692.354	31.720.363	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(120,602)	
Euro	Polnischer Zloty	5.175.390	24.777.315	15. Feb. 23	UBS AG	(77,819)	
Schwedische Krone	Euro	55.633.941	5.132.296	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(112,827)	
US-Dollar	Chilenischer Peso	2.616.533	2.405.850.000	15. Feb. 23	State Street Bank	(164,041)	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	5.341.160	27.309.084.352	15. Feb. 23	State Street Bank	(228,005)	
US-Dollar	Euro	5.048.293	4.810.950	15. Feb. 23	State Street Bank	(96,882)	
US-Dollar	Euro	5.250.000	5.037.170	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(134,749)	
US-Dollar	Euro	1.411.479	1.369.433	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(51,402)	
US-Dollar	Euro	2.836.525	2.722.792	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(74,061)	
US-Dollar	Euro	3.604.929	3.479.206	15. Feb. 23	State Street Bank	(112,943)	
US-Dollar	Euro	1.876.005	1.774.063	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(22,260)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts.							
US-Dollar	Euro	5.894.485	5.522.312	15. Feb. 23	State Street Bank	(18.075)	
US-Dollar	Euro	4.051.432	3.798.181	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(14.976)	
US-Dollar	Euro	3.122.398	2.932.153	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(16.475)	
US-Dollar	Euro	715.909	670.996	15. Feb. 23	State Street Bank	(2.484)	
US-Dollar	Euro	1.458.011	1.363.682	15. Feb. 23	State Street Bank	(2.199)	
US-Dollar	Euro	1.629.166	1.527.249	15. Feb. 23	State Street Bank	(5.943)	
US-Dollar	Euro	1.166.045	1.157.662	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(68.816)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	1.092.045	17.134.189.661	15. Feb. 23	State Street Bank	(16.289)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	657.344	10.252.715.574	15. Feb. 23	HSBC Bank plc	(6.116)	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.665.750	89.173.243.176	15. Feb. 23	State Street Bank	(101.297)	
US-Dollar	Koreanischer Won	5.242.154	7.204.030.000	15. Feb. 23	State Street Bank	(472.757)	
US-Dollar	Malaysischer Ringgit	1.626.794	7.694.735	15. Feb. 23	State Street Bank	(123.267)	
						EUR	(2.308.616)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)

Euro	Schweizer Franken	12.171	11.983	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	Schweizer Franken	3.734	3.675	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	Schweizer Franken	70.427	69.294	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	47	
Euro	Schweizer Franken	25.113	24.722	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	Schweizer Franken	9.487	9.328	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12	
Schweizer Franken	Euro	744	756	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Schweizer Franken	Euro	3.624	3.672	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Schweizer Franken	Euro	14.628	14.836	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	21	
						EUR	100
						CHF	99
Schweizer Franken	Euro	3.675	3.732	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)	
Euro	Schweizer Franken	76.767	75.597	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)	
Euro	Schweizer Franken	5.125	5.062	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)	
Euro	Schweizer Franken	14.095	13.920	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(43)	
Euro	Schweizer Franken	16.581	16.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(23)	
Schweizer Franken	Euro	11.983	12.177	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
Schweizer Franken	Euro	12.929.366	13.171.580	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(39.670)	
						EUR	(39.774)
						CHF	(39.178)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)

Euro	Schweizer Franken	1.913	1.884	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	Schweizer Franken	2.136	2.102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
						EUR	1
						CHF	1
Schweizer Franken	Euro	369.943	376.873	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.135)	
						EUR	(1.135)
						CHF	(1.118)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)							
Euro	Schweizer Franken	2.046	2.015	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	Schweizer Franken	2.802	2.758	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	Schweizer Franken	15.172	14.914	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	24	
Euro	Schweizer Franken	3.655	3.594	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	5	
Euro	Schweizer Franken	3.658	3.601	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	Schweizer Franken	226.311	222.671	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	152	
Euro	Schweizer Franken	688	678	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	Schweizer Franken	8.136	7.988	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23	
Euro	Schweizer Franken	2.282	2.244	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	Schweizer Franken	1.370	1.348	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Schweizer Franken	Euro	30.291	30.692	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	74	
Schweizer Franken	Euro	438	443	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Schweizer Franken	Euro	4.692	4.750	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15	
Schweizer Franken	Euro	11.658	11.840	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Schweizer Franken	Euro	1.112	1.127	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Schweizer Franken	Euro	1.599	1.621	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Schweizer Franken	Euro	115	117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
						EUR	306
						CHF	301
Schweizer Franken	Euro	1.348	1.369	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
Schweizer Franken	Euro	2.758	2.801	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
Euro	Schweizer Franken	245.779	242.034	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(46)	
Euro	Schweizer Franken	15.219	15.021	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(37)	
Euro	Schweizer Franken	1.672	1.651	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)	
Euro	Schweizer Franken	45.221	44.659	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(138)	
Euro	Schweizer Franken	68.378	67.485	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(164)	
Euro	Schweizer Franken	6.476	6.386	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
Schweizer Franken	Euro	2.015	2.047	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
Schweizer Franken	Euro	1.110	1.128	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
Schweizer Franken	Euro	40.876.693	41.642.459	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(125.418)	
						EUR	(125.821)
						CHF	(123.935)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	3.384	2.975	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31	
						EUR	31
						GBP	27
Pfund Sterling	Euro	458.396	534.064	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17.399)	
						EUR	(17.399)
						GBP	(15.430)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	2.494	2.192	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
					EUR	23
					GBP	20
Pfund Sterling	Euro	42	49	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
Pfund Sterling	Euro	337.823	393.588	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12.823)
					EUR	(12.824)
					GBP	(11.373)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	58	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					EUR	-
					USD	-
US-Dollar	Euro	10.013	9.469	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(97)
					EUR	(97)
					USD	(104)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD H (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	58	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					EUR	-
					USD	-
US-Dollar	Euro	10.013	9.469	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(97)
					EUR	(97)
					USD	(104)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	2.746	2.920	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11
Euro	US-Dollar	1.850	1.968	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7
Euro	US-Dollar	5.261	5.601	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	19
Euro	US-Dollar	2.534	2.694	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12
Euro	US-Dollar	33.308	35.373	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	200
Euro	US-Dollar	68	72	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	1.075	1.145	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
Euro	US-Dollar	2.017	2.131	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	23
					EUR	275
					USD	294
US-Dollar	Euro	5.601	5.265	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
US-Dollar	Euro	1.968	1.849	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7)
US-Dollar	Euro	2.920	2.744	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11)
US-Dollar	Euro	3.241	3.049	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(16)
US-Dollar	Euro	222	209	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	2.671	2.513	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	661	622	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
US-Dollar	Euro	2.063	1.936	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Euro	351	330	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	5.309	4.972	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(4)
US-Dollar	Euro	1.269	1.201	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Euro	1.134	1.071	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	880	831	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(8)
US-Dollar	Euro	6.013.186	5.686.031	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(57.974)
					EUR	(58.085)
					USD	(62.015)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD Z (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	3.674	3.902	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22
					EUR	22
					USD	23
US-Dollar	Euro	669.742	633.304	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.457)
					EUR	(6.457)
					USD	(6.894)

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL EMERGING MARKETS FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien			
Brasilien - 662.557			
40.772	Fleury SA	119.542	1,12
49.433	Raia Drogasil SA	222.131	2,08
43.982	WEG SA	320.884	3,00
China - 3.025.027			
25.600	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	114.399	1,07
95.600	By-health Co Ltd	314.028	2,94
2.700	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	152.806	1,43
15.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	36.354	0,34
14.900	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A'	167.665	1,57
33.400	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	185.097	1,73
29.800	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	181.178	1,69
68.000	NARI Technology Co Ltd 'A'	238.724	2,23
41.500	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	288.986	2,70
27.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	182.411	1,71
40.047	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	400.631	3,75
3.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	159.080	1,49
3.200	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	151.585	1,42
9.400	Sungrow Power Supply Co Ltd	151.181	1,41
7.400	Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	134.131	1,25
28.800	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	166.771	1,56
Dänemark - 194.240			
3.843	Novozymes A/S	194.240	1,82
Frankreich - 212.218			
590	L'Oreal SA	212.218	1,98
Deutschland - 233.275			
7.645	Infineon Technologies AG	233.275	2,18
Hongkong - 622.561			
41.200	AIA Group Ltd	459.352	4,30
28.500	Medlive Technology Co Ltd '144A'	31.172	0,29
64.000	Vitasoy International Holdings Ltd	132.037	1,23
Indien - 2.893.240			
2.222	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	120.205	1,12
67.522	Bandhan Bank Ltd '144A'	191.331	1,79
7.489	Dr Lal PathLabs Ltd '144A'	204.628	1,91
23.506	Godrej Consumer Products Ltd	248.506	2,32
8.776	Havells India Ltd	116.797	1,09
15.997	HDFC Bank Ltd	315.280	2,95
16.977	HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	116.185	1,09
9.727	Hindustan Unilever Ltd	301.422	2,82
7.893	Housing Development Finance Corp Ltd	252.112	2,36
4.322	Info Edge India Ltd	204.420	1,91
50.666	Marico Ltd	312.169	2,92
12.815	PB Fintech Ltd	69.357	0,65
16.979	Syngene International Ltd '144A'	120.590	1,13
8.141	Tata Consultancy Services Ltd	320.238	3,00
Indonesien - 346.456			
1.092.900	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	346.456	3,24
Mexiko - 144.450			
73.908	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	144.450	1,35
Niederlande - 260.144			
478	ASML Holding NV	260.144	2,43
Republik Korea - 190.237			
406	Samsung SDI Co Ltd	190.237	1,78
Südafrika - 490.957			
1.613	Capitec Bank Holdings Ltd	177.117	1,66
10.704	Clicks Group Ltd	170.480	1,59
19.677	Discovery Ltd	143.360	1,34

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Taiwan - 779.937			
21.000	Delta Electronics Inc	195.922	1,83
40.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	584.015	5,46
Vereinigte Staaten von Amerika - 272.193			
8.357	Afya Ltd - Class A	134.172	1,26
6.969	Livent Corp	138.021	1,29
Gesamtanlagen in Aktien		10.327.492	96,58
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 381 (siehe unten)		381	0,00
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		10.327.873	96,58
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.240) (siehe unten)		(1.240)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(1.240)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		366.382	3,43
Summe Nettovermögen		10.693.015	100,00
* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,30	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,00	
Sonstiges Umlaufvermögen		3,70	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	105	112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	69	74	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.897	11.528	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		115
US-Dollar	Euro	76	71	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	96	90	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	71	66	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	67	62	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	115
						EUR	108
US-Dollar	Euro	122	115	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	118	112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(2)
						EUR	(2)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	103	109	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	68	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.861	11.490	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		114
US-Dollar	Euro	77	72	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	98	92	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	71	66	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	67	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	114
						EUR	107
US-Dollar	Euro	122	115	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
US-Dollar	Euro	119	113	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(2)
						EUR	(2)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	105	111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
Euro	US-Dollar	69	73	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
Euro	US-Dollar	10.890	11.520	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		115
US-Dollar	Euro	76	71	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	96	90	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	71	66	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Euro	67	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
						USD	116
						EUR	109
US-Dollar	Euro	122	115	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	118	112	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(2)
						EUR	(2)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	108	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	84	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	111	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	143	117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
US-Dollar	Pfund Sterling	78	64	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	76	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
US-Dollar	Pfund Sterling	140	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3
						USD	9
						GBP	7
Pfund Sterling	US-Dollar	70	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.933	13.472	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(306)
						USD	(309)
						GBP	(257)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	108	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	84	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	111	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	143	117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
US-Dollar	Pfund Sterling	78	64	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	76	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
US-Dollar	Pfund Sterling	140	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3
						USD	9
						GBP	7
Pfund Sterling	US-Dollar	70	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.933	13.472	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(306)
						USD	(309)
						GBP	(257)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	108	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	84	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	111	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	143	117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2
US-Dollar	Pfund Sterling	78	64	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
US-Dollar	Pfund Sterling	76	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

**BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc)
(Hedged) Forts.**

US-Dollar	Pfund Sterling	140	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
					USD	9
					GBP	7
Pfund Sterling	US-Dollar	70	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.926	13.463	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(305)
					USD	(308)
					GBP	(256)

**BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc)
(Hedged)**

Pfund Sterling	US-Dollar	108	130	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	84	69	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Pfund Sterling	111	91	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	143	117	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	78	64	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
US-Dollar	Pfund Sterling	76	61	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Pfund Sterling	140	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3
					USD	9
					GBP	7
Pfund Sterling	US-Dollar	70	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.926	13.463	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(305)
					USD	(308)
					GBP	(256)

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Guernsey - 719.874				
(31. Dezember 2021: 256.829)				
756.401	Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	719.874	0,82	
Irland - 662.864				
(31. Dezember 2021: 357.694)				
6.703	DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund	615.036	0,70	
353	iShares Core GBP Corp Bond UCITS ETF - ETF	47.828	0,05	
Vereinigtes Königreich - 1.418.830				
(31. Dezember 2021: 827.999)				
205.168	Aquila European Renewables Plc	189.267	0,21	
411.722	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	755.591	0,86	
601.708	US Solar Fund Plc/Fund	473.972	0,54	
Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		2.801.568	3,18	
Anleihen				
Australien - 1.559.849				
(31. Dezember 2021: -)				
1.497.000	Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	758.323	0,86	
1.332.000	Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	801.526	0,91	
Kaiman-Inseln - 173.137				
(31. Dezember 2021: 181.075)				
200.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027	173.137	0,20	
Frankreich - 1.879.479				
(31. Dezember 2021: 199.086)				
286.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 6.625% 25-Sep-2171	259.622	0,30	
544.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Feb-2171	504.558	0,57	
200.000	Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026	178.288	0,20	
1.009.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Jun-2171	937.011	1,07	
Deutschland - 3.820.051				
(31. Dezember 2021: -)				
3.986.040	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	3.820.051	4,34	
Ungarn - 464.102				
(31. Dezember 2021: -)				
250.000	Hungary Government International Bond 1.250% 22-Oct-2025	229.439	0,26	
250.000	Hungary Government International Bond 5.375% 21-Feb-2023	234.663	0,27	
Irland - 548.831				
(31. Dezember 2021: 569.989)				
200.000	AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Apr-2171	183.100	0,21	
400.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028	365.731	0,41	
Italien - 5.052.346				
(31. Dezember 2021: -)				
3.099.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	3.056.792	3,47	
2.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	1.995.554	2,27	
Luxemburg - 255.287				
(31. Dezember 2021: 208.972)				
300.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026	255.287	0,29	
Mexiko - 1.559.660				
(31. Dezember 2021: -)				
35.110.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	1.559.660	1,77	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Neuseeland - 2.355.494				
(31. Dezember 2021: -)				
3.560.000	New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	1.989.562	2,26	
392.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2037	187.709	0,22	
417.000	New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	178.223	0,20	
Spanien - 387.323				
(31. Dezember 2021: 425.706)				
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jun-2171	195.962	0,22	
200.000	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Dec-2171	191.361	0,22	
Schweiz - 466.829				
(31. Dezember 2021: -)				
506.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.000% 31-Jul-2171	466.829	0,53	
Vereinigtes Königreich - 4.087.033				
(31. Dezember 2021: 701.771)				
277.000	3i Group Plc 'EMTN' 6.875% 09-Mar-2023	313.248	0,36	
436.000	Barclays Plc FRN (Perpetual) 8.875% 15-Sep-2171	485.365	0,55	
200.000	Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2171	214.367	0,24	
400.000	HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024	360.986	0,41	
176.000	HSBC Holdings Plc FRN 6.364% 16-Nov-2032	179.375	0,21	
154.000	HSBC Holdings Plc FRN 8.201% 16-Nov-2034	180.129	0,21	
400.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025	373.354	0,43	
200.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2171	205.226	0,23	
216.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' 2.250% 16-Oct-2024	231.373	0,26	
482.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 27-Jun-2171	442.475	0,50	
200.000	National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023	220.537	0,25	
436.000	Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2171	466.444	0,53	
327.000	Travis Perkins Plc 3.750% 17-Feb-2026	325.829	0,37	
100.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029	88.325	0,10	
Vereinigte Staaten von Amerika - 3.902.429				
(31. Dezember 2021: 4.112.9)				
341.000	American Express Co 3.375% 03-May-2024	313.400	0,36	
344.000	Dollar General Corp 4.625% 01-Nov-2027	317.197	0,36	
339.000	PepsiCo Inc 3.600% 01-Mar-2024	314.049	0,36	
31.000	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	34.698	0,04	
937.600	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	868.725	0,99	
2.480.100	United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	2.054.360	2,33	
Gesamtanlagen in Anleihen		26.511.850	30,14	
Aktien				
Australien - 348.201				
(31. Dezember 2021: -)				
19.600	OZ Minerals Ltd	348.201	0,40	
Bermudas - 220.647				
(31. Dezember 2021: 137.998)				
1.739	Credicorp Ltd	220.647	0,25	
Brasilien - 296.517				
(31. Dezember 2021: -)				
126.481	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	296.517	0,34	
Kaiman-Inseln - 172.900				
(31. Dezember 2021: 804.697)				
86.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	172.900	0,20	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
China - 1.840.122			
(31. Dezember 2021: 1.490.124)			
118.100	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	672.528	0,76
159.140	NARI Technology Co Ltd 'A'	523.285	0,59
371.50	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	242.302	0,28
17.400	Sungrow Power Supply Co Ltd	262.114	0,30
8.240	Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	139.893	0,16
Zypern - -			
(31. Dezember 2021: 515.030)			
8.962	HeadHunter Group Plc ADR*	-	-
Dänemark - 250.876			
(31. Dezember 2021: 870.000)			
2.929	Orsted AS '144A'	250.876	0,28
Finnland - 880.963			
(31. Dezember 2021: 301.801)			
20.280	Neste Oyj	880.963	1,00
Frankreich - 1.038.745			
(31. Dezember 2021: 2.343.317)			
693	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	477.754	0,54
6.194	Sanofi	560.991	0,64
Hongkong - 1.216.901			
(31. Dezember 2021: 1.065.040)			
75.600	AIA Group Ltd	789.480	0,90
62.100	Link REIT (Units) (REIT)	427.421	0,48
Indien - 816.982			
(31. Dezember 2021: 711.563)			
27.308	Housing Development Finance Corp Ltd	816.982	0,93
Indonesien - 199.577			
(31. Dezember 2021: 125.927)			
387.400	Bank Central Asia Tbk PT	199.577	0,23
Irland - 2.363.830			
(31. Dezember 2021: 3.499.984)			
3.260	ICON Plc	606.504	0,69
2.153	Linde Plc	665.158	0,76
7.580	Medtronic Plc	552.534	0,63
3.382	Trane Technologies Plc	539.634	0,61
Japan - 1.051.378			
(31. Dezember 2021: 2.262.105)			
6.000	Sony Group Corp	428.471	0,49
57.100	Topcon Corp	622.907	0,71
Niederlande - 1.094.172			
(31. Dezember 2021: 1.304.677)			
1.000	ASML Holding NV	509.750	0,58
25.808	Universal Music Group NV	584.422	0,66
Norwegen - 273.769			
(31. Dezember 2021: 286.471)			
112.952	Aker Carbon Capture ASA	124.155	0,14
9.389	TOMRA Systems ASA	149.614	0,17
Republik Korea - 433.608			
(31. Dezember 2021: 532.005)			
988	Samsung SDI Co Ltd	433.608	0,49
Schweiz - 1.837.056			
(31. Dezember 2021: 3.626.931)			
888	Lonza Group AG	413.342	0,47
10.704	Nestlé SA	1.170.468	1,33
2.338	TE Connectivity Ltd	253.246	0,29

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktien Forts.			
Taiwan - 540.267			
(31. Dezember 2021: 637.875)			
31.000	Elite Material Co Ltd	161.779	0,18
8.000	Voltronic Power Technology Corp	378.488	0,43
Vereinigtes Königreich - 11.295.875			
(31. Dezember 2021: 11.898.698)			
25.170	3i Group Plc	379.753	0,43
24.327	Anglo American Plc	887.616	1,01
64.777	Ascential Plc	145.868	0,17
11.785	AstraZeneca Plc	1.494.477	1,70
195.063	Atrato Onsite Energy Plc	209.289	0,24
16.123	Bodycote Plc	103.084	0,12
18.144	Burberry Group Plc	416.146	0,47
578.862	Harmony Energy Income Trust Plc	806.127	0,92
391.224	Hays Plc	509.970	0,58
398.018	Impact Healthcare Reit Plc (REIT) - Class B	477.087	0,54
85.137	Informa Plc	597.900	0,68
238.179	National Express Group Plc	348.476	0,40
28.333	National Grid Plc	320.446	0,36
409.067	Pantheon Infrastructure Plc	431.288	0,49
69.010	Prudential Plc	884.389	1,00
28.959	Relx Plc	750.762	0,85
218.017	Schroder Bsc Social Impact Trust Plc	227.402	0,26
161.651	Shaftesbury Plc (REIT)	675.896	0,77
19.739	Unilever Plc	932.767	1,06
124.980	Urban Logistics REIT Plc (REIT)	189.550	0,21
441.311	VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	507.582	0,58
Vereinigte Staaten von Amerika - 8.275.213			
(31. Dezember 2021: 15.760.326)			
393	Booking Holdings Inc	737.315	0,84
3.644	CME Group Inc	577.224	0,66
6.000	Comerica Inc	374.645	0,42
1.934	Cooper Cos Inc/The	605.823	0,69
3.753	Darling Ingredients Inc	218.733	0,25
1.942	Eli Lilly & Co	667.581	0,76
4.814	Eversource Energy	383.578	0,44
37.594	Exelon Corp	1.518.337	1,73
2.684	Hubbell Inc - Class B	591.892	0,67
23.318	KeyCorp	380.570	0,43
3.671	Microsoft Corp	828.601	0,94
5.429	NextEra Energy Inc	427.521	0,49
1.640	Norfolk Southern Corp	381.309	0,43
2.215	SolarEdge Technologies Inc	582.084	0,66
Gesamtanlagen in Aktien		34.447.599	39,16
Kapitalbeteiligungsinstrumente			
Guernsey - 2.768.419			
(31. Dezember 2021: 2.469.415)			
231.231	Bluefield Solar Income Fund Ltd	355.258	0,40
369.390	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	361.340	0,41
420.055	International Public Partnerships Ltd	718.071	0,82
213.765	JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings	287.326	0,33
711.108	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	1.046.424	1,19
Luxemburg - 370.043			
(31. Dezember 2021: 350.668)			
209.288	BBGI Global Infrastructure SA	370.043	0,42
Vereinigtes Königreich - 2.848.062			
(31. Dezember 2021: 2.598.672)			
664.407	BioPharma Credit Plc/The Fund	593.681	0,68
801.693	Greencoat UK Wind Plc/Funds	1.375.892	1,56
807.323	Socl Energy Efficiency Income Trust Plc	878.489	1,00
Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente		5.986.524	6,81

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Börsengehandelte Rohstoffe			
Irland - 3.191.487			
(31. Dezember 2021: -)			
14.698	Amundi Physical Gold ETC	996.322	1,13
6.741	Invesco Physical Gold ETC	1.109.535	1,26
32.711	Ishares Physical Gold ETC	1.085.630	1,24
Jersey - 877.325			
(31. Dezember 2021: -)			
25.133	Wisdomtree Carbon - ETC	697.127	0,79
5.666	WisdomTree Copper - ETC	180.198	0,21
Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe		4.068.812	4,63
Partizipationsscheine („P-Notes“)			
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.411.345			
(31. Dezember 2021: -)			
25.921	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	2.411.345	2,74
Gesamtanlagen in Partizipationsscheine		2.411.345	2,74
Optionsscheine			
Luxemburg - 1.290.415			
(31. Dezember 2021: 1.002.608)			
11.500	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	1.290.415	1,47
Vereinigtes Königreich - 3.521.153			
(31. Dezember 2021: 2.765.737)			
15.177	Barclays Bank Plc (WTS) 10-Nov-2023	1.518.289	1,72
20.593	Barclays Bank Plc (WTS) 13-Nov-2023	2.002.864	2,28
Gesamtanlagen in Optionsscheinen		4.811.568	5,47
Indexoptionen - 595.942			
(31. Dezember 2021: 618.875)			
48	CBOE S&P 500 Index Call 19-Jan-2023 4,000.000	92.390	0,11
224	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,850.000	503.552	0,57
Indexoptionen insgesamt		595.942	0,68
Offene Terminkontrakte - 972.959			
(31. Dezember 2021: 25.814)			
(7)	DAX Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.452.450)	64,651
(78)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(14.143.040)	387,435
(178)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(6.797.820)	186,346
8	Hang Seng Index Long Futures Contracts Exp Jan-2023	957.281	5,809
(23)	NASDAQ 100 E-Mini Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(4.753.488)	328,718
Offene Terminkontrakte insgesamt		972.959	1,11
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 635.186 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 53.265)		635.186	0,72
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		83.243.353	94,64

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Aktioptionen - (3.082)			
(31. Dezember 2021:)			
(9)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA Put 20- Jan-2023 630.000	(2.646)	(0,00)
(31)	Nike Inc Class B Put 20-Jan-2023 95.000	(436)	(0,00)
Aktioptionen insgesamt		(3.082)	(0,00)
Indexoptionen - (318.687)			
(31. Dezember 2021: (431.344))			
(4)	CBOE S&P 500 Index Put 19-Jan-2023 3,750.000	(14.301)	(0,02)
(112)	EURO STOXX 50 Index Call 20-Jan-2023 4,100.000	(2.464)	(0,00)
(224)	EURO STOXX 50 Index Put 16-Jun-2023 3,550.000	(266.784)	(0,30)
(27)	Hang Sang Index Put 20-Jan-2023 18,000.000	(14.438)	(0,02)
(1)	NASDAQ 100 Index Put 19-Jan-2023 10,750.000	(20.700)	(0,03)
Indexoptionen insgesamt		(318.687)	(0,37)
Offene Terminkontrakte - (294.152)			
(31. Dezember 2021: (53.523))			
16	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.136.480	(51,945)
28	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	2.062.860	(115,593)
65	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2023	7.640.608	(126,614)
Offene Terminkontrakte insgesamt		(294.152)	(0,34)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (343.366) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (993.467))		(343.366)	(0,39)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(959.287)	(1,10)
Nettoumlaufvermögen		5.673.504	6,46
Summe Nettovermögen		87.957.570	100,00

* Unterliegt der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts durch die Verwaltungsgesellschaft.
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.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	88,19
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,70
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,76
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,71
Sonstiges Umlaufvermögen	6,64
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)							
Euro	Pfund Sterling	174.477	152.316	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	2.800	
Euro	Pfund Sterling	20.401.989	17.998.247	13. Jan. 23	State Street Bank	115.902	
Euro	Pfund Sterling	366.218	318.084	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	7.701	
Euro	Pfund Sterling	590.519	518.282	13. Jan. 23	State Street Bank	6.356	
Euro	Pfund Sterling	415.514	365.515	13. Jan. 23	Canadian Imperial Bank	3.536	
Euro	Pfund Sterling	41.537	36.314	13. Jan. 23	Royal Bank of Scotland	607	
Euro	Pfund Sterling	873.963	763.862	13. Jan. 23	UBS AG	13.003	
Euro	Pfund Sterling	220.251	191.085	13. Jan. 23	Canadian Imperial Bank	4.877	
Euro	Hongkong-Dollar	1.235.150	9.819.763	15. Feb. 23	UBS AG	57.596	
Euro	US-Dollar	271.670	285.068	15. Feb. 23	State Street Bank	5.475	
Euro	US-Dollar	1.085.625	1.143.983	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	17.380	
Euro	US-Dollar	284.065	295.350	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	8.269	
Euro	US-Dollar	57.776	60.013	15. Feb. 23	State Street Bank	1.736	
Euro	US-Dollar	208.898	211.507	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	11.393	
Euro	US-Dollar	6.284.277	6.360.933	15. Feb. 23	State Street Bank	344.473	
Euro	US-Dollar	132.926	140.270	15. Feb. 23	UBS AG	1.943	
Euro	US-Dollar	239.747	254.254	15. Feb. 23	State Street Bank	2.326	
Euro	US-Dollar	170.585	176.203	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	6.048	
Euro	US-Dollar	226.465	235.518	15. Feb. 23	UBS AG	6.540	
Ungarischer Forint	Euro	215.513.362	518.744	15. Feb. 23	UBS AG	11.023	
Schweizer Franken	Euro	100.177	101.853	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	34	
Euro	Australischer Dollar	2.141.220	3.359.585	16. Mrz. 23	UBS AG	6.030	
						EUR	635.048
Pfund Sterling	Euro	154.617	175.195	13. Jan. 23	State Street Bank	(924)	
Pfund Sterling	Euro	241.051	278.726	13. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	(7.034)	
Pfund Sterling	Euro	440.855	510.226	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(13.332)	
Pfund Sterling	Euro	345.670	400.747	13. Jan. 23	Barclays Bank PLC	(11.138)	
Pfund Sterling	Euro	1.184.136	1.357.813	13. Jan. 23	Canadian Imperial Bank	(23.156)	
Schwedische Krone	Euro	13.733.456	1.249.557	13. Jan. 23	UBS AG	(10.015)	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	848.368	6.104.005	13. Jan. 23	State Street Bank	(30.331)	
Euro	Japanischer Yen	1.063.672	155.139.647	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(42.380)	
Euro	Neuseeländischer Dollar	2.430.068	4.147.665	15. Feb. 23	State Street Bank	(29.861)	
Euro	Schweizer Franken	1.863.042	1.837.931	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(6.263)	
Hongkong-Dollar	Euro	2.131.925	258.327	15. Feb. 23	UBS AG	(2.674)	
Hongkong-Dollar	Euro	1.755.516	212.560	15. Feb. 23	Barclays Bank PLC	(2.044)	
Japanischer Yen	Euro	155.139.647	1.108.852	15. Feb. 23	State Street Bank	(2.800)	
Schweizer Franken	Euro	59.990	61.186	15. Feb. 23	Citigroup Global Markets Limited	(172)	
US-Dollar	Euro	1.536.084	1.517.573	15. Feb. 23	State Street Bank	(83.186)	
US-Dollar	Euro	558.138	540.908	15. Feb. 23	Royal Bank of Scotland	(19.722)	
US-Dollar	Euro	688.203	647.249	15. Feb. 23	Canadian Imperial Bank	(4.609)	
US-Dollar	Euro	811.096	766.999	15. Feb. 23	State Street Bank	(9.602)	
US-Dollar	Euro	426.811	399.989	15. Feb. 23	State Street Bank	(1.436)	
US-Dollar	Euro	219.271	205.735	15. Feb. 23	State Street Bank	(981)	
US-Dollar	Euro	799.162	764.701	15. Feb. 23	State Street Bank	(18.448)	
						EUR	(320.108)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Euro	Pfund Sterling	1.312	1.128	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	41	
						EUR	41
						GBP	36
Pfund Sterling	Euro	8.731	9.964	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(123)	

Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.							
Pfund Sterling	Euro	208.249	242.625	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(7.904)	
						EUR	(8.027)
						GBP	(7.119)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)							
Euro	Pfund Sterling	73	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
						EUR	2
						GBP	2
Pfund Sterling	Euro	11.655	13.579	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(442)	
						EUR	(442)
						GBP	(392)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	6.295	6.655	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	67	
						EUR	67
						USD	72
US-Dollar	Euro	1.232.112	1.165.077	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(11.879)	
						EUR	(11.879)
						USD	(12.683)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	2.164	2.300	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	12	
Euro	US-Dollar	1.548	1.636	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16	
						EUR	28
						USD	30
US-Dollar	Euro	301.773	285.355	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.910)	
						EUR	(2.910)
						USD	(3.107)

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
Australien - 3.719.153				Frankreich Forts.			
(31. Dezember 2021: -)				429.000 Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500%			
686.000	Commonwealth Bank of Australia 'REGS' FRN 3.610% 12-Sep-2034	569.545	0,71	01-Mar-2025	431.008	0,54	
1.000.000	La Trobe Financial Capital Markets Trust 2022-2 '2022-2 A1L' FRN 4.760% 15-Feb-2054	680.803	0,85	300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2.100% 07-Apr-2032	264.694	0,33
668.000	National Australia Bank Ltd 'REGS' FRN 3.933% 02-Aug-2034	565.329	0,70	600.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.875% 11-Jul-2030	509.650	0,63
760.000	Pepper Residential Securities Trust NO 34 FRN 6.710% 12-Dec-2063	514.115	0,64	546.000	CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028	470.069	0,59
720.000	Perp Ttee 2022-1 FRN 0.000% 10-Oct-2054	489.564	0,61	400.000	Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Jun-2171	333.965	0,42
650.000	Santos Finance Ltd 'EMTN' 5.250% 13-Mar-2029	597.135	0,74	290.000	Electricite de France SA 'REGS' 5.600% 27-Jan-2040	267.462	0,33
352.000	Westpac Banking Corp FRN 4.110% 24-Jul-2034	302.662	0,38	477.000	Emeria SASU 'REGS' 3.375% 31-Mar-2028	424.652	0,53
Österreich - 782.706				368.000	Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	396.337	0,49
(31. Dezember 2021: -)				476.000	Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	494.239	0,62
200.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 5.750% 27-Jan-2028	219.179	0,27	500.000	Iliad Holding SASU 'REGS' 5.125% 15-Oct-2026	494.811	0,62
400.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	351.065	0,44	400.000	IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025	404.347	0,50
200.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	212.462	0,27	300.000	La Banque Postale SA FRN 5.500% 05-Mar-2034	315.090	0,39
Belgien - 98.219				600.000	Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028	577.220	0,72
(31. Dezember 2021: 150.744)				420.000	Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026	383.770	0,48
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040	98.219	0,12	500.000	Suez SACA 'EMTN' 2.375% 24-May-2030	468.619	0,58
Brasilien - 840.581				200.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	270.355	0,34
(31. Dezember 2021: 756.534)				881.000	WEA Finance LLC 'REGS' 2.875% 15-Jan-2027	756.478	0,94
1.600.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2033	258.359	0,32	Deutschland - 2.840.697			
500.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	386.378	0,48	(31. Dezember 2021: 12.647.302)			
200.000	Nexa Resources SA 'REGS' 6.500% 18-Jan-2028	195.844	0,25	2.840.697 3,54			
Kanada - 1.070.266				200.000	Amprion GmbH 'EMTN' 0.625% 23-Sep-2033	150.101	0,19
(31. Dezember 2021: 879.265)				460.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028	383.318	0,48
659.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 3.129% 03-Aug-2032	645.262	0,80	96.000	EnBW International Finance BV 'EMTN' 4.049% 22-Nov-2029	102.093	0,13
425.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 4.448% 27-Jan-2023	425.004	0,53	450.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025	411.343	0,51
Chile - 201.424				442.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 'REGS' 2.000% 15-Jul-2025	434.352	0,54
(31. Dezember 2021: 207.364)				396.000	TK Elevator Holdco GmbH 'REGS' 6.625% 15-Jul-2028	350.091	0,43
257.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 4.700% 22-Jan-2028	201.424	0,25	700.000	Vonovia SE 'EMTN' 0.250% 01-Sep-2028	573.540	0,71
China - 840.996				100.000	Wintershall Dea Finance BV 1.332% 25-Sep-2028	86.761	0,11
(31. Dezember 2021: 221.938)				400.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.000% 06-May-2027	349.098	0,44
400.000	Lenovo Group Ltd '144A' 6.536% 27-Jul-2032	386.853	0,48	GT - 351.815			
600.000	Prosus NV 'REGS' 2.031% 03-Aug-2032	454.143	0,57	(31. Dezember 2021: -)			
Kolumbien - 552.883				400.000	CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	351.815	0,44
(31. Dezember 2021: 354.011)				Indonesien - 813.208			
300.000	Aris Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026	235.500	0,29	(31. Dezember 2021: 434.327)			
365.000	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	317.383	0,40	813.208 1,01			
Elfenbeinküste - 202.805				400.000	Freeport Indonesia PT 'REGS' 5.315% 14-Apr-2032	368.911	0,46
(31. Dezember 2021: 147.434)				500.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	444.297	0,55
240.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	202.805	0,25	Irland - 143.624			
Tschechische Republik - 772.637				(31. Dezember 2021: 578.681)			
(31. Dezember 2021: -)				143.624 0,18			
800.000	CEZ AS 'EMTN' 2.375% 06-Apr-2027	772.637	0,96	135.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6.750% 01-Mar-2033	143.624	0,18
Ecuador - 187.728				Israel - 276.397			
(31. Dezember 2021: -)				(31. Dezember 2021: -)			
290.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 5.500% 31-Jul-2030	187.728	0,23	300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.750% 09-May-2027	276.397	0,34
Frankreich - 7.750.465				Italien - 326.445			
(31. Dezember 2021: 2.920.424)				(31. Dezember 2021: 3.752.041)			
507.000	Altice France SA/France 'REGS' 2.500% 15-Jan-2025	487.699	0,61	326.445 0,41			
Japan - 899.656				200.000	Enel Finance International NV 'REGS' 7.500% 14-Oct-2032	213.346	0,27
(31. Dezember 2021: 1.509.401)				100.000	Fiber Bidco Spa 'REGS' 11.000% 25-Oct-2027	113.099	0,14
156.750.000	Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	899.656	1,12	Japan - 899.656			
Luxemburg - 1.423.841				(31. Dezember 2021: 1.509.401)			
(31. Dezember 2021: -)				899.656 1,12			
500.000	Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025	491.776	0,61	Luxemburg - 1.423.841			
300.000	Cullinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026	279.624	0,35	(31. Dezember 2021: -)			
830.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	652.441	0,81	1.423.841 1,77			

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Mexiko - 2.090.898			
(31. Dezember 2021: 4.465.671)		2.090.898	2,60
200.000	Braskern Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032	146.379	0,18
41.000.000	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	1.944.519	2,42
Marokko - 590.530			
(31. Dezember 2021: -)		590.530	0,74
700.000	OCP SA 'REGS' 3.750% 23-Jun-2031	590.530	0,74
Niederlande - 4.135.766			
(31. Dezember 2021: 639.784)		4.135.766	5,15
500.000	ABN AMRO Bank NV 4.500% 21-Nov-2034	527.937	0,66
220.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	236.965	0,29
285.000	Athora Netherlands NV FRN 5.375% 31-Aug-2032	287.089	0,36
600.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 0.875% 29-Nov-2030	505.278	0,63
200.000	ING Groep NV FRN 1.750% 16-Feb-2031	177.945	0,22
226.000	ING Groep NV FRN 4.252% 28-Mar-2033	200.090	0,25
100.000	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	111.749	0,14
466.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024	492.048	0,61
704.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.500% 28-Oct-2034	782.706	0,97
451.000	TMNL Holding BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029	421.952	0,53
500.000	United Group BV 'REGS' 4.625% 15-Aug-2028	392.007	0,49
Neuseeland - 673.780			
(31. Dezember 2021: -)		673.780	0,84
1.153.000	New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	673.780	0,84
Nigeria - 353.412			
(31. Dezember 2021: -)		353.412	0,44
400.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027	353.412	0,44
Panama - 419.481			
(31. Dezember 2021: -)		419.481	0,52
450.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS' 6.875% 15-Sep-2027	419.481	0,52
Peru - 802.392			
(31. Dezember 2021: -)		802.392	1,00
400.000	Camposol SA 'REGS' 6.000% 03-Feb-2027	265.632	0,33
700.000	Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	536.760	0,67
Portugal - 105.496			
(31. Dezember 2021: -)		105.496	0,13
100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 3.875% 11-Mar-2030	105.496	0,13
Republik Korea - 896.012			
(31. Dezember 2021: 1.031.512)		896.012	1,12
993.900.000	Korea Treasury Bond 3.125% 10-Sep-2052	712.632	0,89
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	183.380	0,23
Rumänien - 254.370			
(31. Dezember 2021: 285.433)		254.370	0,32
290.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030	254.370	0,32
Singapur - 353.760			
(31. Dezember 2021: -)		353.760	0,44
400.000	United Overseas Bank Ltd 'GMTN' FRN 1.750% 16-Mar-2031	353.760	0,44
Südafrika - 1.628.667			
(31. Dezember 2021: 205.174)		1.628.667	2,03
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS' 6.500% 13-Oct-2026	200.333	0,25
28.769.000	Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	1.428.334	1,78

Bestände	Beschreibung	Summe Beizulegender Zeitwert USD	Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Spanien - 2.200.813			
(31. Dezember 2021: 1.306.577)		2.200.813	2,74
500.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031	448.733	0,56
539.000	Grifols Escrow Issuer SA 'REGS' 3.875% 15-Oct-2028	482.745	0,60
400.000	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	395.202	0,49
500.000	Ibercaja Banco SA FRN 2.750% 23-Jul-2030	469.526	0,59
444.000	Kaixo Bondco Telecom SA 'REGS' 5.125% 30-Sep-2029	404.607	0,50
Schweden - 422.870			
(31. Dezember 2021: -)		422.870	0,53
437.000	Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026	422.870	0,53
Schweiz - 1.631.099			
(31. Dezember 2021: -)		1.631.099	2,03
430.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028	343.273	0,43
350.000	Credit Suisse Group AG FRN 2.875% 02-Apr-2032	269.721	0,33
783.000	UBS Group AG 0.875% 03-Nov-2031	631.521	0,79
354.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN 5.125% 23-Nov-2052	386.584	0,48
Thailand - 478.421			
(31. Dezember 2021: -)		478.421	0,60
600.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN 3.466% 23-Sep-2036	478.421	0,60
Vereinigtes Königreich - 8.683.376			
(31. Dezember 2021: 5.834.577)		8.683.376	10,82
457.000	180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029	396.477	0,49
530.000	AA Bond Co Ltd 5.500% 31-Jul-2027	553.428	0,69
275.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 8.407% 14-Nov-2032	341.833	0,43
375.000	BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030	326.087	0,41
151.901	Brass No 10 Plc FRN 0.669% 16-Apr-2069	145.070	0,18
400.000	British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026	331.330	0,41
394.000	Canada Square Funding 2020-1 Plc '2020-1 B' FRN 5.225% 17-Dec-2056	463.460	0,58
400.000	CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026	438.848	0,55
419.000	EC Finance Plc 'REGS' 3.000% 15-Oct-2026	404.253	0,50
252.515	Gemgarto 2021-1 Plc '2021-1XA' FRN 3.999% 16-Dec-2067	300.187	0,37
400.000	Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027	333.822	0,42
200.000	HSBC Holdings Plc FRN 2.206% 17-Aug-2029	162.807	0,20
800.000	HSBC Holdings Plc FRN 5.402% 11-Aug-2033	746.563	0,93
100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc 'EMTN' 3.949% 20-Sep-2032	105.056	0,13
417.000	Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 6.375% 15-Feb-2025	435.553	0,54
774.567	Tower Bridge Funding 2022-1 Plc '2022-1XA' FRN 4.151% 20-Dec-2063	912.819	1,14
521.000	Twin Bridges 2022-2 Plc '2022-2 B' FRN 5.387% 12-Jun-2055	611.595	0,76
1.380.000	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	1.244.891	1,55
468.000	Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031	429.297	0,54
Vereinigte Staaten von Amerika - 28.698.529			
(31. Dezember 2021: 44.439.072)		28.698.529	35,75
98.163	Americredit Automobile Receivables Trust 2022-1 '2022-1 A2' 2.050% 20-Jan-2026	96.991	0,12
396.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	388.023	0,48
600.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 2.125% 15-Aug-2026	534.102	0,67
482.000	Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028	436.263	0,54
473.000	Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029	391.502	0,49
749.000	Bank of America Corp FRN 5.015% 22-Jul-2033	712.524	0,89
650.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1.500% 18-Mar-2030	587.399	0,73
630.000	Celanese US Holdings LLC 4.777% 19-Jul-2026	641.580	0,80

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.			
597.000	Celanese US Holdings LLC 5.337% 19-Jan-2029	602.596	0,75
650.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.200% 15-Mar-2028	600.108	0,75
892.000	Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	923.193	1,15
403.000	Cogent Communications Group Inc '144A' 7.000% 15-Jun-2027	393.484	0,49
470.000	Constellium SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029	396.875	0,49
500.000	CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028	485.657	0,61
65.000	Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049	61.270	0,08
650.000	FedEx Corp 0.950% 04-May-2033	495.115	0,62
150.000	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	111.647	0,14
145.000	Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043	104.198	0,13
610.000	Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	486.060	0,61
350.000	Ford Motor Credit Co LLC 7.350 % 04-Nov-2027	356.562	0,44
476.000	Honeywell International Inc 4.125% 02-Nov-2034	502.688	0,63
350.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	389.278	0,48
320.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 5.750% 01-Apr-2033	306.509	0,38
475.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 'REGS' 3.625% 15-Jan-2032	386.030	0,48
52.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 'REGS' 5.750% 01-Apr-2033	49.808	0,06
970.000	Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	789.614	0,98
325.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026	262.910	0,33
310.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028	272.760	0,34
780.000	Nasdaq Inc 0.900% 30-Jul-2033	592.915	0,74
698.000	National Grid North America Inc 'EMTN' 1.054% 20-Jan-2031	578.704	0,72
381.000	Newell Brands Inc 5.750% 01-Apr-2046	304.729	0,38
400.000	OI European Group BV 'REGS' 2.875% 15-Feb-2025	410.091	0,51
430.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028	401.841	0,50
425.000	Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043	418.141	0,52
465.000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2021-3 '2021-3 C' 0.950% 15-Sep-2027	447.408	0,56
55.000	SLM Corp 4.200 % 29-Oct-2025	50.023	0,06
170.000	Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081	142.206	0,18
125.000	Spirit Realty LP 3.200% 15-Feb-2031	100.231	0,12
75.000	Spirit Realty LP 4.000% 15-Jul-2029	65.346	0,08
250.000	Standard Industries Inc/NJ 'REGS' 2.250% 21-Nov-2026	228.210	0,28
760.000	Stellantis Finance US Inc '144A' 6.375% 12-Sep-2032	753.158	0,94
4.950.000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	3.128.265	3,90
2.450.000	United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	2.333.434	2,91
45.000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029-	41.037	0,05
2.450.000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2032- -	2.266.250	2,82
2.775.000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15-Nov-2032	2.840.906	3,54
850.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN 1.741% 04-May-2030	770.745	0,96
450.000	World Omni Automobile Lease Securitization Trust 2021-A '2021-A B' 0.750% 16-Nov-2026	424.927	0,53
368.000	WPC Eurobond BV 1.350% 15-Apr-2028	327.319	0,41
300.000	WPC Eurobond BV 2.250% 19-Jul-2024	307.897	0,38
Gesamtanlagen in Anleihen		78.515.218	97,81
Credit Default Swaps - 282.538			
(31. Dezember 2021: -)			
(23.100.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	185.546	0,23
(700.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	5.623	0,01
(4.450.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	35.744	0,04
(4.000.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	17.299	0,02

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Credit Default Swaps Forts.			
(8.700.000)	CDS iTraxx Europe Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	37.626	0,05
7.700.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	700	0,00
Credit Default Swaps insgesamt		282.538	0,35
Swaptions - 133.035			
(31. Dezember 2021: -)			
1.300.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 16-Feb-2023 0.980	10.027	0,01
5.200.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 16-Mar-2023 0.950	35.069	0,05
1.300.000	CDX North America High Yield Index Series 39 Put 19-Jan-2023 0.990	5.358	0,01
10.000.000	CDX North America Investment Grade Index Series 39 Put 18-Jan-2023 0.800	22.868	0,03
1.300.000	IRD Pay Fixed 5.250% Put 18-Jan-2023	5.085	0,01
1.300.000	IRD Pay Fixed 5.500% Put 15-Feb-2023	10.101	0,01
4.400.000	iTraxx Europe Crossover Series 38 Put 16-Mar-2023 0.065	25.926	0,03
9.000.000	iTraxx Europe Series 38 Put 18-Jan-2023 0.925	18.601	0,02
Swaptions insgesamt		133.035	0,17
Offene Terminkontrakte - 1.211.995			
(31. Dezember 2021: 470.392)			
(119)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (14.735.308)	372.373	0,46
(13)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (1.518.551)	117.130	0,15
(11)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (1.568.197)	94.060	0,12
(9)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (1.318.143)	248.858	0,31
(50)	Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (5.630.256)	66.015	0,08
(7)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (7.728.425)	116.190	0,15
(26)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (2.923.375)	59.427	0,08
10	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023 1.183.437	2.831	0,00
8	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2023 1.641.875	3.209	0,00
(91)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (9.829.422)	104.667	0,13
(33)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023 (4.141.500)	27.235	0,03
Offene Terminkontrakte insgesamt		1.211.995	1,51
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 149.653 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 1.951.732)			
		149.653	0,19
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		80.292.439	100,03
Credit Default Swaps - (135.318)			
(31. Dezember 2021: -)			
16.100.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 39 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	(129.320)	(0,16)
600.000	CDS iTraxx Europe Crossover Index Series 38 Version 1 5.000% 20-Dec-2027	(5.998)	(0,01)
Credit Default Swaps insgesamt		(135.318)	(0,17)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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)						
US-Dollar	Pfund Sterling	473.358	389.488	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.319
					USD	4.319
					GBP	3.588
Pfund Sterling	US-Dollar	360.911	440.927	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6.302)
Pfund Sterling	US-Dollar	66.601.554	82.064.820	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.860.254)
					USD	(1.866.556)
					GBP	(1.550.423)

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Aktien			
Bermudas - 4.948.994			
(31. Dezember 2021: -)			
14.946	Everest Re Group Ltd	4.948.994	1,39
Frankreich - 12.310.360			
(31. Dezember 2021: -)			
254.320	Sanofi ADR	12.310.360	3,45
Irland - 9.195.800			
(31. Dezember 2021: 6.783.855)			
118.312	Medtronic Plc	9.195.800	2,58
Schweiz - 12.893.378			
(31. Dezember 2021: 5.483.006)			
58.427	Chubb Ltd	12.893.378	3,62
Vereinigtes Königreich - 5.214.059			
(31. Dezember 2021: 9.364.482)			
130.433	British American Tobacco Plc ADR	5.214.059	1,46
Vereinigte Staaten von Amerika - 285.601.828			
(31. Dezember 2021: 259.142.915)			
34.671	AbbVie Inc	5.604.047	1,57
70.775	Allstate Corp/The	9.597.444	2,69
11.069	Ameriprise Financial Inc	3.446.056	0,97
42.405	Applied Materials Inc	4.129.823	1,16
22.224	Assurant Inc	2.779.778	0,78
139.501	Bank of America Corp	4.619.576	1,29
37.785	Bunge Ltd	3.770.565	1,06
25.182	Caterpillar Inc	6.032.726	1,69
299.968	Cisco Systems Inc	14.293.475	4,01
55.593	CME Group Inc	9.347.963	2,62
112.075	Comcast Corp	3.917.582	1,10
55.346	Comerica Inc	3.700.157	1,04
26.127	ConocoPhillips	3.083.117	0,86
79.736	Constellation Energy Corp	6.872.845	1,93
83.865	Corning Inc	2.678.229	0,75
46.515	Eaton Corp Plc	7.302.157	2,05
15.731	Eli Lilly & Co	5.753.849	1,61
34.945	EOG Resources Inc	4.526.601	1,27
61.598	EQT Corp	2.083.552	0,58
142.058	Exelon Corp	6.140.457	1,72
122.934	Exxon Mobil Corp	13.561.464	3,80
14.718	FedEx Corp	2.549.084	0,71
63.311	Fidelity National Information Services Inc	4.295.335	1,20
211.118	Freeport-McMoRan Inc	8.021.428	2,25
73.791	General Motors Co	2.481.960	0,70
150.895	Gilead Sciences Inc	12.953.581	3,63
17.862	Goldman Sachs Group Inc/The	6.133.900	1,72
32.997	Hess Corp	4.680.460	1,31
336.935	Hewlett Packard Enterprise Co	5.372.429	1,51
14.375	Hubbell Inc - Class B	3.375.753	0,95
298.854	International Game Technology Plc	6.779.503	1,90
266.230	Interpublic Group of Cos Inc/The	8.866.790	2,48
129.177	JPMorgan Chase & Co	17.324.573	4,86
14.677	L3Harris Technologies Inc	3.056.999	0,86
46.802	Marathon Petroleum Corp	5.448.455	1,53
59.074	MetLife Inc	4.274.890	1,20
71.254	Morgan Stanley	6.057.659	1,70
32.681	NextEra Energy Partners LP (Units)	2.290.121	0,64
6.582	Northrop Grumman Corp	3.593.706	1,01
90.542	Omnicom Group Inc	7.385.964	2,07
162.764	PPL Corp	4.756.778	1,33
21.496	QUALCOMM Inc	2.363.485	0,66
134.352	Raytheon Technologies Corp	13.559.476	3,80
142.407	Schlumberger Ltd	7.615.926	2,13
10.023	UnitedHealth Group Inc	5.314.946	1,49
246.224	US Bancorp	10.741.522	3,01
49.860	Voya Financial Inc	3.065.642	0,86
Gesamtanlagen in Aktien		330.164.419	92,56

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Vorzugsanleihen			
Vereinigte Staaten von Amerika - 11.269.328			
(31. Dezember 2021: 3.992.998)			
226.884	Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	11.269.328	3,16
Gesamtanlagen in Vorzugsanleihen		11.269.328	3,16
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 12.209 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 53.880)		12.209	0,00
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		341.445.956	95,72
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (326.608) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (1.338))		(326.608)	(0,09)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(326.608)	(0,09)
Nettoumlaufvermögen		15.598.184	4,37
Summe Nettovermögen		356.717.532	100,00
Portfolioanalyse			
		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,78	
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)		0,00	
Sonstiges Umlaufvermögen		5,22	
Gesamtvermögen		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.912	2.045	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3	
Euro	US-Dollar	118.103	125.481	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.034	
Euro	US-Dollar	635	676	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4	
Euro	US-Dollar	26.069	27.704	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	222	
Euro	US-Dollar	636	674	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	7	
Euro	US-Dollar	34.000	36.153	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	269	
Euro	US-Dollar	58	62	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	165	176	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	10.842	11.470	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	144	
US-Dollar	Euro	62	58	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
						USD	1.684
						EUR	1.573
US-Dollar	Euro	125.401	118.103	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.022)	
US-Dollar	Euro	591	555	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3)	
US-Dollar	Euro	831	782	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(6)	
US-Dollar	Euro	92	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	196	184	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	108	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
						USD	(1.034)
						EUR	(962)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	106	114	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	96	103	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	151	160	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	US-Dollar	59	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
Euro	US-Dollar	167	178	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Euro	US-Dollar	10.895	11.527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	145	
US-Dollar	Euro	62	58	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-	
						USD	148
						EUR	138
US-Dollar	Euro	126	119	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	92	87	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	197	185	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	109	103	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
US-Dollar	Euro	88	83	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
						USD	(5)
						EUR	(5)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	40.186	48.552	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	45	
Pfund Sterling	US-Dollar	1.517	1.826	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8	
Pfund Sterling	US-Dollar	35.486	42.902	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	11	

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.							
Pfund Sterling	US-Dollar	20.174	24.394	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1	
Pfund Sterling	US-Dollar	56.201	67.658	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	305	
US-Dollar	Pfund Sterling	38.252	31.395	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	287	
US-Dollar	Pfund Sterling	82.225	67.235	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	917	
US-Dollar	Pfund Sterling	24.756	20.339	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	159	
US-Dollar	Pfund Sterling	44.758	36.428	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	706	
						USD	2.439
						GBP	2.017
Pfund Sterling	US-Dollar	59.055	73.435	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.020)	
Pfund Sterling	US-Dollar	3.870.836	4.759.060	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(78.063)	
Pfund Sterling	US-Dollar	5.966	7.268	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)	
Pfund Sterling	US-Dollar	8.911	10.829	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(53)	
Pfund Sterling	US-Dollar	38.187	46.544	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(365)	
Pfund Sterling	US-Dollar	65.624	81.632	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.274)	
Pfund Sterling	US-Dollar	21.111	26.252	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(722)	
Pfund Sterling	US-Dollar	5.628	6.916	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(110)	
US-Dollar	Pfund Sterling	35.445	29.447	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(166)	
US-Dollar	Pfund Sterling	51.852	43.041	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(198)	
						USD	(84.024)
						GBP	(69.502)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	725	875	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2	
Pfund Sterling	US-Dollar	3.960	4.779	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	9	
Pfund Sterling	US-Dollar	161.883	194.885	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	879	
Pfund Sterling	US-Dollar	743.849	899.484	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	52	
Pfund Sterling	US-Dollar	8.265	9.957	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	37	
Pfund Sterling	US-Dollar	108.646	131.352	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33	
Pfund Sterling	US-Dollar	8.744	10.526	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	49	
Pfund Sterling	US-Dollar	123.063	148.682	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	138	
US-Dollar	Pfund Sterling	6.345	5.164	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	101	
US-Dollar	Pfund Sterling	73.416	60.319	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	472	
US-Dollar	Pfund Sterling	18.750	15.073	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	522	
US-Dollar	Pfund Sterling	239.330	195.701	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.669	
US-Dollar	Pfund Sterling	110.428	90.632	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	827	
US-Dollar	Pfund Sterling	1.307	1.074	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	8	
US-Dollar	Pfund Sterling	5.389	4.424	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	39	
US-Dollar	Pfund Sterling	132.853	108.126	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.097	
US-Dollar	Pfund Sterling	331	270	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4	
						USD	7.938
						GBP	6.566
US-Dollar	Pfund Sterling	4.778	3.960	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9)	
Pfund Sterling	US-Dollar	66.258	80.641	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(516)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

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.						
Pfund Sterling	US-Dollar	15.848	19.317	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(152)
Pfund Sterling	US-Dollar	62.418	77.617	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.136)
Pfund Sterling	US-Dollar	174.918	217.510	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5.982)
Pfund Sterling	US-Dollar	3.978	4.881	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71)
Pfund Sterling	US-Dollar	11.479.909	14.114.154	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(231.515)
Pfund Sterling	US-Dollar	7.686	9.341	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(46)
US-Dollar	Pfund Sterling	875	725	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Pfund Sterling	109.213	90.733	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(510)
US-Dollar	Pfund Sterling	158.932	131.926	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(606)
USD						(241.545)
GBP						(199.797)

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen			
Fördermittel - 40.106.405			
(31. Dezember 2021: 35.496.142)			
7.240.000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031	6.048.622	0,68
5.000.000	Michigan State Building Authority 2.705% 15-Oct-2040	3.652.775	0,41
2.110.000	New Jersey Economic Development Authority 3.620% 15-Jun-2028	1.949.028	0,22
3.500.000	Pasco County School Board 5.000% 01-Aug-2035	3.902.710	0,44
2.000.000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 6.000% 30-Jun-2061	2.115.470	0,24
7.395.000	Providence Public Building Authority 5.000% 15-Sep-2039	7.966.597	0,89
8.500.000	State Public School Building Authority 5.426% 15-Sep-2026	8.660.522	0,97
6.480.000	Tennessee State School Bond Authority 1.515% 15-Sep-2026	5.810.681	0,65
Anleihebank - 21.230.984			
(31. Dezember 2021: 28.433.730)			
9.890.000	Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034	7.838.913	0,88
4.250.000	Indiana Finance Authority 4.314% 01-Mar-2052	3.311.005	0,37
1.955.000	Iowa Finance Authority 5.000% 01-Dec-2050	1.826.840	0,20
1.000.000	Low Income Investment Fund 3.711% 01-Jul-2029	940.856	0,11
3.000.000	Michigan Finance Authority 2.366% 01-Sep-2049	2.950.755	0,33
4.500.000	Michigan Finance Authority 2.988% 01-Sep-2049	4.362.615	0,49
Dedicated Tax - 141.392.306			
(31. Dezember 2021: 163.839.058)			
4.350.000	Alabama Federal Aid Highway Finance Authority 1.727% 01-Sep-2028	3.691.084	0,41
1.000.000	Atlanta & Fulton County Recreation Authority 3.379% 15-Dec-2027	938.130	0,10
1.000.000	Black Belt Energy Gas District 4.000% 01-Jul-2052	993.415	0,11
7.500.000	Black Belt Energy Gas District 5.250% 01-Feb-2053	7.822.275	0,88
1.330.000	Brentwood Infrastructure Financing Authority 3.478% 02-Sep-2025	1.270.968	0,14
6.750.000	California Community Choice Financing Authority 4.000% 01-Feb-2052	6.646.657	0,75
1.000.000	City of Fort Worth TX 3.755% 01-Mar-2030	915.335	0,10
2.740.000	District of Columbia 4.996% 01-Dec-2026	2.750.590	0,31
5.000.000	Inland Valley Development Agency 5.500% 01-Mar-2033	5.056.725	0,57
1.000.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.021% 01-Dec-2029	912.185	0,10
1.250.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.121% 01-Dec-2030	1.133.600	0,13
1.840.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4.171% 01-Dec-2031	1.655.025	0,19
2.765.000	Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth '2022-ELL A4' 4.475% 01-Aug-2039	2.577.657	0,29
750.000	Maryland Economic Development Corp 4.580% 01-Jun-2033	667.418	0,07
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 4.790% 01-Jun-2038	854.220	0,10
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 5.050% 01-Jun-2043	831.380	0,09
1.000.000	Metropolitan Transportation Authority 5.989% 15-Nov-2030	1.035.975	0,12
2.825.000	Missouri Highway & Transportation Commission 5.445% 01-May-2033	2.917.095	0,33
2.000.000	Nassau County Interim Finance Authority 1.459% 15-Nov-2029	1.575.940	0,18
1.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.080% 01-Feb-2026	944.365	0,11
3.235.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-Feb-2040	3.131.448	0,35
2.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-Feb-2041	1.917.400	0,21
6.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-May-2043	5.681.040	0,64
5.000.000	New York State Urban Development Corp 2.970% 15-Mar-2034	4.058.425	0,46
3.500.000	New York State Urban Development Corp 3.270% 15-Mar-2028	3.239.075	0,36

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Dedicated Tax Forts.			
9.510.000	New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046	8.842.446	0,99
1.750.000	New York State Urban Development Corp 5.000% 15-Mar-2036	1.945.204	0,22
2.685.000	Pomona Redevelopment Agency Successor Agency 4.506% 01-Feb-2041	2.405.988	0,27
6.700.000	Public Finance Authority 6.145% 01-Aug-2028	6.650.721	0,75
1.365.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.000% 01-Oct-2025	1.297.671	0,15
1.445.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.125% 01-Oct-2026	1.352.939	0,15
1.500.000	Riverside County Transportation Commission 4.000% 01-Jun-2038	1.469.678	0,16
2.000.000	Sales Tax Securitization Corp 2.225% 01-Jan-2024	1.946.190	0,22
3.500.000	Sales Tax Securitization Corp 4.787% 01-Jan-2048	3.153.605	0,35
4.900.000	San Diego County Regional Transportation Commission 2.063% 01-Apr-2032	3.865.953	0,43
2.450.000	San Diego Redevelopment Agency Successor Agency 3.750% 01-Sep-2031	2.185.388	0,25
1.000.000	San Francisco City & County Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029	898.310	0,10
3.750.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029	3.366.712	0,38
10.000.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.375% 01-Aug-2034	8.774.350	0,99
5.000.000	State Board of Administration Finance Corp 1.258% 01-Jul-2025	4.592.950	0,52
4.750.000	State Board of Administration Finance Corp 1.705% 01-Jul-2027	4.139.174	0,46
10.295.000	State Board of Administration Finance Corp 2.154% 01-Jul-2030	8.441.025	0,95
1.000.000	State of Connecticut Special Tax Revenue 5.459% 01-Nov-2030	1.017.050	0,11
5.000.000	State of Illinois Sales Tax Revenue 3.750% 15-Jun-2032	4.327.775	0,49
2.000.000	State of Michigan Trunk Line Revenue 4.000% 15-Nov-2046	1.882.280	0,21
5.675.000	Village Center Community Development District 4.756% 01-Nov-2029	5.619.470	0,63
Bildung - 102.472.333			
(31. Dezember 2021: 123.768.896)			
750.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1.870% 01-Apr-2023	744.881	0,08
500.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1.931% 01-Apr-2024	480.925	0,05
1.370.000	California Educational Facilities Authority 3.414% 01-Apr-2031	1.200.620	0,14
1.635.000	California Educational Facilities Authority 3.431% 01-Apr-2030	1.457.594	0,16
1.000.000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 4.000% 01-Jul-2055	867.180	0,10
2.500.000	Delaware County Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.359.988	0,27
2.500.000	Florida Higher Educational Facilities Financial Authority 5.000% 01-Mar-2037	2.535.288	0,29
3.000.000	Harris County Cultural Education Facilities Finance Corp 3.344% 15-Nov-2037	2.427.960	0,27
8.500.000	Illinois Finance Authority 4.000% 01-Apr-2050	7.931.265	0,89
1.000.000	Illinois Finance Authority 5.450% 01-Aug-2038	915.485	0,10
2.000.000	Iowa Student Loan Liquidity Corp 4.349% 01-Dec-2027	1.888.990	0,21
2.500.000	Iowa Student Loan Liquidity Corp 5.080% 01-Dec-2039	2.246.187	0,25
1.000.000	Kent State University 2.797% 01-May-2032	813.150	0,09
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.860% 01-Jun-2025	968.950	0,11
1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.942% 01-Jun-2026	958.400	0,11
2.075.000	Louisiana Public Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.123.472	0,24
3.350.000	Massachusetts Educational Financing Authority 2.305% 01-Jul-2029	2.768.624	0,31
2.730.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3.455% 01-Jul-2028	2.477.134	0,28
2.110.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3.505% 01-Jul-2029	1.880.390	0,21
4.000.000	Massachusetts Educational Financing Authority 4.429% 01-Jul-2029	3.764.080	0,42

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Bildung Forts.				
4.700.000	Massachusetts Educational Financing Authority 4.595% 01-Jul-2031	4.370.036	0,49	
1.250.000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 4.409% 01-Oct-2034	1.079.844	0,12	
5.000.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3.613% 01-Jul-2050	3.449.200	0,39	
5.500.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3.736% 01-Sep-2030	4.910.345	0,55	
2.385.000	New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Feb-2038	2.342.666	0,26	
10.000.000	New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Mar-2044	9.481.700	1,07	
3.370.000	New York State Dormitory Authority 4.850% 01-Jul-2048	3.065.116	0,34	
775.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2037	748.677	0,08	
1.250.000	Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2039	1.179.294	0,13	
2.000.000	Red River Education Finance Corp 2.802% 15-Mar-2033	1.662.830	0,19	
1.775.000	Red River Education Finance Corp 2.892% 15-Mar-2034	1.463.274	0,16	
2.000.000	Rutgers The State University of New Jersey 2.013% 01-May-2032	1.511.240	0,17	
4.185.000	Salvation Army/United States 3.801% 01-Sep-2027	3.916.065	0,44	
2.000.000	University of California 1.614% 15-May-2030	1.594.830	0,18	
10.000.000	University of California 1.997% 15-May-2031	7.939.650	0,89	
1.100.000	University of California 3.063% 01-Jul-2025	1.058.337	0,12	
2.000.000	University of California 3.349% 01-Jul-2029	1.829.410	0,21	
5.000.000	University of Michigan 3.504% 01-Apr-2052	3.913.300	0,44	
1.000.000	University of Oklahoma/The 3.466% 01-Jul-2028	940.060	0,11	
2.515.000	University of Pittsburgh-of the Commonwealth System of Higher Education 3.646% 15-Sep-2036	2.151.306	0,24	
2.500.000	University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120	1.474.615	0,17	
2.145.000	Waco Educational Finance Corp 2.844% 01-Mar-2040	1.579.975	0,18	
Gesundheitswesen - 89.796.439		89.796.439	10,09	
(31. Dezember 2021: 103.212.683)				
2.750.000	Adventist Health System/West 2.433% 01-Sep-2024	2.618.266	0,29	
4.500.000	Adventist Health System/West 2.952% 01-Mar-2029	3.871.438	0,43	
1.500.000	Advocate Health & Hospitals Corp 3.829% 15-Aug-2028	1.404.090	0,16	
7.600.000	Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039	5.903.365	0,66	
5.000.000	Baylor Scott & White Holdings 1.777% 15-Nov-2030	3.886.952	0,44	
4.000.000	Bon Secours Mercy Health Inc 4.302% 01-Jul-2028	3.808.776	0,43	
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 1.979% 01-Jun-2030	4.056.300	0,46	
5.000.000	California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031	4.244.700	0,48	
5.000.000	City of Chillicothe OH 5.000% 01-Dec-2047	4.824.375	0,54	
400.000	City of Tampa FL 4.000% 01-Jul-2038	393.236	0,04	
2.270.000	Development Authority for Fulton County 5.000% 01-Apr-2047	2.298.874	0,26	
3.500.000	Geisinger Authority 5.000% 01-Apr-2043	3.695.658	0,42	
3.775.000	Illinois Finance Authority 5.000% 15-Nov-2045	3.781.814	0,42	
1.000.000	Louisiana Public Facilities Authority 5.000% 15-May-2046	1.022.750	0,12	
2.000.000	Maricopa County Special Health Care District 4.000% 01-Jul-2035	2.069.470	0,23	
4.740.000	Massachusetts Development Finance Agency 4.740% 01-Jul-2038	4.189.378	0,47	
2.000.000	Monroe County Hospital Authority/PA 5.000% 01-Jul-2041	2.019.000	0,23	
1.185.000	Montana Facility Finance Authority 4.368% 15-Aug-2038	1.019.070	0,11	
2.500.000	Montefiore Obligated Group 4.287% 01-Sep-2050	1.503.783	0,17	
1.700.000	New Hampshire Health and Education Facilities Authority Act 5.000% 01-Jul-2044	1.646.178	0,19	
2.500.000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 4.000% 01-Jul-2051	2.247.087	0,25	
5.925.000	Oklahoma Development Finance Authority 5.450% 15-Aug-2028	4.760.323	0,53	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Gesundheitswesen Forts.				
1.750.000	Oklahoma Development Finance Authority '2022-OGE A1' 4.285% 01-Feb-2034	1.698.953	0,19	
4.200.000	Oklahoma Development Finance Authority '2022-ONG A3' 4.714% 01-May-2052	3.852.828	0,43	
2.000.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2.532% 01-Oct-2029	1.701.405	0,19	
3.075.000	SSM Health Care Corp 3.688% 01-Jun-2023	3.055.816	0,34	
6.360.000	SSM Health Care Corp 3.823% 01-Jun-2027	6.036.400	0,68	
5.000.000	Sutter Health 2.294% 15-Aug-2030	4.067.596	0,46	
3.000.000	Trinity Health Corp 2.632% 01-Dec-2040	2.103.718	0,24	
2.000.000	Washington Health Care Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042	2.014.840	0,23	
Wohnungsbau - 19.121.632		19.121.632	2,15	
(31. Dezember 2021: 12.393.566)				
1.085.805	Arizona Industrial Development Authority '2019-2 A' FRN 3.625% 20-May-2033	1.055.088	0,12	
1.400.000	California Statewide Communities Development Authority 1.877% 01-Feb-2031	1.065.064	0,12	
1.000.000	California Statewide Communities Development Authority 2.177% 01-Feb-2033	734.660	0,08	
8.500.000	California Statewide Communities Development Authority 7.140% 15-Aug-2047	9.015.950	1,01	
4.000.000	Chicago Housing Authority 4.322% 01-Jan-2033	3.684.080	0,42	
500.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 4.125% 01-Jul-2023	494.285	0,06	
2.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.016% 15-Apr-2027	1.989.068	0,22	
1.250.000	Philadelphia Authority for Industrial Development 2.216% 15-Apr-2028	1.083.437	0,12	
Wohnungsbaufinanzierung - 4.554.454		4.554.454	0,51	
(31. Dezember 2021: 6.548.282)				
2.926.999	California Housing Finance Agency '2021-1 A' 3.500% 20-Nov-2035	2.649.344	0,30	
2.000.000	Minnesota Housing Finance Agency 4.337% 01-Jan-2047	1.905.110	0,21	
Leasing - 9.270.078		9.270.078	1,04	
(31. Dezember 2021: 11.118.768)				
5.000.000	Commonwealth Financing Authority 4.014% 01-Jun-2033	4.595.325	0,51	
1.840.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15-Dec-2028	1.855.668	0,21	
3.000.000	Oklahoma City Economic Development Trust 3.313% 01-Aug-2027	2.819.085	0,32	
Kommunalverwaltung - 103.358.605		103.358.605	11,61	
(31. Dezember 2021: 125.999.684)				
9.530.000	Chicago Park District 2.925% 01-Jan-2038	6.957.901	0,78	
2.615.000	City of Glendale AZ 2.062% 01-Jul-2029	2.139.946	0,24	
3.000.000	City of New Haven CT 4.834% 01-Aug-2033	2.864.895	0,32	
2.380.000	City of New York NY 3.450% 01-Dec-2027	2.222.111	0,25	
1.665.000	City of New York NY 3.750% 01-Jun-2028	1.565.991	0,18	
1.000.000	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2038	987.710	0,11	
2.500.000	City of Philadelphia PA 2.864% 15-Jul-2031	2.033.812	0,23	
4.000.000	City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033	4.458.940	0,50	
6.500.000	Clackamas County School District No 12 North Clackamas 0.000% 15-Jun-2039	3.125.038	0,35	
1.000.000	Clark County School District 5.000% 15-Jun-2035	1.108.735	0,12	
3.000.000	Commonwealth of Massachusetts 4.110% 15-Jul-2031	2.898.150	0,33	
5.450.000	Contra Costa Community College District 2.926% 01-Aug-2038	4.150.611	0,47	
2.350.000	County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033	2.611.931	0,29	
12.650.000	County of Cook IL 5.790% 15-Nov-2029	12.874.917	1,45	
13.095.000	County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029	10.676.026	1,20	
5.125.000	County of New Castle DE 1.810% 15-Jul-2030	4.086.367	0,46	
2.500.000	County of Tulare CA 3.859% 01-Jun-2026	2.396.912	0,27	
7.900.000	Detroit City School District 6.645% 01-May-2029	8.486.575	0,95	
3.000.000	El Paso Independent School District 1.872% 15-Aug-2031	2.384.085	0,27	
5.000.000	Los Angeles Community College District/CA 1.606% 01-Aug-2028	4.295.200	0,48	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Kommunalverwaltung Forts.			
6.145.000	Palomar Community College District 1.986% 01-Aug-2030	4.964.853	0,56
4.880.000	San Juan Unified School District 1.666% 01-Aug-2028	4.076.191	0,46
1.750.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	1.693.370	0,19
5.435.000	School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038	5.259.123	0,59
800.000	Southwestern Community College District 2.294% 01-Aug-2032	625.420	0,07
1.000.000	Southwestern Community College District 2.394% 01-Aug-2033	770.605	0,09
1.000.000	Southwestern Community College District 2.494% 01-Aug-2034	760.250	0,08
3.000.000	Town of Hamden CT 3.881% 15-Aug-2026	2.882.940	0,32
Gemeinnützige Organisationen - 3.565.134 (31. Dezember 2021: 4.789.850)			
2.500.000	Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3.474% 15-Dec-2029	2.157.252	0,24
2.000.000	Jackson Laboratory/The 3.468% 01-Jul-2051	1.407.882	0,16
Energie - 56.898.781 (31. Dezember 2021: 37.904.970)			
1.500.000	American Municipal Power Inc 6.973% 15-Feb-2024	1.530.225	0,17
1.100.000	American Municipal Power Inc 7.334% 15-Feb-2028	1.173.430	0,13
3.500.000	City of Austin TX Electric Utility Revenue 2.837% 15-Nov-2027	3.202.517	0,36
1.500.000	City of Lubbock TX Electric Light & Power System Revenue 4.000% 15-Apr-2034	1.542.472	0,17
7.865.000	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 4.258% 01-Feb-2036	7.004.530	0,79
11.750.000	Florida Municipal Power Agency 1.425% 01-Oct-2026	10.260.570	1,15
3.750.000	Municipal Electric Authority of Georgia 2.257% 01-Jan-2029	3.101.138	0,35
1.300.000	Municipal Electric Authority of Georgia 4.000% 01-Jan-2051	1.128.888	0,13
7.000.000	Municipal Electric Authority of Georgia 6.474% 01-Jul-2045	6.645.135	0,75
1.250.000	Oklahoma Municipal Power Authority 1.951% 01-Jan-2029	1.059.000	0,12
9.850.000	PEFA Inc 5.000 % 01-Sep-2049	10.088.370	1,13
2.685.000	San Francisco City & County Public Utilities Commission Power Revenue 4.000% 01-Nov-2051	2.527.431	0,28
4.000.000	South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2036	3.837.020	0,43
2.000.000	South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2042	1.827.130	0,21
1.000.000	South Carolina Public Service Authority 5.784% 01-Dec-2041	1.011.690	0,11
1.000.000	Southern California Public Power Authority 4.208% 01-Jul-2028	959.235	0,11
Prepaid Gas - 3.086.964 (31. Dezember 2021: 1.311.612)			
1.160.000	Kentucky Public Energy Authority 4.000% 01-Dec-2050	1.148.644	0,13
2.000.000	Kentucky Public Energy Authority 4.000% 01-Aug-2052	1.938.320	0,22
Pre-Refunded - 7.947.120 (31. Dezember 2021: 9.978.047)			
2.995.000	City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029	3.042.531	0,34
435.000	City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029	435.000	0,05
5.485.000	City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029	4.469.589	0,50
Renten - 7.660.574 (31. Dezember 2021: 9.089.362)			
495.000	Berks County Industrial Development Authority 3.950% 15-May-2024	485.684	0,06
2.260.000	Colorado Health Facilities Authority 5.000% 01-Dec-2043	2.261.718	0,25

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Renten Forts.			
1.000.000	Montgomery County Industrial Development Authority/PA 5.000% 15-Nov-2036	1.000.985	0,11
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2037	923.145	0,10
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2042	891.730	0,10
2.500.000	St Louis County Industrial Development Authority 5.000% 01-Sep-2048	2.097.312	0,24
Regierung Bundesstaaten - 9.981.737 (31. Dezember 2021: 25.274.063)			
2.000.000	State of California 4.500% 01-Apr-2033	1.925.500	0,22
2.000.000	State of Connecticut 5.000% 15-Nov-2042	2.181.900	0,24
7.500.000	State of New York 3.170% 15-Feb-2038	5.874.337	0,66
Telekommunikation - 1.118.690 (31. Dezember 2021: -)			
1.000.000	Utah Telecommunication Open Infrastructure Agency 5.250% 01-Jun-2037	1.118.690	0,13
Transport - 192.147.488 (31. Dezember 2021: 217.211.637)			
2.000.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.174% 01-Jan-2029	1.697.660	0,19
2.250.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.274% 01-Jan-2030	1.868.704	0,21
2.750.000	Central Texas Regional Mobility Authority 2.354% 01-Jan-2031	2.238.115	0,25
4.000.000	Central Texas Turnpike System 3.029% 15-Aug-2041	2.840.760	0,32
1.250.000	Chicago Midway International Airport 3.655% 01-Jan-2025	1.217.819	0,14
1.500.000	Chicago Midway International Airport 3.697% 01-Jan-2026	1.442.543	0,16
1.200.000	Chicago Midway International Airport 3.747% 01-Jan-2027	1.140.180	0,13
900.000	Chicago Midway International Airport 3.797% 01-Jan-2028	844.848	0,09
5.000.000	Chicago O'Hare International Airport 4.472% 01-Jan-2049	4.417.025	0,50
5.850.000	Chicago O'Hare International Airport 5.000% 01-Jan-2033	5.967.965	0,67
8.250.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028	7.010.396	0,79
1.500.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 5.000% 01-Dec-2036	1.635.885	0,18
3.955.000	City of Atlanta GA Department of Aviation 5.000% 01-Jul-2028	4.229.853	0,47
2.150.000	City of Houston TX Airport System Revenue 1.716% 01-Jul-2026	1.928.969	0,22
5.000.000	City of Houston TX Airport System Revenue 4.000% 01-Jul-2047	4.398.475	0,49
4.000.000	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2035	4.222.780	0,47
1.500.000	City of Phoenix Civic Improvement Corp 5.000% 01-Jul-2029	1.611.630	0,18
5.000.000	Colorado Bridge Enterprise 2.543% 31-Dec-2032	4.179.150	0,47
2.000.000	Colorado High Performance Transportation Enterprise 5.000% 31-Dec-2047	1.985.900	0,22
12.930.000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.384% 01-Oct-2026	11.818.925	1,33
1.000.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 01-Oct-2029	898.830	0,10
4.400.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.505% 01-Oct-2025	4.239.774	0,48
3.000.000	Dallas Area Rapid Transit 2.078% 01-Dec-2031	2.385.690	0,27
13.440.000	Dallas Fort Worth International Airport 3.089% 01-Nov-2040	10.473.053	1,18
2.500.000	Dallas Fort Worth International Airport 4.000% 01-Nov-2034	2.564.425	0,29
1.500.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 2.962% 15-Jan-2046	974.302	0,11
3.750.000	Greater Orlando Aviation Authority 5.000% 01-Oct-2044	3.840.788	0,43
1.260.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2040	1.332.595	0,15

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Transport Forts.			
2.500.000	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045	2.636.437	0,30
2.000.000	Kenton County Airport Board 4.689% 01-Jan-2049	1.672.430	0,19
1.750.000	Maryland Economic Development Corp 4.750% 01-Jun-2042	1.445.937	0,16
3.040.000	Maryland Economic Development Corp 5.250% 30-Jun-2052	3.015.543	0,34
5.000.000	Massachusetts Port Authority 1.879% 01-Jul-2033	3.683.775	0,41
3.350.000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.411% 01-Jul-2033	2.627.472	0,29
2.000.000	Metropolitan Nashville Airport Authority/The 5.000% 01-Jul-2049	2.030.360	0,23
5.000.000	Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044	5.121.050	0,57
3.500.000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4.000% 01-Oct-2049	3.029.967	0,34
5.150.000	New Jersey Turnpike Authority 1.813% 01-Jan-2030	4.182.032	0,47
1.000.000	New Jersey Turnpike Authority 7.414% 01-Jan-2040	1.242.090	0,14
3.000.000	New York State Thruway Authority 2.900% 01-Jan-2035	2.466.030	0,28
5.000.000	New York State Thruway Authority 4.000% 01-Jan-2045	4.653.450	0,52
5.000.000	New York Transportation Development Corp 3.573% 01-Jul-2029	4.493.725	0,50
2.500.000	New York Transportation Development Corp 4.375% 01-Oct-2045	2.244.138	0,25
2.000.000	New York Transportation Development Corp 5.000% 01-Dec-2040	2.030.280	0,23
2.500.000	New York Transportation Development Corp 5.250% 01-Jan-2050	2.432.862	0,27
1.000.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 1.882% 01-Mar-2028	848.170	0,09
1.150.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.210% 01-Mar-2029	961.118	0,11
1.375.000	Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.310% 01-Mar-2030	1.121.677	0,13
7.000.000	North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033	5.408.445	0,61
3.260.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216% 15-Feb-2048	2.330.639	0,26
4.500.000	Pennsylvania Turnpike Commission 2.890% 01-Dec-2035	3.540.600	0,40
8.245.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.043% 01-Dec-2033	6.855.800	0,77
3.350.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3.416% 01-Dec-2041	2.541.896	0,29
1.000.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.000% 15-Jul-2055	868.715	0,10
1.500.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.823% 01-Jun-2045	1.383.397	0,15
3.000.000	Port Authority of New York & New Jersey 5.000% 15-Jan-2052	3.079.284	0,35
1.295.000	Port Authority of New York & New Jersey 5.310% 01-Aug-2046	1.292.630	0,14
1.080.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.699% 01-Dec-2026	1.033.965	0,12
1.135.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.799% 01-Dec-2028	1.063.620	0,12
500.000	Port of Oakland 2.099% 01-May-2030	404.703	0,05
3.000.000	San Diego County Regional Airport Authority 2.656% 01-Jul-2033	2.365.875	0,27
2.975.000	San Francisco Municipal Transportation Agency 1.537% 01-Mar-2029	2.392.138	0,27
7.500.000	San Joaquin Hills Transportation Corridor Agency 3.492% 15-Jan-2050	5.284.875	0,59
1.250.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.174% 01-Jul-2026	1.153.819	0,13
750.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.431% 01-Jul-2028	667.853	0,07
2.290.000	State of Ohio 5.000% 31-Dec-2039	2.293.882	0,26
3.000.000	Virginia Small Business Financing Authority 5.000% 31-Dec-2052	2.839.770	0,32
Wasser - 36.891.911			
(31. Dezember 2021: 73.296.801)		36.891.911	4,14
1.650.000	City & County Honolulu HI Wastewater System Revenue 2.316% 01-Jul-2025	1.561.065	0,18

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	Summe Nettovermögen %
Anleihen Forts.			
Wasser Forts.			
1.000.000	City of Chicago IL Wastewater Transmission Revenue 5.000% 01-Jan-2039	1.005.405	0,11
4.300.000	City of New Orleans LA Water System Revenue 2.889% 01-Dec-2041	2.960.012	0,33
2.935.000	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 2.825% 01-Nov-2041	2.193.986	0,25
3.040.000	City of Springfield MO Public Utility Revenue 2.300% 01-Nov-2032	2.314.094	0,26
3.690.000	County of Fairfax VA Sewer Revenue 3.000% 15-Jul-2037	3.250.890	0,36
5.000.000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 2.911% 01-Oct-2032	4.065.950	0,46
4.000.000	East Baton Rouge Sewerage Commission 2.437% 01-Feb-2039	2.825.680	0,32
3.000.000	Florida Water Pollution Control Financing Corp 2.550% 15-Jan-2029	2.610.330	0,29
3.000.000	Great Lakes Water Authority Sewage Disposal System Revenue 3.056% 01-Jul-2039	2.309.460	0,26
3.000.000	Irvine Ranch Water District 6.622% 01-May-2040	3.358.770	0,38
5.000.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 2.534% 01-Dec-2032	4.026.650	0,45
1.810.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 5.720% 01-Dec-2038	1.915.487	0,21
2.250.000	Ohio Water Development Authority 4.817% 01-Dec-2030	2.198.205	0,25
330.000	State of California Department of Water Resources 3.127% 01-Dec-2029	295.927	0,03
Gesamtanlagen in Anleihen		850.601.635	95,53
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 4.916.513 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 3.695.769)		4.916.513	0,55
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		855.518.148	96,08
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (104.789) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (29.655))		(104.789)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt		(104.789)	(0,01)
Nettoumlaufvermögen		34.964.802	3,93
Summe Nettovermögen		890.378.161	100,00
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			95,43
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)			0,55
Sonstiges Umlaufvermögen			4,02
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Acc) (Hedged)

Australischer Dollar	US-Dollar	47	33	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Australischer Dollar	29	43	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
USD						-
AUD						-
Australischer Dollar	US-Dollar	8.383	5.711	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Australischer Dollar	5.577	8.305	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Australischer Dollar	55	83	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(82)
AUD						(120)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Inc) (Hedged)

Australischer Dollar	US-Dollar	0	0	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Australischer Dollar	US-Dollar	47	33	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Australischer Dollar	29	43	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
USD						-
AUD						-
Australischer Dollar	US-Dollar	8.389	5.716	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Australischer Dollar	5.581	8.311	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(80)
US-Dollar	Australischer Dollar	55	83	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
USD						(82)
AUD						(120)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	4.159.019	4.471.431	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31.804
US-Dollar	Schweizer Franken	48.324	44.585	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	50
USD						31.854
CHF						29.454
Schweizer Franken	US-Dollar	25.371	27.544	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(73)
US-Dollar	Schweizer Franken	147.197	136.800	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(926)
US-Dollar	Schweizer Franken	276.400	255.556	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(307)
US-Dollar	Schweizer Franken	48.422	44.786	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(71)
US-Dollar	Schweizer Franken	23.223	21.599	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(164)
USD						(1.541)
CHF						(1.425)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	113.805	122.354	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	870
US-Dollar	Schweizer Franken	1.473	1.359	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
USD						872
CHF						806

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) Forts.

Schweizer Franken	US-Dollar	686	744	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.341	1.240	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Schweizer Franken	638	593	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
USD						(9)
CHF						(8)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	26.361.371	28.341.548	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	201.585
US-Dollar	Schweizer Franken	337.637	311.509	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	346
USD						201.931
CHF						186.715
Schweizer Franken	US-Dollar	160.526	174.271	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(460)
US-Dollar	Schweizer Franken	307.450	284.366	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(451)
US-Dollar	Schweizer Franken	147.271	136.975	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.041)
USD						(1.952)
CHF						(1.805)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	5.840.161	6.278.854	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	44.660
US-Dollar	Schweizer Franken	74.801	69.012	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	77
USD						44.737
CHF						41.366

Schweizer Franken	US-Dollar	35.563	38.608	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(102)
US-Dollar	Schweizer Franken	68.113	62.999	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(100)
US-Dollar	Schweizer Franken	32.627	30.346	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(231)
USD						(433)
CHF						(400)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF Z (Acc) (Hedged)

Schweizer Franken	US-Dollar	18.598	19.927	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	186
Schweizer Franken	US-Dollar	18.686	20.044	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	188
Schweizer Franken	US-Dollar	4.803	5.168	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	32
Schweizer Franken	US-Dollar	23.802	25.561	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	211
Schweizer Franken	US-Dollar	9.692	10.468	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	26
Schweizer Franken	US-Dollar	6.075	6.562	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	16
Schweizer Franken	US-Dollar	82.317.029	88.500.407	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	629.478
US-Dollar	Schweizer Franken	9.895	9.122	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18
US-Dollar	Schweizer Franken	1.049.922	968.674	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.077
US-Dollar	Schweizer Franken	37.065	34.111	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	132
USD						631.364
CHF						583.791

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
US-Dollar	Schweizer Franken	20.021	18.686	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(187)
Schweizer Franken	US-Dollar	9.122	9.886	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(19)
Schweizer Franken	US-Dollar	501.304	544.229	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.435)
Schweizer Franken	US-Dollar	15.616	16.969	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(60)
US-Dollar	Schweizer Franken	1.799	1.676	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Schweizer Franken	46.104	42.988	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(442)
US-Dollar	Schweizer Franken	40.773	37.750	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(101)
US-Dollar	Schweizer Franken	9.629	8.915	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(24)
US-Dollar	Schweizer Franken	27.414	25.527	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(226)
US-Dollar	Schweizer Franken	31.991	29.658	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(122)
US-Dollar	Schweizer Franken	957.671	885.767	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.405)
US-Dollar	Schweizer Franken	4.556	4.213	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(5)
US-Dollar	Schweizer Franken	18.762	17.351	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(25)
US-Dollar	Schweizer Franken	96.917	90.072	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(609)
US-Dollar	Schweizer Franken	44.889	41.571	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(123)
US-Dollar	Schweizer Franken	19.949	18.598	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(187)
US-Dollar	Schweizer Franken	459.650	427.515	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(3.248)
US-Dollar	Schweizer Franken	21.136	19.704	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(199)
					USD	(8.432)
					CHF	(7.797)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	33.035	35.280	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	108
Euro	US-Dollar	5.580.873	5.904.342	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	74.052
					USD	74.160
					EUR	69.279
US-Dollar	Euro	68.396	64.229	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(408)
US-Dollar	Euro	58.837	56.334	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(609)
US-Dollar	Euro	30.752	29.050	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(367)
					USD	(1.284)
					EUR	(1.199)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	55	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	9.294	9.833	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	123
US-Dollar	Euro	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	123
					EUR	115
US-Dollar	Euro	9.784	9.207	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(78)
US-Dollar	Euro	100	94	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
US-Dollar	Euro	51	48	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(80)
					EUR	(75)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	164	174	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	US-Dollar	4.093	4.367	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	15
Euro	US-Dollar	64.025	68.353	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	233
Euro	US-Dollar	2.494	2.650	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	22
Euro	US-Dollar	3.433	3.644	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	33
Euro	US-Dollar	15.678	16.671	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	124
Euro	US-Dollar	541.839	575.710	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4.724
Euro	US-Dollar	40.384	42.865	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	396
Euro	US-Dollar	40.842	43.518	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	234
Euro	US-Dollar	88.019	94.001	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	288
Euro	US-Dollar	45.648	48.320	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	580
Euro	US-Dollar	15.017.714	15.888.146	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	199.268
					USD	205.918
					EUR	192.366
US-Dollar	Euro	2.648	2.494	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Euro	68.310	64.025	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(230)
US-Dollar	Euro	4.370	4.093	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
US-Dollar	Euro	174	164	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	188.203	176.737	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.122)
US-Dollar	Euro	74.606	70.285	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(685)
US-Dollar	Euro	9.662	9.092	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(77)
US-Dollar	Euro	162.459	152.948	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.383)
US-Dollar	Euro	443.247	416.291	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.696)
US-Dollar	Euro	57.600	54.058	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(309)
US-Dollar	Euro	83.300	78.688	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(994)
					USD	(7.534)
					EUR	(7.038)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	2.962	3.163	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	10
Euro	US-Dollar	506.858	536.235	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	6.725
					USD	6.735
					EUR	6.292
US-Dollar	Euro	6.292	5.909	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(38)
US-Dollar	Euro	5.506	5.183	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(47)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Euro	2.803	2.648	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(33)
					USD	(118)
					EUR	(110)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	1.357	1.449	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	4
Euro	US-Dollar	230.023	243.355	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.052
					USD	3.056
					EUR	2.855
US-Dollar	Euro	2.829	2.657	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(17)
US-Dollar	Euro	2.475	2.331	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(21)
US-Dollar	Euro	1.269	1.199	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(15)
					USD	(53)
					EUR	(50)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	48	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	8.256	8.734	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	110
US-Dollar	Euro	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	110
					EUR	103
US-Dollar	Euro	8.688	8.175	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70)
US-Dollar	Euro	90	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	46	43	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(72)
					EUR	(67)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	0	0	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	48	51	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	8.260	8.739	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	110
US-Dollar	Euro	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
					USD	110
					EUR	103
US-Dollar	Euro	8.693	8.180	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(70)
US-Dollar	Euro	90	85	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
US-Dollar	Euro	46	43	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)
					USD	(72)
					EUR	(67)

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	99.655	105.814	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	862
Euro	US-Dollar	57.922	61.799	4. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	208
Euro	US-Dollar	2.062	2.191	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	18
Euro	US-Dollar	8.801	9.342	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	86
Euro	US-Dollar	2.204	2.343	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	17
Euro	US-Dollar	4.354	4.626	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	38
Euro	US-Dollar	17.555	18.692	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	114
Euro	US-Dollar	244.270	261.442	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	227
Euro	US-Dollar	42.119	44.878	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	241
Euro	US-Dollar	809.808	864.844	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2.646
Euro	US-Dollar	14.267	15.073	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	210
Euro	US-Dollar	5.863	6.190	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	91
Euro	US-Dollar	27.727	29.350	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	352
Euro	US-Dollar	137.085.540	145.031.069	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.818.968
					USD	1.824.078
					EUR	1.704.028

US-Dollar	Euro	2.189	2.062	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(18)
US-Dollar	Euro	61.837	57.922	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(210)
US-Dollar	Euro	11.965	11.333	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(175)
US-Dollar	Euro	7.028	6.652	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(98)
US-Dollar	Euro	4.088	3.837	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(22)
US-Dollar	Euro	2.337.773	2.184.220	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(2.027)
US-Dollar	Euro	53.438	50.188	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(325)
US-Dollar	Euro	11.637	10.963	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(107)
US-Dollar	Euro	81.434	76.643	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(668)
US-Dollar	Euro	1.449.136	1.364.296	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(12.337)
US-Dollar	Euro	53.844	50.637	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(400)
US-Dollar	Euro	133.616	125.731	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1.071)
US-Dollar	Euro	95.766	90.219	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(880)
US-Dollar	Euro	83.385	78.422	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(623)
US-Dollar	Euro	1.654.417	1.553.620	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.866)
US-Dollar	Euro	105.882	99.655	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(872)
US-Dollar	Euro	755.635	713.806	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(9.014)
US-Dollar	Euro	58.738	55.491	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(705)
					USD	(39.418)
					EUR	(36.824)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	242.692	256.408	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	3.571
Euro	US-Dollar	7.681	8.109	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	119
Euro	US-Dollar	2.438	2.581	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	31
Euro	US-Dollar	141.620.188	149.828.548	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.879.137
Euro	US-Dollar	122.809	130.482	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1.075
Euro	US-Dollar	54.723	58.186	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	435

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	23.397	24.835	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		228
Euro	US-Dollar	16.102	17.122	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		127
Euro	US-Dollar	53.905	57.275	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		470
Euro	US-Dollar	32.558	34.558	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		319
Euro	US-Dollar	6.112	6.508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		40
Euro	US-Dollar	2.033	2.166	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		12
Euro	US-Dollar	898.135	895.096	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		2.739
						USD	1.888.303
						EUR	1.764.026
US-Dollar	Euro	130.399	122.809	3. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1.062)
US-Dollar	Euro	1.742.150	1.636.008	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(10.390)
US-Dollar	Euro	13.214	12.428	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(99)
US-Dollar	Euro	43.905	41.362	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(403)
US-Dollar	Euro	1.523.646	1.434.443	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(12.972)
US-Dollar	Euro	4.737	4.458	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(39)
US-Dollar	Euro	59.088	55.495	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(359)
US-Dollar	Euro	8.280	7.736	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(7)
US-Dollar	Euro	11.700	11.074	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(163)
US-Dollar	Euro	13.658	12.936	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(200)
US-Dollar	Euro	780.739	737.520	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(9.314)
US-Dollar	Euro	11.183	10.565	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(134)
						USD	(35.142)
						EUR	(32.829)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	1.387	1.481	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		5
Euro	US-Dollar	234.529	248.122	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3.112
						USD	3.117
						EUR	2.912
US-Dollar	Euro	2.877	2.702	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(17)
US-Dollar	Euro	2.517	2.370	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(21)
US-Dollar	Euro	1.293	1.221	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(15)
						USD	(53)
						EUR	(50)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling G (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	104	86	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	56	46	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
						USD	1
						GBP	1

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling G (Inc) (Hedged) Forts.							
Pfund Sterling	US-Dollar	51	64	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.753	10.761	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(177)
US-Dollar	Pfund Sterling	10.487	8.672	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(180)
						GBP	(149)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)							
Pfund Sterling	US-Dollar	0	0	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	1	1	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	124	103	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	67	54	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
						USD	1
						GBP	1
Pfund Sterling	US-Dollar	61	75	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	10.388	12.772	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(210)
US-Dollar	Pfund Sterling	12.444	10.291	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(1)
						USD	(213)
						GBP	(176)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	4.555	3.764	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		3
US-Dollar	Pfund Sterling	2.469	2.010	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		39
						USD	42
						GBP	35
Pfund Sterling	US-Dollar	2.268	2.820	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(78)
Pfund Sterling	US-Dollar	384.910	473.234	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(7.762)
US-Dollar	Pfund Sterling	5.161	4.287	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(24)
						USD	(7.864)
						GBP	(6.505)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Pfund Sterling	101	83	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		-
US-Dollar	Pfund Sterling	55	45	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		1
						USD	1
						GBP	1
Pfund Sterling	US-Dollar	50	63	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(2)
Pfund Sterling	US-Dollar	8.547	10.508	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon		(172)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged) Forts.

US-Dollar	Pfund Sterling	10,241	8,469	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(1)	
						USD	(175)
						GBP	(145)

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen				
Australien - 8.997.812				
(31. Dezember 2021: 14.444.187)		8.997.812	0,89	
2.292.000	Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 4.750% 24-Sep-2080	1.918.675	0,19	
1.111.000	Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 5.125% 24-Sep-2080	871.505	0,08	
4.255.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028	3.719.593	0,37	
2.530.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 2.750% 23-Apr-2024	2.488.039	0,25	
Österreich - 19.125.422				
(31. Dezember 2021: 4.420.418)		19.125.422	1,90	
3.000.000	Erste Group Bank AG 'EMTN' FRN 1.000% 10-Jun-2030	2.648.799	0,26	
4.900.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0.375% 25-Sep-2026	4.169.085	0,42	
6.300.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	6.185.938	0,61	
2.000.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 2.875% 18-Jun-2032	1.644.100	0,16	
4.500.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 7.375% 20-Dec-2032	4.477.500	0,45	
Belgien - 22.410.917				
(31. Dezember 2021: 20.889.913)		22.410.917	2,22	
2.300.000	Belfius Bank SA 'EMTN' 0.000% 28-Aug-2026	2.027.560	0,20	
1.800.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 0.875% 28-Apr-2030	1.454.795	0,14	
2.800.000	Groupe Bruxelles Lambert NV 0.125% 28-Jan-2031	2.079.880	0,21	
2.100.000	Groupe Bruxelles Lambert NV 1.875% 19-Jun-2025	2.024.022	0,20	
3.900.000	KBC Group NV 'EMTN' 0.750% 18-Oct-2023	3.840.038	0,38	
2.900.000	KBC Group NV 'EMTN' 1.125% 25-Jan-2024	2.843.441	0,28	
7.100.000	KBC Group NV 'EMTN' 3.000% 25-Aug-2030	6.552.519	0,65	
1.800.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0.250% 01-Mar-2027	1.588.662	0,16	
Kanada - 11.179.951				
(31. Dezember 2021: 2.028.173)		11.179.951	1,11	
11.568.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 3.631% 13-Dec-2029	11.179.951	1,11	
Dänemark - 4.839.670				
(31. Dezember 2021: 4.548.936)		4.839.670	0,48	
2.907.000	Nykredit Realkredit AS 'EMTN' 0.125% 10-Jul-2024	2.744.322	0,27	
2.049.000	Orsted AS FRN 5.250% 08-Dec-3022	2.095.348	0,21	
Finnland - 8.243.507				
(31. Dezember 2021: 12.033.707)		8.243.507	0,82	
4.292.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.125% 01-Jul-2024	4.095.880	0,41	
2.161.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.375% 26-Feb-2024	2.090.718	0,21	
2.414.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.625% 27-Jul-2027	2.056.909	0,20	
Frankreich - 201.986.500				
(31. Dezember 2021: 167.753.787)		201.986.500	20,01	
700.000	Aéroports de Paris 2.750% 02-Apr-2030	643.659	0,06	
4.300.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	4.314.685	0,43	
3.100.000	APRR SA 'EMTN' 1.250% 18-Jan-2028	2.784.187	0,28	
1.200.000	Arkema SA 'EMTN' 0.125% 14-Oct-2026	1.054.902	0,10	
5.300.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 0.875% 17-Feb-2025	4.993.528	0,49	
5.700.000	Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	5.684.411	0,56	
1.339.000	AXA SA 'EMTN' FRN 3.250% 28-May-2049	1.191.434	0,12	
1.740.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.941% 07-Nov-2024	1.705.677	0,17	
1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.250% 03-Jun-2030	813.979	0,08	
3.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.100% 08-Oct-2027	2.543.070	0,25	
3.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.125% 05-Feb-2024	3.290.297	0,33	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Frankreich Forts.				
4.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.750% 01-Feb-2033	4.198.832	0,42	
6.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.000% 21-Nov-2029	6.128.030	0,61	
7.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3.875% 16-Jun-2032	7.424.894	0,74	
2.600.000	BNP Paribas Cardif SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2024	2.458.880	0,24	
100.000	BNP Paribas Cardif SA FRN (Perpetual) 4.032% 25-Nov-2025	96.503	0,01	
2.300.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2.100% 07-Apr-2032	1.913.198	0,19	
1.900.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.500% 15-Jul-2025	1.804.830	0,18	
3.800.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.500% 19-Feb-2028	3.234.782	0,32	
3.600.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.125% 23-Jan-2027	3.364.666	0,33	
2.900.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.500% 31-Mar-2032	2.572.503	0,25	
4.500.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2.750% 25-Jul-2028	4.178.295	0,41	
4.900.000	Bouygues SA 5.375% 30-Jun-2042	5.038.719	0,50	
3.200.000	BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	2.894.336	0,29	
4.700.000	BPCE SA 0.250% 14-Jan-2031	3.506.952	0,35	
8.000.000	BPCE SA 'EMTN' 0.375% 02-Feb-2026	7.232.760	0,72	
1.500.000	BPCE SA 'EMTN' 1.375% 23-Mar-2026	1.383.976	0,14	
3.200.000	BPCE SA 'EMTN' 4.000% 29-Nov-2032	3.120.032	0,31	
3.600.000	BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042	3.020.652	0,30	
1.200.000	Carrefour SA 'EMTN' 0.875% 12-Jun-2023	1.190.280	0,12	
600.000	Carrefour SA 'EMTN' 2.625% 15-Dec-2027	568.374	0,06	
2.900.000	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.250% 02-Nov-2032	2.144.028	0,21	
3.900.000	Credit Agricole Assurances SA 2.000% 17-Jul-2030	3.099.600	0,31	
3.100.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.375% 20-Apr-2028	2.549.130	0,25	
700.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.750% 05-Mar-2029	609.679	0,06	
1.300.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.875% 20-Dec-2026	1.200.018	0,12	
3.000.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 0.875% 07-May-2027	2.643.568	0,26	
2.300.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 3.375% 19-Sep-2027	2.236.647	0,22	
1.800.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 4.250% 01-Dec-2032	1.788.408	0,18	
2.000.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN 1.875% 25-Oct-2029	1.888.549	0,19	
2.500.000	Danone SA 'EMTN' 1.000% 26-Mar-2025	2.392.912	0,24	
3.100.000	Dassault Systemes SE 0.125% 16-Sep-2026	2.760.794	0,27	
1.300.000	Electricite de France SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2033	905.821	0,09	
1.100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049	675.950	0,07	
6.100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	6.049.065	0,60	
500.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	495.825	0,05	
1.200.000	Engie SA 'EMTN' 0.500% 24-Oct-2030	921.219	0,09	
800.000	Engie SA 'EMTN' 2.125% 30-Mar-2032	683.155	0,07	
2.520.000	Faurecia SE 3.750% 15-Jun-2028	2.144.407	0,21	
1.600.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Aug-2032	1.284.486	0,13	
3.800.000	La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031	3.301.079	0,33	
3.600.000	La Banque Postale SA FRN 5.500% 05-Mar-2034	3.541.500	0,35	
1.700.000	MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1.250% 13-Jun-2028	1.493.024	0,15	
4.500.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2.125% 21-Jun-2052	3.062.137	0,30	
1.900.000	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2.125% 21-Jun-2052	1.286.290	0,13	
3.300.000	Orange SA 1.200% 11-Jul-2034	2.447.230	0,24	
1.900.000	Orange SA 'EMTN' 0.625% 16-Dec-2033	1.358.671	0,13	
1.800.000	Orange SA 'EMTN' 2.375% 18-May-2032	1.626.543	0,16	
500.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 15-Jul-2028	409.747	0,04	
3.500.000	RCI Banque SA 'EMTN' 0.250% 08-Mar-2023	3.483.795	0,34	
1.100.000	RCI Banque SA 'EMTN' 1.625% 11-Apr-2025	1.037.547	0,10	
2.700.000	Sanofi 1.250% 06-Apr-2029	2.403.945	0,24	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Frankreich Forts.				
1.100.000	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.500% 29-May-2025	1.022.955	0,10	
900.000	Societe Generale SA 0.750% 25-Jan-2027	780.408	0,08	
2.000.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1.375% 13-Jan-2028	1.727.000	0,17	
6.300.000	Societe Generale SA 'EMTN' 2.625% 30-May-2029	5.848.920	0,58	
3.900.000	Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027	3.356.457	0,33	
370.000	Sodexo SA 2.500% 24-Jun-2026	358.998	0,03	
600.000	Sogetec SA FRN (Perpetual) 4.125% 18-Feb-2026	575.517	0,06	
3.300.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	2.785.464	0,28	
4.200.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	4.307.793	0,43	
1.800.000	TDF Infrastructure SASU 2.500% 07-Apr-2026	1.647.533	0,16	
2.100.000	Terega SA 0.875% 17-Sep-2030	1.593.070	0,16	
3.872.000	TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2024	3.663.265	0,36	
3.322.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1.625% 25-Oct-2027	2.703.012	0,27	
2.253.000	TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 17-Jan-2027	1.927.892	0,19	
3.600.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	3.060.162	0,30	
2.200.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	1.648.020	0,16	
886.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.500% 22-Feb-2028	760.086	0,07	
400.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 2.250% 14-May-2038	289.536	0,03	
5.300.000	Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028	4.069.605	0,40	
1.200.000	Valeo 'EMTN' 5.375% 28-May-2027	1.170.456	0,12	
2.700.000	Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026	2.414.259	0,24	
Deutschland - 102.695.552				
(31. Dezember 2021: 99.148.552)		102.695.552	10,18	
3.300.000	adidas AG 0.000% 09-Sep-2024	3.125.055	0,31	
1.200.000	adidas AG 0.000% 05-Oct-2028	1.005.037	0,10	
2.800.000	Allianz SE 'EMTN' FRN 4.252% 05-Jul-2052	2.581.040	0,26	
4.800.000	Allianz SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 24-Oct-2023	4.773.072	0,47	
5.600.000	Allianz SE FRN (Perpetual) 3.375% 18-Sep-2024	5.417.230	0,54	
1.400.000	Amprion GmbH 3.971% 22-Sep-2032	1.389.122	0,14	
3.000.000	BASF SE 'EMTN' 3.750% 29-Jun-2032	2.971.500	0,29	
1.700.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0.000% 11-Jan-2026	1.545.762	0,15	
2.226.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1.000% 22-May-2028	1.961.841	0,19	
1.514.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 28-Aug-2023	1.492.834	0,15	
1.400.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1.875% 28-Feb-2028	1.211.770	0,12	
700.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	640.225	0,06	
1.100.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030	1.036.739	0,10	
3.000.000	Commerzbank AG FRN 3.000% 14-Sep-2027	2.799.450	0,28	
1.377.000	Continental AG 'EMTN' 2.500% 27-Aug-2026	1.323.247	0,13	
1.121.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 0.625% 08-Dec-2050	557.760	0,06	
3.600.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 0.750% 17-Feb-2027	3.142.758	0,31	
2.800.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.000% 19-Nov-2025	2.616.082	0,26	
764.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026	718.839	0,07	
4.400.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 4.000% 24-Jun-2032	3.906.540	0,39	
4.700.000	Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032	3.435.841	0,34	
1.500.000	Deutsche Boerse AG FRN 1.250% 16-Jun-2047	1.309.963	0,13	
297.000	E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033	331.394	0,03	
1.927.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	1.621.667	0,16	
3.100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	2.450.063	0,24	
600.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2028	533.904	0,05	
800.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.875% 10-Jun-2025	769.324	0,08	
2.900.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3.279% 05-Sep-2031	2.795.136	0,28	
2.400.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	2.231.664	0,22	
2.500.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31-Mar-2028	2.146.250	0,21	
5.500.000	Grand City Properties SA 'EMTN' 0.125% 11-Jan-2028	3.689.507	0,37	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Deutschland Forts.				
1.400.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.125% 24-Jun-2026	1.283.673	0,13	
2.000.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029	1.742.820	0,17	
800.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032	671.156	0,07	
4.000.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.375% 17-Jan-2026	3.507.980	0,35	
1.700.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.875% 17-Jan-2029	1.335.401	0,13	
2.016.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2033	1.509.339	0,15	
1.892.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN' 2.000% 22-Aug-2026	1.813.236	0,18	
700.000	Merck KGaA FRN 1.625% 25-Jun-2079	661.547	0,07	
2.700.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049	2.420.967	0,24	
2.000.000	SAP SE 1.250% 10-Mar-2028	1.817.441	0,18	
3.000.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 2.250% 10-Mar-2025	2.938.230	0,29	
2.100.000	Vier Gas Transport GmbH 'EMTN' 4.625% 26-Sep-2032	2.119.121	0,21	
2.800.000	Vonovia Finance BV 1.800% 29-Jun-2025	2.625.513	0,26	
2.300.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.875% 03-Jul-2023	2.270.307	0,23	
1.400.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.000% 09-Jul-2030	1.053.056	0,10	
2.800.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2024	2.731.610	0,27	
2.000.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Oct-2039	1.188.800	0,12	
800.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.250% 15-Dec-2023	791.175	0,08	
2.100.000	Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041	1.180.473	0,12	
2.200.000	Vonovia SE 'EMTN' 5.000% 23-Nov-2030	2.157.507	0,21	
1.600.000	ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.750% 25-May-2027	1.345.584	0,13	
Hongkong - 1.234.145				
(31. Dezember 2021: 2.095.235)		1.234.145	0,12	
1.589.000	Alia Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033	1.234.145	0,12	
Irland - 24.118.331				
(31. Dezember 2021: 14.190.312)		24.118.331	2,39	
2.938.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.250% 04-Apr-2028	2.620.931	0,26	
1.330.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031	1.193.023	0,12	
4.152.000	AIB Group Plc FRN 3.625% 04-Jul-2026	4.027.772	0,40	
3.657.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031	3.078.938	0,30	
2.873.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 6.750% 01-Mar-2033	2.862.858	0,28	
811.000	CRH Funding BV 1.625% 05-May-2030	692.085	0,07	
4.027.000	Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026	3.498.799	0,35	
975.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024	933.845	0,09	
3.192.000	Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031	2.602.390	0,26	
3.343.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029	2.607.690	0,26	
Italien - 55.137.800				
(31. Dezember 2021: 49.389.055)		55.137.800	5,46	
1.380.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.124% 01-Oct-2030	1.136.085	0,11	
7.492.000	Enel Finance International NV 0.250% 17-Nov-2025	6.818.132	0,68	
3.957.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 28-May-2029	3.148.347	0,31	
1.500.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 0.500% 17-Jun-2030	1.150.509	0,11	
2.445.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.375% 08-Jun-2027	1.936.660	0,19	
2.636.000	Enel SpA FRN (Perpetual) 1.875% 08-Jun-2030	1.890.460	0,19	
2.713.000	Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027	2.258.952	0,22	
2.007.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024	1.911.035	0,19	
1.900.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.125% 16-Nov-2023	1.844.815	0,18	
2.820.000	Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 4.750% 18-Jan-2032	2.418.150	0,24	
1.451.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 8.248% 21-Nov-2033	1.383.784	0,14	
1.120.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024	1.063.622	0,11	
3.075.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	2.556.678	0,25	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Italien Forts.				
2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 04-Jul-2024	2.117.074	0,21	
1.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 2.125% 30-Aug-2023	1.195.104	0,12	
3.015.000	Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030	2.181.744	0,22	
1.315.000	Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024	1.237.165	0,12	
4.232.000	Leasys SpA 4.375% 07-Dec-2024	4.235.364	0,42	
2.602.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Nov-2028	2.112.798	0,21	
1.692.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 0.125% 25-Jul-2025	1.551.818	0,15	
3.000.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 23-Jul-2023	2.971.410	0,29	
1.368.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026	1.265.808	0,13	
1.500.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.375% 26-Jul-2027	1.357.259	0,13	
3.155.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	2.532.377	0,25	
2.070.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025	1.983.119	0,20	
957.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2.000% 23-Sep-2029	879.531	0,09	
Japan - 7.432.981				
(31. Dezember 2021: 7.934.700)		7.432.981	0,74	
3.561.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032	2.820.803	0,28	
4.904.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030	4.612.178	0,46	
Luxemburg - 16.997.050				
(31. Dezember 2021: 19.127.141)		16.997.050	1,68	
4.860.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 3.625% 29-Oct-2029	3.919.080	0,39	
1.367.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028	998.539	0,10	
3.809.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031	2.481.357	0,24	
1.984.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026	1.671.302	0,16	
2.892.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 15-Jul-2027	2.335.001	0,23	
540.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 17-Jan-2030	394.782	0,04	
3.534.000	P3 Group Sarl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	2.601.960	0,26	
3.000.000	SELP Finance Sarl 1.500% 20-Dec-2026	2.595.029	0,26	
Niederlande - 90.148.162				
(31. Dezember 2021: 78.119.661)		90.148.162	8,93	
1.800.000	ABN AMRO Bank NV 0.600% 15-Jan-2027	1.587.791	0,16	
1.200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.250% 28-May-2025	1.139.001	0,11	
2.000.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 2.875% 18-Jan-2028	2.000.700	0,20	
8.700.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	8.652.150	0,86	
2.718.000	Achmea BV 'EMTN' FRN 6.000% 04-Apr-2043	2.807.898	0,28	
2.958.000	Aegon Bank NV 0.625% 21-Jun-2024	2.823.167	0,28	
2.847.000	ASML Holding NV 2.250% 17-May-2032	2.581.332	0,25	
5.975.000	ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	6.027.968	0,60	
3.305.000	Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031	2.807.598	0,28	
1.700.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024	1.600.866	0,16	
1.900.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.750% 25-Jun-2023	1.881.817	0,19	
5.700.000	de Volksbank NV FRN 2.375% 04-May-2027	5.303.793	0,52	
2.251.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.375% 14-Apr-2033	1.614.158	0,16	
1.832.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032	1.386.976	0,14	
1.115.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0.750% 02-Jul-2031	877.923	0,09	
1.701.000	Euronext NV 1.000% 18-Apr-2025	1.597.734	0,16	
5.500.000	ING Groep NV 'EMTN' 1.000% 20-Sep-2023	5.423.083	0,54	
3.800.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 1.625% 26-Sep-2029	3.652.438	0,36	
800.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 26-May-2031	726.963	0,07	
3.000.000	ING Groep NV FRN 0.375% 29-Sep-2028	2.478.780	0,24	
4.400.000	ING Groep NV FRN 1.000% 13-Nov-2030	3.885.002	0,38	
2.000.000	ING Groep NV FRN 4.125% 24-Aug-2033	1.884.640	0,19	
1.800.000	ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	1.884.024	0,19	
5.736.000	JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028	4.807.944	0,47	
3.323.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026	2.891.060	0,29	
933.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024	906.208	0,09	
3.530.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 6.007% 01-Apr-2024	3.537.837	0,35	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Niederlande Forts.				
2.800.000	Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 0.375% 26-Feb-2025	2.597.361	0,26	
1.728.000	NN Group NV 'EMTN' 0.875% 13-Jan-2023	1.727.274	0,17	
284.000	NN Group NV 'EMTN' 1.625% 01-Jun-2027	257.117	0,02	
1.854.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 0.125% 30-Nov-2032	1.276.560	0,13	
1.822.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 0.875% 03-Jun-2030	1.476.284	0,14	
1.445.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	1.177.415	0,12	
3.331.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.750% 28-Oct-2042	3.568.534	0,35	
1.400.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 2.000% 10-Jul-2026	1.298.766	0,13	
Norwegen - 3.661.350				
(31. Dezember 2021: 2.689.852)		3.661.350	0,36	
4.200.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Jan-2028	3.661.350	0,36	
Polen - 1.009.099				
(31. Dezember 2021: 1.956.211)		1.009.099	0,10	
1.212.000	InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027	1.009.099	0,10	
Portugal - 5.046.863				
(31. Dezember 2021: 6.251.225)		5.046.863	0,50	
4.900.000	Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031	3.995.509	0,40	
1.064.000	EDP Finance BV 'EMTN' 3.875% 11-Mar-2030	1.051.354	0,10	
Republik Korea - 778.182				
(31. Dezember 2021: 784.811)		778.182	0,08	
780.000	LG Chem Ltd 'REGS' 0.500% 15-Apr-2023	778.182	0,08	
Spanien - 89.653.759				
(31. Dezember 2021: 73.504.699)		89.653.759	8,88	
6.700.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	5.641.735	0,56	
3.000.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	2.968.680	0,29	
2.300.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	2.163.398	0,21	
1.500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 1.000% 16-Jan-2030	1.359.292	0,13	
500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 3.104% 15-Jul-2031	482.578	0,05	
3.300.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA FRN 8.000% 22-Sep-2026	3.322.605	0,33	
1.800.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.625% 07-Mar-2024	1.751.778	0,17	
2.600.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028	2.099.565	0,21	
2.100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	1.977.003	0,20	
3.000.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	3.015.000	0,30	
1.500.000	Banco Santander SA 'EMTN' 0.300% 04-Oct-2026	1.319.835	0,13	
6.200.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.100% 26-Jan-2025	5.986.906	0,59	
1.900.000	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	1.604.860	0,16	
6.200.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025	5.782.151	0,57	
900.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1.000% 25-Jun-2024	866.204	0,09	
2.300.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1.750% 24-Oct-2023	2.274.125	0,23	
3.500.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Nov-2026	3.109.155	0,31	
3.400.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031	2.907.612	0,29	
2.900.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	2.847.771	0,28	
2.900.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.375% 14-Nov-2030	2.971.601	0,29	
1.100.000	Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033	807.125	0,08	
2.609.000	FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027	2.383.008	0,24	
3.400.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Aug-2027	2.778.276	0,27	
1.800.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.875% 22-Feb-2023	1.788.732	0,18	
1.100.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 2.250% 28-Jan-2029	884.080	0,09	
500.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 3.250% 12-Nov-2024	482.131	0,05	
400.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025	368.744	0,04	
2.600.000	Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027	2.235.272	0,22	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
3.130.000	Berry Global Inc 'REGS' 1.500% 15-Jan-2027	2.786.076	0,28	
916.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Jun-2027	802.762	0,08	
1.580.000	Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029	1.264.648	0,13	
1.935.000	Chubb INA Holdings Inc 1.550% 15-Mar-2028	1.712.679	0,17	
1.875.000	Chubb INA Holdings Inc 2.500% 15-Mar-2038	1.460.831	0,14	
1.247.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0.500% 08-Oct-2027	1.085.139	0,11	
4.150.000	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	4.063.078	0,40	
7.034.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	6.154.469	0,61	
1.255.000	Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032	953.210	0,09	
1.793.000	Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030	1.671.210	0,17	
1.200.000	DH Europe Finance II Sarl 0.750% 18-Sep-2031	938.394	0,09	
1.005.000	Digital Dutch Finco BV 1.000% 15-Jan-2032	705.877	0,07	
3.188.000	Dow Chemical Co/The 1.125% 15-Mar-2032	2.438.218	0,24	
2.248.000	Ecolab Inc 1.000% 15-Jan-2024	2.206.843	0,22	
3.519.000	Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061	1.843.182	0,18	
736.000	Fidelity National Information Services Inc 1.000% 03-Dec-2028	613.250	0,06	
4.401.000	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	3.954.240	0,39	
1.750.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025	1.740.944	0,17	
8.241.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024	8.144.663	0,81	
2.000.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 'EMTN' 1.750% 29-Mar-2030	1.726.680	0,17	
290.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 'EMTN' 2.125% 29-Mar-2034	238.970	0,02	
2.735.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 'EMTN' 2.125% 29-Mar-2034	2.240.799	0,22	
1.391.000	International Flavors & Fragrances Inc 1.800% 25-Sep-2026	1.270.096	0,13	
2.083.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 3.000% 15-Sep-2028	1.978.725	0,20	
3.503.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.389% 24-Feb-2028	3.003.684	0,30	
1.990.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.090% 11-Mar-2027	1.812.342	0,18	
500.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	435.835	0,04	
2.923.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.963% 23-Mar-2030	2.558.487	0,25	
1.300.000	McDonald's Corp 1.600% 15-Mar-2031	1.096.287	0,11	
1.270.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 07-Mar-2027	1.154.760	0,11	
3.390.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 15-Oct-2040	2.213.056	0,22	
3.020.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039	2.072.778	0,21	
800.000	Mondelez International Inc 0.250% 17-Mar-2028	666.920	0,07	
4.605.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 0.637% 26-Jul-2024	4.524.712	0,45	
5.326.000	Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	4.060.835	0,40	
6.562.000	Morgan Stanley FRN 2.950% 07-May-2032	5.846.611	0,58	
2.723.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 1.102% 29-Apr-2033	2.021.773	0,20	
4.935.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 5.148% 25-Jan-2034	5.152.683	0,51	
985.000	Nasdaq Inc 1.750% 28-Mar-2029	856.354	0,08	
2.700.000	Netflix Inc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2029	2.521.017	0,25	
1.290.000	PepsiCo Inc 0.750% 18-Mar-2027	1.163.276	0,12	
2.718.000	PepsiCo Inc 'EMTN' 0.500% 06-May-2028	2.345.790	0,23	
1.243.000	Prologis Euro Finance LLC 1.000% 06-Feb-2035	862.672	0,09	
1.476.000	Prologis Euro Finance LLC 'EMTN' 1.000% 08-Feb-2029	1.221.811	0,12	
2.307.000	Simon International Finance SCA 1.125% 19-Mar-2033	1.661.259	0,16	
1.100.000	Stellantis NV 2.750% 15-May-2026	1.054.513	0,10	
2.170.000	Stellantis NV 3.875% 05-Jan-2026	2.159.442	0,21	
781.000	Stellantis NV 'EMTN' 0.625% 30-Mar-2027	674.366	0,07	
3.576.000	Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033	2.526.390	0,25	
5.783.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041	3.886.321	0,39	
2.050.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032	1.834.350	0,18	
500.000	Thermo Fisher Scientific Inc 'EMTN' 1.875% 01-Oct-2049	320.616	0,03	
1.000.000	Verizon Communications Inc 1.125% 19-Sep-2035	700.886	0,07	
3.050.000	Verizon Communications Inc 1.850% 18-May-2040	2.147.460	0,21	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Vereinigte Staaten von Amerika Forts.				
1.855.000	Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038	1.564.455	0,16	
Gesamtanlagen in Anleihen		977.261.709	96,83	
Credit Default Swaps - 678.462				
(31. Dezember 2021: (1.295.007))				
2.145.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	159.043	0,01	
2.370.000	CDS Intesa Sanpaolo SpA 1.000% 20-Dec-2027	175.726	0,02	
50.700.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	4.320	0,00	
48.000.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Index Series 38 Version 1 1.000% 20-Dec-2027	4.090	0,00	
2.300.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	170.798	0,02	
2.215.000	CDS Unicredit SpA 1.000 20-Dec-2027	164.485	0,02	
Credit Default Swaps insgesamt		678.462	0,07	
Swaptions - 381.608				
(31. Dezember 2021: -)				
95.000.000	iTraxx Europe Series 38 Call 15-Feb-2023 0.900	381.608	0,04	
Swaptions insgesamt		381.608	0,04	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Offene Terminkontrakte - 3.176.525					
(31. Dezember 2021: 1.162.238)					
(393)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(52.477.290)	2.888.971	0,28	
(4)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(548.720)	94.381	0,01	
(18)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.995.211)	13.442	0,00	
(25)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.529.283)	239	0,00	
(22)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(2.472.571)	179.492	0,02	
Offene Terminkontrakte insgesamt			3.176.525	0,31	

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 508.510 (siehe unten) (31. Dezember 2021: 34.951)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **982.006.814** **97,30**

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Swaptions - (302.166)				
(31. Dezember 2021: -)				
(190.000.000)	iTraxx Europe Series 38 Call 15-Feb-2023 1.075	(302.166)	(0,03)	
Swaptions insgesamt		(302.166)	(0,03)	

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettovermögen %	Summe
Offene Terminkontrakte - (2.446.524)					
(31. Dezember 2021: (206.623))					
520	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2023	60.309.600	(1.960.398)	(0,19)	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte Forts.				
381	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2023	40.184.070	(486.126)	(0,05)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(2.446.524)	(0,24)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (68.756) (siehe unten) (31. Dezember 2021: (605.016))			(68.756)	(0,01)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(2.817.446)	(0,28)
Nettoumlaufvermögen			30.074.357	2,98
Summe Nettovermögen			1.009.263.725	100,00

Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Barclay Bank Plc, BNP Paribas and Goldman Sachs. Der Kontrahent für Swaptions ist Citigroup Global Markets Limited. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Morgan Stanley.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	96,25
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,31
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,15
Sonstiges Umlaufvermögen	3,29
Gesamtvermögen	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/Verlust
Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund							
Euro	US-Dollar	1.125.719	1.101.000	6. Jan. 23	Morgan Stanley		94.709
Euro	US-Dollar	3.191.332	3.174.000	6. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch		219.101
Euro	US-Dollar	1.390.898	1.451.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley		32.732
Euro	Pfund Sterling	7.760.154	6.784.000	20. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited		116.191
Euro	US-Dollar	1.860.869	1.941.000	25. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch		45.777
						EUR	508.510
US-Dollar	Euro	1.114.000	1.111.940	6. Jan. 23	Morgan Stanley		(68.756)
						EUR	(68.756)

RESPONSIBLE HORIZONS EURO IMPACT BOND FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen				
Österreich - 446.927				
100.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	98.190	0,38	
400.000	Raiffeisen Bank International AG FRN 1.375% 17-Jun-2033	285.900	1,11	
100.000	Verbund AG 0.900% 01-Apr-2041	62.837	0,24	
Belgien - 601.026				
200.000	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 0.250% 02-Dec-2030	151.150	0,58	
200.000	KBC Group NV 'EMTN' 3.000% 25-Aug-2030	184.578	0,71	
300.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN 0.375% 16-Jun-2027	265.298	1,03	
Dänemark - 214.477				
150.000	Orsted AS FRN 1.500% 18-Feb-3021	112.215	0,43	
100.000	Orsted AS FRN 5.250% 08-Dec-3022	102.262	0,40	
Finnland - 85.208				
100.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.625% 27-Jul-2027	85.208	0,33	
Frankreich - 5.182.022				
100.000	ALD SA 'EMTN' 4.000% 05-Jul-2027	100.342	0,39	
200.000	AXA SA 'EMTN' FRN 1.375% 07-Oct-2041	148.339	0,57	
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.000% 21-Nov-2029	401.838	1,55	
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024	193.070	0,75	
200.000	BPCE SA 0.125% 04-Dec-2024	188.497	0,73	
200.000	CNP Assurances FRN 2.000% 27-Jul-2050	162.784	0,63	
600.000	Credit Agricole SA 'EMTN' 0.125% 09-Dec-2027	497.175	1,92	
100.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 4.250% 01-Dec-2032	99.356	0,38	
100.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN 1.250% 11-Jun-2029	85.115	0,33	
100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	99.165	0,38	
100.000	Engie SA 'EMTN' 3.500% 27-Sep-2029	97.764	0,38	
600.000	Engie SA FRN (Perpetual) 1.500% 30-May-2028	476.826	1,84	
300.000	Faurecia SE 2.375% 15-Jun-2029	226.882	0,88	
200.000	Gecina SA 'EMTN' 0.875% 25-Jan-2033	146.749	0,57	
200.000	ICADE 1.000% 19-Jan-2030	146.848	0,57	
400.000	ICADE 1.500% 13-Sep-2027	345.762	1,34	
100.000	La Banque Postale SA 'EMTN' 0.750% 23-Jun-2031	74.444	0,29	
100.000	Orange SA 'EMTN' 2.375% 18-May-2032	90.364	0,35	
100.000	Sanofi 1.250% 06-Apr-2029	89.035	0,34	
300.000	Societe Fonciere Lyonnaise SA 1.500% 05-Jun-2027	261.786	1,01	
300.000	Societe Generale SA FRN 0.875% 22-Sep-2028	254.958	0,98	
100.000	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	84.408	0,33	
300.000	Suez SACA 'EMTN' 5.000% 03-Nov-2032	307.700	1,19	
500.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	425.022	1,64	
200.000	Veolia Environnement SA 'EMTN' 1.940% 07-Jan-2030	177.793	0,69	
Deutschland - 2.790.347				
100.000	Amprion GmbH 3.971% 22-Sep-2032	99.223	0,39	
800.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	649.157	2,51	
500.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	457.303	1,77	
100.000	Commerzbank AG FRN 3.000% 14-Sep-2027	93.315	0,36	
100.000	E.ON SE 'EMTN' 0.875% 18-Oct-2034	71.295	0,28	
127.000	E.ON SE 'EMTN' 0.875% 18-Oct-2034	90.545	0,35	
207.000	E.ON SE 'EMTN' 1.625% 29-Mar-2031	174.201	0,67	
200.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	158.069	0,61	
100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 3.279% 05-Sep-2031	96.384	0,37	
100.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 2.250% 25-Sep-2027	92.986	0,36	
400.000	LEG Immobilien SE 'EMTN' 0.750% 30-Jun-2031	282.402	1,09	
100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 1.250% 26-May-2041	75.014	0,29	
500.000	Vonovia SE 'EMTN' 0.625% 24-Mar-2031	351.682	1,36	

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Nettover- mögen %	Summe
Anleihen Forts.				
Deutschland Forts.				
100.000	Vonovia SE 'EMTN' 4.750% 23-May-2027	98.771	0,38	
Irland - 1.131.241				
450.000	AlB Group Plc 'EMTN' FRN 0.500% 17-Nov-2027	381.132	1,47	
150.000	AlB Group Plc 'EMTN' FRN 2.250% 04-Apr-2028	133.812	0,52	
450.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	386.386	1,49	
150.000	ESB Finance DAC 'EMTN' 1.125% 11-Jun-2030	124.393	0,48	
150.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.000% 22-Sep-2033	105.518	0,41	
Italien - 1.662.980				
300.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.429% 14-Jul-2031	244.191	0,94	
600.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 1.125% 18-Sep-2026	552.495	2,14	
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028	249.432	0,96	
300.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' 1.000% 08-Sep-2027	261.766	1,01	
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.750% 24-Jul-2032	74.167	0,29	
350.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	280.929	1,09	
Luxemburg - 110.440				
150.000	P3 Group Sartl 'EMTN' 1.625% 26-Jan-2029	110.440	0,43	
Niederlande - 2.727.318				
400.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	317.392	1,23	
350.000	Alliander NV 'EMTN' 0.375% 10-Jun-2030	278.518	1,08	
119.000	ASML Holding NV 2.250% 17-May-2032	107.895	0,42	
300.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0.375% 03-Mar-2028	242.601	0,94	
300.000	de Volksbank NV FRN 2.375% 04-May-2027	279.147	1,08	
400.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 0.875% 09-Jun-2032	337.652	1,30	
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2.125% 23-May-2026	95.375	0,37	
100.000	ING Groep NV FRN 4.125% 24-Aug-2033	94.232	0,36	
400.000	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 07-Sep-2026	342.972	1,32	
150.000	NN Group NV 'EMTN' FRN 5.250% 01-Mar-2043	139.292	0,54	
125.000	TenneT Holding BV 'EMTN' 4.750% 28-Oct-2042	133.914	0,52	
400.000	Vesteda Finance BV 'EMTN' 1.500% 24-May-2027	358.328	1,38	
Norwegen - 261.525				
300.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Jan-2028	261.525	1,01	
Portugal - 363.209				
300.000	EDP Finance BV 'EMTN' 1.875% 21-Sep-2029	264.397	1,03	
100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 3.875% 11-Mar-2030	98.812	0,38	
Spanien - 3.935.703				
400.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	336.820	1,30	
100.000	Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 5.250% 14-Sep-2028	98.956	0,38	
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	188.122	0,73	
100.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA FRN 8.000% 22-Sep-2026	100.685	0,39	
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 2.625% 24-Mar-2026	94.143	0,36	
100.000	Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.125% 10-Nov-2028	100.500	0,39	
300.000	Banco de Sabadell SA FRN 1.125% 11-Mar-2027	268.650	1,04	
300.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	246.750	0,95	
500.000	Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	422.332	1,63	
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.500% 09-Feb-2029	161.818	0,63	
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.625% 21-Jan-2028	173.634	0,67	
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031	171.036	0,66	
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN 5.375% 14-Nov-2030	204.938	0,79	
100.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 1.375% 11-Mar-2032	83.164	0,32	
300.000	Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Aug-2027	245.142	0,95	

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Bestände	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Anleihen Forts.			
Spanien Forts.			
400.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.825% 09-Aug-2029	306.075	1,18
300.000	Merlin Properties SociMI SA 'EMTN' 1.375% 01-Jun-2030	231.298	0,89
100.000	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 7.125% 23-Aug-2028	102.190	0,40
200.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 4.500% 30-Jun-2025	199.050	0,77
200.000	Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 7.250% 15-Nov-2027	200.400	0,78
Schweden - 280.349		280.349	1,08
100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4.000% 09-Nov-2026	100.591	0,39
200.000	Vattenfall AB 'EMTN' 0.500% 24-Jun-2026	179.758	0,69
Schweiz - 443.568		443.568	1,72
500.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.450% 19-May-2025	443.568	1,72
Vereinigtes Königreich - 1.273.403		1.273.403	4,92
550.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 1.500% 04-Dec-2024	540.823	2,09
300.000	Segro Capital Sarl 'EMTN' 1.250% 23-Mar-2026	273.647	1,06
300.000	SSE Plc 'EMTN' 1.375% 04-Sep-2027	270.426	1,04
100.000	SSE Plc 'EMTN' 2.875% 01-Aug-2029	93.559	0,36
100.000	Yorkshire Building Society FRN 3.511% 11-Oct-2030	94.948	0,37
Vereinigte Staaten von Amerika - 2.440.408		2.440.408	9,43
150.000	Amgen Inc 3.000% 22-Feb-2029	125.188	0,48
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 2.000% 01-Sep-2028	161.721	0,62
200.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	164.696	0,64
437.000	Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	427.847	1,65
100.000	Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.300% 10-Nov-2029	82.370	0,32
700.000	Digital Intrepid Holding BV 1.375% 18-Jul-2032	499.628	1,93
400.000	JPMorgan Chase & Co FRN 0.768% 09-Aug-2025	346.091	1,34
100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 15-Oct-2028	83.351	0,32
300.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0.875% 01-Oct-2031	237.438	0,92
200.000	Verizon Communications Inc 1.500% 18-Sep-2030	146.526	0,57
200.000	VF Corp 0.250 % 25-Feb-2028	165.552	0,64
Gesamtanlagen in Anleihen		23.950.151	92,58

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - 98.735				
(11)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(1.468.830)	89.240	0,34
(3)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(315.939)	1.381	0,01
(1)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2023	(112.390)	8.114	0,03
Offene Terminkontrakte insgesamt			98.735	0,38
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 54.623 (siehe unten)			54.623	0,21
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			24.103.509	93,17

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement EUR	Beizulegender Zeitwert EUR	Summe Nettover- mögen %
Offene Terminkontrakte - (37.543)				
5	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2023	579.900	(18.404)	(0,07)
15	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2023	1.582.050	(19.139)	(0,07)
Offene Terminkontrakte insgesamt			(37.543)	(0,14)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (1.276) (siehe unten)			(1.276)	(0,00)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt			(38.819)	(0,14)
Nettoumlaufvermögen			1.805.132	6,97
Summe Nettovermögen			25.869.822	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	92,01
An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,38
Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	0,21
Sonstiges Umlaufvermögen	7,40
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2022

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund						
Euro	US-Dollar	467.539	465.000	6. Jan. 23	Bank of America Merrill Lynch	32.099
Euro	US-Dollar	276.672	274.000	12. Jan. 23	Morgan Stanley	20.202
Euro	Pfund Sterling	154.425	135.000	20. Jan. 23	Citigroup Global Markets Limited	2.312
						EUR 54.613

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	50	44	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	53	47	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	117	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						EUR 2
						GBP 2
Pfund Sterling	Euro	8.923	10.396	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(339)
						EUR (339)
						GBP (301)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	50	44	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	53	47	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
Euro	Pfund Sterling	117	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						EUR 3
						GBP 3
Pfund Sterling	Euro	8.917	10.389	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(338)
						EUR (338)
						GBP (300)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)

Euro	Pfund Sterling	50	44	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	53	46	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	Pfund Sterling	117	102	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	2
						EUR 2
						GBP 2
Pfund Sterling	Euro	8.932	10.407	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(339)
						EUR (339)
						GBP (301)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	56	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	94	99	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
						EUR 1
						USD 1

Devisenterminkontrakte Forts.

Kauf	Verkauf	Betrag (K)	Betrag (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	8.980	8.491	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(87)
						EUR (87)
						USD (93)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	56	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	94	100	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
						EUR 1
						USD 1
US-Dollar	Euro	8.974	8.486	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(86)
						EUR (86)
						USD (92)

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund Anteilsklasse USD X (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	56	59	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	94	99	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	1
						EUR 1
						USD 1
US-Dollar	Euro	8.989	8.500	13. Jan. 23	The Bank of New York Mellon	(87)
						EUR (87)
						USD (93)

GESAMTERGEBNISRECHNUNG

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
	Hinweise	EUR	GBP	EUR
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		17.780	11.180	8.664
Dividenderträge		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 Geschäftsjahr geschlossenen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 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
	Hinweise	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 20 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 Future Earth Fund	BNY Mellon Future Food 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	183	719	487	106.946
-	-	36.815	129.841	38	29.416	45.970	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)	(109.864)	(30.326)	14.660	(9.438.120)
8.106.535	(2.995.418)	(1.706.969)	(22.368.806)	(4.897.838)	(379.427)	(371.514)	(274.847)	(57.419.783)
(14.851.735)	(4.097.497)	(26.261.168)	(38.891.287)	(7.634.543)	(459.692)	(355.151)	(225.034)	(66.726.732)
708.048	3.380	299.308	1.578.407	30.661	13.731	15.643	14.415	2.246.996
-	-	-	-	-	-	-	-	-
124.976	38.203	85.433	72.461	15.220	11.142	9.592	10.947	132.877
90.108	17.456	68.049	179.404	26.546	18.953	19.603	14.357	416.410
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	(48.329)	-	-	(27.791)	(26.053)	(22.623)	-
923.132	59.039	404.461	1.830.272	72.427	16.035	18.785	17.096	2.796.283
(15.774.867)	(4.156.536)	(26.665.629)	(40.721.559)	(7.706.970)	(475.727)	(373.936)	(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	10.694	12.874	12.645	1.310.184
(16.200.799)	(5.590.079)	(31.345.843)	(41.349.156)	(8.202.465)	(486.438)	(386.810)	(254.777)	(70.835.219)
149.774	(33.088)	(133.663)	(7.130)	(5.566)	(5.770)	(10.362)	(7.378)	(270)
(16.051.025)	(5.623.167)	(31.479.506)	(41.356.286)	(8.208.031)	(492.208)	(397.172)	(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*
	Hinweise	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)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Global Equity Fund**	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)
USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	GBP	USD
120.937	179.944	44.566	15.152	4.184	9.810	54.477	23.754	219.939
7.709.591	15.350.628	–	13.523.797	735.719	497.099	39.560.328	918.517	5.569.318
15.519	38.711	74.045	60.867	3.474	922	145.956	5.045	3.080
33.001.110	27.414.946	(11.607.539)	(15.836.481)	(1.324.025)	1.441.620	21.121.185	(504.658)	29.491.840
(137.799.722)	(49.532.296)	(10.561.057)	(30.539.445)	(14.024.929)	(9.546.537)	(358.154.624)	(4.973.903)	(69.544.393)
(96.952.565)	(6.548.067)	(22.049.985)	(32.776.110)	(14.605.577)	(7.597.086)	(297.272.678)	(4.531.245)	(34.260.216)
3.671.506	5.136.002	984.062	1.704.405	442.041	571.080	19.625.852	262.970	3.412.822
–	–	–	–	–	–	–	–	–
118.938	111.569	41.770	71.378	14.770	33.234	505.835	54.426	134.462
458.136	488.225	131.923	245.994	62.776	44.942	1.848.561	71.540	378.747
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	(33.652)	–	–	–	–	–
4.248.580	5.735.796	1.157.755	1.988.125	519.587	649.256	21.980.248	388.936	3.926.031
(101.201.145)	(12.283.863)	(23.207.740)	(34.764.235)	(15.125.164)	(8.246.342)	(319.252.926)	(4.920.181)	(38.186.247)
1.069	3.522	6.964	4.197	28	17	513.670	1.597	61.170
1.914.041	8.189.806	3.328.191	12.847.158	49.723	17	12.235.817	761.835	908.426
(103.116.255)	(20.477.191)	(26.542.895)	(47.615.590)	(15.174.915)	(8.246.376)	(332.002.413)	(5.683.613)	(39.155.843)
(1.325.990)	(2.975.617)	(25.880)	(1.449.323)	(129.372)	(85.363)	(3.500.955)	(88.032)	(537.474)
(104.442.245)	(23.452.808)	(26.568.775)	(49.064.913)	(15.304.287)	(8.331.739)	(335.503.368)	(5.771.645)	(39.693.317)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund
	Hinweise	USD	USD	JPY
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		48.504	16.616	604.624
Dividendenerträge		469.784	416.517	344.168.852
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	658.107	1.727	18.804.550
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		18.233.708	(619.122)	2.807.314.650
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(89.001.608)	(6.450.810)	(1.524.576.860)
Gesamtertrag		(69.591.505)	(6.635.072)	1.646.315.816
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	2.786.708	48	176.503.758
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	151.898	16.930	8.677.133
Betriebliche Aufwendungen	7	584.760	21.182	22.543.404
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(20.291)	(6.242)	–
Gesamtaufwendungen		3.503.075	31.918	207.724.295
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(73.094.580)	(6.666.990)	1.438.591.521
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		58.195	3	3.400.725
Ausschüttungen		32.090.809	445.296	36.287.483
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(105.243.584)	(7.112.289)	1.398.903.313
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		84.486	(54.792)	(51.625.328)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(105.159.098)	(7.167.081)	1.347.277.985

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

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 Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	USD
95.077	46.897	158	1.420	2.615	866	1.985	13.042	129.081
18.413.833	6.536.182	1.885.519	52.574	–	15.424	1.399.172	–	9.704.397
59.187	28.803	46.919	–	–	–	–	–	10.988
107.438.959	(32.571.142)	1.270.136	(2.107.629)	(11.765.702)	21.572	(4.706.225)	(5.728.379)	33.337.735
(332.346.437)	(291.510.168)	(12.852.215)	395.441	(9.378.328)	686.933	(9.043.436)	(5.148.088)	(27.866.347)
(206.339.381)	(317.469.428)	(9.649.483)	(1.658.194)	(21.141.415)	724.795	(12.348.504)	(10.863.425)	15.315.854
14.525.516	6.097.139	716.450	85.559	1.086.777	20.993	751.423	527.680	2.159.971
–	–	–	–	–	–	–	–	–
193.242	167.076	30.370	16.913	130.994	21.925	90.410	66.827	63.842
1.078.446	649.545	48.686	15.199	254.648	7.179	89.251	91.521	354.585
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(63.374)	–	(16.452)	(75.165)	(24.095)	(45.177)	–	–
15.797.204	6.850.386	795.506	101.219	1.397.254	26.002	885.907	686.028	2.578.398
(222.136.585)	(324.319.814)	(10.444.989)	(1.759.413)	(22.538.669)	698.793	(13.234.411)	(11.549.453)	12.737.456
7.879	15.543	5.496	3	128.780	–	25.488	11.666	7.978
951.728	137.460	151.033	–	7.248.159	–	557.952	1.246.684	6.917.008
(223.096.192)	(324.472.817)	(10.601.518)	(1.759.416)	(29.915.608)	698.793	(13.817.851)	(12.807.803)	5.812.470
(3.721.193)	(1.243.731)	(129.986)	(12.631)	10.991	(2.524)	(132.465)	(22.867)	(2.362.623)
(226.817.385)	(325.716.548)	(10.731.504)	(1.772.047)	(29.904.617)	696.269	(13.950.316)	(12.830.670)	3.449.847

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2022 [^]
	Hinweise	USD	EUR	EUR	USD
Erträge					
Erträge aus Bankzinsen		67.960	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		(38.079.093)	(18.123.982)	(791.704)	(250.095.106)
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(142.648.984)	(118.006.535)	(3.273.647)	(2.464.570.511)
Gesamtertrag		(180.660.117)	(136.126.422)	(4.065.301)	(2.559.528.313)
Aufwendungen					
Managementgebühr	3	3.665.103	3.165.201	39.453	94.932.927
Performancegebühr	3	–	–	–	24.214
Verwahrstellengebühr	5	111.534	151.068	15.945	4.703.958
Betriebliche Aufwendungen	7	938.149	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		4.714.786	4.023.483	63.078	119.768.302
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(185.374.903)	(140.149.905)	(4.128.379)	(2.679.296.615)
Finanzierungskosten					
Bankzinsen		7.135	144.116	4.310	1.546.908
Ausschüttungen		28.760.058	5.523.045	151.076	296.483.900
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(214.142.096)	(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		(214.142.096)	(145.935.914)	(4.287.253)	(2.999.419.990)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

[^] Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Samstag, 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.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund
	Hinweise	EUR	GBP	EUR
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		744	820	82
Dividendenerträge		25	4.035.104	462.550
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	53.881	4.421	7.171
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		12.496.627	(6.389.825)	3.436.424
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		8.096.683	4.693.219	1.476.619
Gesamtertrag		20.647.960	2.343.739	5.382.846
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	1.036.465	1.440.412	249.380
Performancegebühr	3	160	4.569	92.174
Verwahrstellengebühr	5	163.661	49.667	21.955
Betriebliche Aufwendungen	7	214.031	192.327	76.825
Dividendenaufwand		–	3.579.430	536.769
Finanzierungskosten für Swaps		47.969	683.552	978.654
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	(1.729)
Gesamtaufwendungen		1.462.286	5.949.957	1.954.028
Nettoerträge/(-aufwendungen)		19.185.674	(3.606.218)	3.428.818
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		264.189	3.883	24.163
Ausschüttungen		1.675.042	381.509	–
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		17.246.443	(3.991.610)	3.404.655
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(96.542)	(139.426)	(3.249)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		17.149.901	(4.131.036)	3.401.406

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.

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund ^c	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund ^a	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund ^{**}	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
338	580	65	10.952	–	61	2.358	1.004	25
755.561	556.713	253.412	3.963.629	–	2.227	6.767.494	–	–
10	672	292.675	–	–	168	24.015	6.798	182
4.008.339	11.258.202	2.006.670	2.004.602	(528.312)	144.181	64.340.044	(1.792.483)	2.355.013
(2.510.940)	(17.060.147)	(7.116.744)	(10.367.733)	300.243	(88.626)	78.747.912	(2.179.677)	(2.945.647)
2.253.308	(5.243.980)	(4.563.922)	(4.388.550)	(228.069)	58.011	149.881.823	(3.964.358)	(590.427)
170.485	1.243.097	568.046	835.772	15.975	9.260	1.828.453	193.685	14.631
–	–	–	–	–	–	–	–	–
51.937	105.042	23.228	43.897	1.927	3.862	134.738	74.784	32.169
27.970	110.988	64.366	62.184	6.781	3.757	514.651	162.630	42.696
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(60.224)	–	(23.900)	–	(3.704)	(8.335)	(176.064)	(106.619)	(57.406)
190.168	1.459.127	631.740	941.853	20.979	8.544	2.301.778	324.480	32.090
2.063.140	(6.703.107)	(5.195.662)	(5.330.403)	(249.048)	49.467	147.580.045	(4.288.838)	(622.517)
279	427	901	7.555	30	13	935	1.679	41
721.118	–	25.893	62.302	–	11.623	3.166.605	5.403.906	482.922
1.341.743	(6.703.534)	(5.222.456)	(5.400.260)	(249.078)	37.831	144.412.505	(9.694.423)	(1.105.480)
(79.531)	(225.264)	(104.620)	(2.640.898)	–	12.149	(1.919.294)	(21.849)	1.847
1.262.212	(6.928.798)	(5.327.076)	(8.041.158)	(249.078)	49.980	142.493.211	(9.716.272)	(1.103.633)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund
	Hinweise	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		1.912	1.008	683
Dividendenerträge		–	–	21.034
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	302.252	71.131	205.197
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		91.058.842	48.675.732	17.420.740
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(17.286.501)	(37.467.897)	(37.496.760)
Gesamtertrag		74.076.505	11.279.974	(19.849.106)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	605.458	788.812	2.647.176
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	225.026	109.037	88.283
Betriebliche Aufwendungen	7	1.067.660	678.270	424.981
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	(233.122)	(304.072)	–
Gesamtaufwendungen		1.665.022	1.272.047	3.160.440
Nettoerträge/(-aufwendungen)		72.411.483	10.007.927	(23.009.546)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		89	4.329	29.018
Ausschüttungen		65.132.871	38.272.262	12.183.016
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		7.278.523	(28.268.664)	(35.221.580)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(209.611)	32.534	(84.777)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		7.068.912	(28.236.130)	(35.306.357)

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

◀ Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Food Fund**	BNY Mellon Future Life Fund*
USD	USD	USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD
41	869	202	1.616	1.178	1	876	18	17
-	-	-	4.405	111.544	-	33.131	40.992	38.636
4.532	3.325	1.221	20.215	41.463	3.854	-	-	-
2.222.494	(4.836.747)	1.276.899	9.136.300	11.463.665	985.228	9.672	31.033	1.911
(2.720.210)	(8.024.218)	(2.549.506)	(20.163.922)	(20.660.147)	(802.918)	142.307	211.645	330.904
(493.143)	(12.856.771)	(1.271.184)	(11.001.386)	(9.042.297)	186.165	185.986	283.688	371.468
396.722	1.192.702	4.117	712.826	2.561.354	41.697	15.844	16.140	14.726
-	-	-	-	-	-	-	-	-
16.606	127.689	34.655	134.618	94.225	16.045	4.077	7.822	5.204
38.661	141.462	15.657	150.194	250.041	23.297	16.969	17.492	17.063
-	-	-	-	-	5	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	(51.673)	-	-	(18.419)	(22.126)	(19.529)
451.989	1.461.853	54.429	945.965	2.905.620	81.044	18.471	19.328	17.464
(945.132)	(14.318.624)	(1.325.613)	(11.947.351)	(11.947.917)	105.121	167.515	264.360	354.004
333	2.929	919	6.201	51.479	8.826	-	16	7
210.472	1.037.410	1.491.597	8.665.311	575.367	338.257	-	-	-
(1.155.937)	(15.358.963)	(2.818.129)	(20.618.863)	(12.574.763)	(241.962)	167.515	264.344	353.997
(487)	510.974	(16.752)	(287.853)	(51.756)	(4.080)	(5.433)	(9.299)	(8.486)
(1.156.424)	(14.847.989)	(2.834.881)	(20.906.716)	(12.626.519)	(246.042)	162.082	255.045	345.511

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund
	Hinweise	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		14.719	1.329	7.635
Dividendenerträge		433.467	19.409	570.697
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	122.766	116.623	40.845
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		13.296.553	46.165.194	10.638.462
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(53.056.310)	(45.723.538)	(26.222.538)
Gesamtertrag		(39.188.805)	579.017	(14.964.899)
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	2.997.683	162.936	2.738.081
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	154.067	156.214	165.649
Betriebliche Aufwendungen	7	531.384	365.393	478.072
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	9.780	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	(19.750)	–
Gesamtaufwendungen		3.683.134	674.573	3.381.802
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(42.871.939)	(95.556)	(18.346.701)
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		11.740	10.315	1.929
Ausschüttungen		1.407.358	16.671.356	5.106.977
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(44.291.037)	(16.777.227)	(23.455.607)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(137.114)	(20.770)	(24.523)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(44.428.151)	(16.797.997)	(23.480.130)

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

†† Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund ^c	BNY Mellon Global Equity Fund ^{cc}	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund ^{cc}	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)
USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	USD	EUR
593	4.237	7.417	4.873	1.309	57	37.331	390	1.499
558.347	7.925.249	21.734.782	–	11.287.863	493.952	126.866	659.034	48.493.424
371	12.175	82.525	33.846	67.785	775	58	1.134	143.577
10.216.313	46.520.818	122.376.150	13.640.540	9.152.146	1.255.585	887.555	4.604.624	91.975.060
(14.720.450)	29.915.266	(53.700.848)	(8.575.049)	9.457.103	7.982.863	475	2.017.334	109.893.452
(3.944.826)	84.377.745	90.500.026	5.104.210	29.966.206	9.733.232	1.052.285	7.282.516	250.507.012
692.686	4.345.716	6.948.912	1.117.233	1.385.266	414.143	27.894	732.160	23.087.274
–	–	–	–	–	–	–	–	–
111.444	129.642	143.044	66.115	53.365	16.352	11.565	24.528	627.464
116.798	513.999	655.316	156.955	235.288	57.832	20.407	45.435	2.038.558
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(40.077)	–	–	–	(31.758)	(1.592)	(19.893)	–	–
880.851	4.989.357	7.747.272	1.340.303	1.642.161	486.735	39.973	802.123	25.753.296
(4.825.677)	79.388.388	82.752.754	3.763.907	28.324.045	9.246.497	1.012.312	6.480.393	224.753.716
1.327	1.568	1.396	8.953	2.333	–	1.329	75	659.135
–	1.923.451	15.506.737	3.302.797	8.651.742	80.789	199.273	25	13.783.430
(4.827.004)	77.463.369	67.244.621	452.157	19.669.970	9.165.708	811.710	6.480.293	210.311.151
65.845	(1.307.125)	(3.936.965)	(20.785)	(2.244.278)	(96.985)	2.203	(98.256)	(4.952.902)
(4.761.159)	76.156.244	63.307.656	431.372	17.425.692	9.068.723	813.913	6.382.037	205.358.249

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
	Hinweise	GBP	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		165	10.084	3.374
Dividendenerträge		965.560	5.580.902	40.952
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	1.210	7.164	327.424
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		3.559.131	13.328.541	45.153.011
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		329.565	10.192.140	(23.679.740)
Gesamtertrag		4.855.631	29.118.831	21.845.021
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	261.204	3.211.828	3.009.070
Performancegebühr	3	–	–	–
Verwahrstellengebühr	5	57.354	134.497	137.111
Betriebliche Aufwendungen	7	52.778	365.026	695.756
Dividendenaufwand		–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	(41.692)
Gesamtaufwendungen		371.336	3.711.351	3.800.245
Nettoerträge/(-aufwendungen)		4.484.295	25.407.480	18.044.776
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		80	2.103	13.190
Ausschüttungen		787.639	1.229.738	33.824.941
Gewinn/(Verlust) im Berichtszeitraum		3.696.576	24.175.639	(15.793.355)
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(92.994)	(553.838)	(89.144)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.603.582	23.621.801	(15.882.499)

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker**	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)
USD	JPY	EUR	USD	USD	EUR	USD	EUR	EUR
670	11.216	2.793	1.734	36	181	9	81	2
428.841	256.778.554	19.518.216	5.237.693	24.171	1.952.115	15.189	-	866.355
1.738	13.123.162	64.771	261.471	52	24.625	-	-	-
1.215.515	1.566.639.963	206.902.326	23.461.452	15.228.968	9.363.098	224.527	(1.865.156)	(913.707)
1.015.376	1.040.431.984	167.357.917	77.933.487	(14.876.015)	3.787.892	(218.916)	2.606.111	4.936.401
2.662.140	2.876.984.879	393.846.023	106.895.837	377.212	15.127.911	20.809	741.036	4.889.051
53	158.018.029	15.903.576	7.410.977	10.826	906.702	37.924	921.253	401.374
-	-	-	-	-	-	-	-	-
19.183	6.266.665	243.541	186.943	8.593	20.015	4.392	108.810	76.488
21.023	21.004.923	1.091.227	874.878	9.747	65.193	14.946	227.824	58.647
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
(3.000)	-	-	(64.395)	(8.925)	-	(13.183)	(77.364)	(48.591)
37.259	185.289.617	17.238.344	8.408.403	20.241	991.910	44.079	1.180.523	487.918
2.624.881	2.691.695.262	376.607.679	98.487.434	356.971	14.136.001	(23.270)	(439.487)	4.401.133
9	1.822.265	9.400	32.046	351	9.504	2	82.971	16.687
365.925	55.806.239	2.317.436	193.544	-	49.601	-	4.765.767	282.715
2.258.947	2.634.066.758	374.280.843	98.261.844	356.620	14.076.896	(23.272)	(5.288.225)	4.101.731
(63.930)	(38.516.786)	(4.434.218)	(1.084.151)	(2.140)	(242.690)	(4.665)	(49.737)	(97.679)
2.195.017	2.595.549.972	369.846.625	97.177.693	354.480	13.834.206	(27.937)	(5.337.962)	4.004.052

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund**	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
	Hinweise	USD	USD	USD
Erträge				
Erträge aus Bankzinsen		473	89	490
Dividendenerträge		-	11.292	7.135.925
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	14	-	4	19.001
Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		5.205.669	908.221	40.483.966
Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten		(6.236.512)	(560.743)	21.766.096
Gesamtertrag		(1.030.370)	358.863	69.405.478
Aufwendungen				
Managementgebühr	3	633.996	12.982	1.416.263
Performancegebühr	3	-	-	-
Verwahrstellengebühr	5	35.881	11.709	56.981
Betriebliche Aufwendungen	7	95.180	10.673	273.644
Dividendenaufwand		-	-	-
Finanzierungskosten für Swaps		-	-	-
Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft	6	-	(18.127)	-
Gesamtaufwendungen		765.057	17.237	1.746.888
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(1.795.427)	341.626	67.658.590
Finanzierungskosten				
Bankzinsen		843	57	9.876
Ausschüttungen		626.274	-	5.115.342
Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr		(2.422.544)	341.569	62.533.372
Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge		(14.822)	(374)	(1.732.547)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(2.437.366)	341.195	60.800.825

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Freitag, 31. Dezember 2021 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021^
USD	EUR	USD
1.716	1	137.217
-	-	168.392.043
-	-	2.556.661
(10.240.833)	4.197.924	1.070.604.408
(7.572.511)	(5.469.039)	152.470.151
(17.811.628)	(1.271.114)	1.394.160.480
3.832.087	2.414.349	112.390.536
-	-	115.463
102.257	108.272	4.911.071
949.683	617.148	16.097.435
-	-	5.557.602
-	-	2.163.809
-	(79.105)	(1.595.729)
4.884.027	3.060.664	139.640.187
(22.695.655)	(4.331.778)	1.254.520.293
11.599	82.995	1.619.008
22.040.535	1.174.328	199.326.949
(44.747.789)	(5.589.101)	1.053.574.336
-	(135.769)	(28.996.544)
(44.747.789)	(5.724.870)	1.024.577.792

BILANZ

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
	Hinweise	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

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied – **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied – **Claire Cawley**

Datum: 13. April 2023

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
	Hinweise	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 20 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 Future Earth Fund	BNY Mellon Future Food 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	1.649.016	1.868.610	2.038.664	406.964.536	377.451.862	330.888.479
2.653.157	6.174.319	1.154.877	26.412	51.315	60.454	3.878.191	2.930.230	13.575.817
697.715	1.117.889	389.942	373	1.647	408	2.206.124	3.815.016	2.482.085
-	-	300.492	-	-	-	-	-	142.888
14.802	-	-	9.152	7.716	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	1.684.953	1.929.288	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	1.426	2.304	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	1.530	2.304	1.716	14.573.246	10.137.524	8.891.509
38.253.080	176.583.489	43.864.621	1.683.423	1.926.984	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 Fund**	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
	Hinweise	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	34.357.449	381.796.179	523.119.354	107.065.049
Barmittel und Bargegenwerte	9	1.020.519	11.078.943	12.442.400	3.235.084
Forderungen aus Erträgen		13.890	812.270	1.521.636	1.681.377
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	26.129	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	1.150.000	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		–	21.997	213.958	–
Sonstige Forderungen		–	12.980	–	–
		35.417.987	394.872.369	537.297.348	111.981.510
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	258	1.198.028	5.309	565.872
Banküberziehung	9	–	132.226	5.660	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	700.883
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		3.921	438	812.275	715.121
Zahlbare Aufwendungen		67.814	456.538	740.414	116.391
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	1.787.230	1.563.658	2.098.267
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		35.345.994	393.085.139	535.733.690	109.883.243

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2022 (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	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund
USD	USD	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD	JPY
121.467.336	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
841.807	673.800	823.586	64.974.947	2.792.729	13.357.037	2.923.857	1.064.323	654.459.875
195.938	18.270	26.442	4.779.433	105.450	820.650	7.502.545	76.921	48.711.460
34.862	-	-	-	-	-	-	-	-
17.119	-	-	-	-	-	4.304	-	-
-	-	-	56.009.210	1.227.269	24.222.460	23.110.000	-	-
-	-	-	16.390.000	440.000	-	70.000	-	-
1.100	4.388	-	1.605.096	14.412	27.962	365.489	-	-
-	-	148	15.924	435	5.581	8.346	1.396	18.380
122.558.162	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
55.727	989	307	25.537.987	1.104.910	21.200.062	28.018.215	132.984	205.976.575
-	-	-	3.130.555	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
83.700	163	5.085	3.000.789	13.917	2.481.664	599.277	-	46.061.021
158.209	51.971	64.602	1.882.054	49.884	378.864	368.851	6.344	22.406.460
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	16.390.000	440.000	-	70.000	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
297.636	53.123	69.994	49.941.385	1.608.711	24.060.590	29.056.343	139.328	274.444.056
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	23.358.895.122

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

		BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund
	Hinweise	EUR	USD	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	1.131.361.934	449.093.609	42.809.530	22.925.745
Barmittel und Bargegenwerte	9	20.805.057	14.157.081	495.787	297.758
Forderungen aus Erträgen		376.864	150.366	–	714
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	24.653	–	17.829
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		1.246.537	1.600.294	23.759	–
Sonstige Forderungen		7.829	–	–	15
		1.153.798.221	465.026.003	43.329.076	23.242.061
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	163.798	309.404	–	1.754
Banküberziehung	9	53	–	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		452.202	819.527	71.564	–
Zahlbare Aufwendungen		1.357.776	605.116	70.372	33.622
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–
		1.973.829	1.734.047	141.936	35.376
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		1.151.824.392	463.291.956	43.187.140	23.206.685

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Samstag, 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.

Zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets 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	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2022*
EUR	USD	EUR	USD	USD	USD	EUR	EUR	USD
320.462.627	10.327.873	83.243.353	80.292.439	341.445.956	855.518.148	982.006.814	24.103.509	14.651.364.763
12.983.643	368.260	3.775.350	648.777	14.600.690	25.146.277	17.600.086	1.616.998	371.484.864
2.485.032	4.239	225.191	941.816	782.252	10.393.396	8.671.630	156.340	106.740.168
133.834	-	-	-	3.155.725	-	-	-	4.804.016
33.067	24.096	22.848	-	-	-	68.439	-	790.228
272.481	-	1.818.157	2.311.282	-	-	1.325.513	152.377	183.972.033
12.830.000	-	-	50.000	-	-	760.000	-	47.402.064
18.790	-	72.058	-	264.197	273.473	4.931.382	-	56.076.862
3.224	198	-	-	-	68	-	-	8.157.828
349.222.698	10.724.666	89.156.957	84.244.314	360.248.820	891.331.362	1.015.363.864	26.029.224	15.430.792.826
2.570.305	1.240	959.287	2.659.675	326.608	104.789	2.817.446	38.819	177.773.045
1	-	127.998	1.173.514	-	-	-	-	6.465.127
-	-	-	-	2.880.867	-	-	-	50.957.077
234.430	-	7.035	-	1.212	277.460	1.144.902	-	16.144.607
185.221	30.407	105.067	80.339	322.601	570.952	506.015	19.290	12.272.198
-	-	-	-	-	-	-	-	20.072
212.339	-	-	6	-	-	838.858	83.864	3.315.747
12.830.000	-	-	50.000	-	-	760.000	-	47.402.064
-	-	-	8.410	-	-	32.918	-	254.038
-	-	-	-	-	-	-	-	161.969
-	4	-	-	-	-	-	-	804.934
-	-	-	-	-	-	-	17.429	18.657
16.032.296	31.651	1.199.387	3.971.944	3.531.288	953.201	6.100.139	159.402	315.589.535
333.190.402	10.693.015	87.957.570	80.272.370	356.717.532	890.378.161	1.009.263.725	25.869.822	15.115.203.291

Zum 31. Dezember 2021

		BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund
	Hinweise	EUR	GBP	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	393.892.842	127.934.704	105.690.359	14.651.276
Barmittel und Bargegenwerte	9	28.685.756	735.906	1.156.742	322.520
Forderungen aus Erträgen		1.939.741	102.985	234.973	28.376
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	448.507	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	37	3.596
Margen auf Derivatkontrakte	9	24.088.305	1.714.385	1.060.741	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	2.530.000	770.000	–
Forderungen aus Zeichnungen		9.247	36.472	80.101	–
Sonstige Forderungen		126	74	1.096	1.100
		448.616.017	133.054.526	109.442.556	15.006.868
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	21.587.074	6.230.259	12.168.583	1
Banküberziehung	9	247.049	–	–	327
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		2.179.664	–	439.174	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		100.642	318.666	–	–
Zahlbare Aufwendungen		184.320	216.901	60.658	26.794
Zahlbare Performancegebühren	3	–	1.516	90.533	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.329.865	26.275	705.341	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	2.530.000	770.000	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		154.174	5.832	10.423	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	19.206	49.680	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		27.782.788	9.348.655	14.294.392	27.122
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		420.833.229	123.705.871	95.148.164	14.979.746

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigegeführten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Asian Opportunities Fund ⁶	BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund [*]	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund ^{**}	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
58.137.558	93.027.940	42.075.648	22.671.147	–	610.316.339	187.835.232	20.164.373	1.885.955.846
1.144.551	1.192.077	3.756.949	2.368.625	–	40.040.201	511.757	218.419	11.424.672
35.469	3.587	167.102	13.635	–	231.495	2.714.359	183.522	24.916.282
–	–	–	1.649	–	–	186.739	–	–
–	3.677	–	2.616	2.533	7.777	7.668	2.168	24.234
–	–	–	924.226	–	4.903.000	536.577	208.819	2.872.146
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1.359.758	4.508	–	–	5.969	99.192	–	99.557
7.836	356	–	–	–	28	3.021	2.589	–
59.325.414	95.587.395	46.004.207	25.981.898	2.533	655.504.809	191.894.545	20.779.890	1.925.292.737
61	51.332	1.787	308.461	–	37	363.707	60.949	3.192.954
47.055	–	–	189	–	–	–	–	–
–	–	2.255.055	–	–	–	–	–	–
17.201	281.236	503	–	–	6.185.614	46.268	–	415.080
124.766	129.474	89.296	19.149	2.533	307.090	80.450	22.835	376.531
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	903.094	–	3.087.954	102.127	4.801	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	3.333	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
311.766	–	1.041.327	–	–	–	–	–	–
500.849	462.042	3.387.968	1.230.893	2.533	9.580.695	595.885	88.585	3.984.565
58.824.565	95.125.353	42.616.239	24.751.005	–	645.924.114	191.298.660	20.691.305	1.921.308.172

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund
	Hinweise	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	713.955.886	532.273.406	31.948.791	104.106.567
Barmittel und Bargegenwerte	9	4.125.462	11.409.759	1.097.087	9.004.966
Forderungen aus Erträgen		10.005.235	5.928.307	427.361	1.643.154
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	1.975.192	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	5.736	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.485.548	1.059.157	182.622	258.000
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	272.000
Forderungen aus Zeichnungen		2.795.127	2.452.299	–	–
Sonstige Forderungen		4	3.444	–	244
		734.372.998	555.101.564	33.655.861	115.284.931
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	4.088.433	339.690	45.551	481.453
Banküberziehung	9	–	4	–	118.027
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	673.755
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		8.258	110.094	396.910	21.353
Zahlbare Aufwendungen		287.830	382.252	47.433	158.613
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	3.376.774	–	31.067	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	272.000
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	3.333	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		7.761.295	835.373	520.961	1.725.201
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		726.611.703	554.266.191	33.134.900	113.559.730

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

« Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Food Fund**	BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund
USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
26.631.365	121.210.735	270.100.214	39.597.242	2.098.963	2.697.272	2.298.463	428.178.417	440.596.139
1.028.474	2.766.010	4.325.469	1.036.134	70.717	78.202	60.233	6.370.439	3.640.662
403.532	2.064.756	1.661.913	251.041	3.480	2.254	1.649	1.916.459	2.867.087
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2.722	-	-	-	-	-	-	10.059
30.257	275.214	4.982.507	630.660	-	-	-	503.154	12.238.567
-	49.000	-	-	-	-	-	2.010.000	-
-	387	27.979	-	-	-	-	311.237	34.426
-	-	-	-	4.908	4.908	4.908	-	5.068
28.093.628	126.368.824	281.098.082	41.515.077	2.178.068	2.782.636	2.365.253	439.289.706	459.392.008
83.230	494.268	529.333	148.079	58	-	-	1.982.261	13.014.291
-	191	-	-	-	-	-	754	-
114.412	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	337.131	-	-	-	-	246.401	-
7.271	118.276	292.647	12.996	13.073	15.811	13.677	367.929	68.864
-	-	-	-	-	-	-	-	-
5.427	28.331	4.016.798	614.360	-	-	-	-	3.281.263
-	49.000	-	-	-	-	-	2.010.000	-
-	1.433	-	1.433	-	-	-	-	65.636
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
210.340	691.499	5.175.909	776.868	13.131	15.811	13.677	4.607.345	16.430.054
27.883.288	125.677.325	275.922.173	40.738.209	2.164.937	2.766.825	2.351.576	434.682.361	442.961.954

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund [€]	BNY Mellon Global Equity Fund [«]	BNY Mellon Global Equity Income Fund
	Hinweise	USD	USD	USD	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	399.598.642	52.485.901	497.379.699	405.886.585
Barmittel und Bargegenwerte	9	19.333.211	777.483	8.581.716	5.698.454
Forderungen aus Erträgen		3.052.129	26.962	384.117	618.388
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	33	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	150.834	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		3.520.000	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		13.100.376	94	20.067	103.220
Sonstige Forderungen		–	10.245	12.931	4
		438.755.192	53.300.718	506.378.530	412.306.651
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	1.874.889	255	92	2.591
Banküberziehung	9	1	3.579	–	544.528
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		3.167	765	59.982	686
Zahlbare Aufwendungen		349.032	71.389	546.300	657.547
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	14.610	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		3.520.000	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	185.048	–	–
		5.761.699	261.036	606.374	1.205.352
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		432.993.493	53.039.682	505.772.156	411.101.299

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

€ Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

« Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund**	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
USD	USD	USD	EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD
159.239.036	225.297.045	64.500.496	–	36.532.593	2.731.136.840	58.915.307	388.463.134	786.181.855
5.521.790	3.481.228	898.708	13.372	754.531	397.401.682	6.793.574	50.536.285	4.463.781
2.194.358	282.252	24.262	–	26.944	3.398.526	65.148	520.536	9.656.627
792.770	–	–	–	–	321.087	7.059	38.565	–
–	3.022	–	–	–	–	–	–	1.544
–	–	–	–	–	50.734.594	591.125	1.513.097	–
–	–	–	–	–	–	–	2.480.000	4.849.000
485.859	6.720	358	–	–	9.182.878	186.336	277.193	1.991.211
–	863	–	–	–	–	–	–	1.854
168.233.813	229.071.130	65.423.824	13.372	37.314.068	3.192.175.607	66.558.549	443.828.810	807.145.872
163.678	48.500	562	–	51	64.988.397	604.245	3.222.671	1.769.339
–	–	–	–	–	10	1	–	–
1.221.723	–	–	–	–	–	–	–	6.810.903
–	1.120.125	913	–	34.743	2.700.685	4.171	62.267	707.083
154.717	194.921	65.289	13.372	80.824	2.757.756	53.087	454.537	436.175
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	2.480.000	4.849.000
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.540.118	1.363.546	66.764	13.372	115.618	70.446.848	661.504	6.219.475	14.572.500
166.693.695	227.707.584	65.357.060	–	37.198.450	3.121.728.759	65.897.045	437.609.335	792.573.372

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund
	Hinweise	USD	JPY	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	16	29.758.111	20.658.426.875	1.573.372.355	972.973.754
Barmittel und Bargegenwerte	9	2.876.300	454.635.335	28.024.349	17.619.432
Forderungen aus Erträgen		57.974	28.310.100	394.845	142.720
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	22.189.490	–	–
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	–	–	3.082
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen		–	780.552	1.919.404	5.958.748
Sonstige Forderungen		–	299.290	10.333	–
		32.692.385	21.164.641.642	1.603.721.286	996.697.736
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16	136.007	10.069.632	76.616	284.872
Banküberziehung	9	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	31.716.481	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		–	–	1.061.725	1.782.085
Zahlbare Aufwendungen		5.277	20.287.178	1.798.898	1.020.690
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	–	–
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	–	–	–
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	–	–
Zahlbare Steuern	10	–	–	–	–
		141.284	62.073.291	2.937.239	3.087.647
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		32.551.101	21.102.568.351	1.600.784.047	993.610.089

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon S&P 500® Index Tracker**	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund**	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund
USD	EUR	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD
–	79.875.733	4.963.590	305.053.387	65.642.151	93.339.646	–	284.821.136
49.241	1.485.511	22.726	22.038.050	13.218.317	4.603.483	10.286	12.723.129
–	–	58	2.530.636	67.472	528.594	–	458.641
–	–	–	–	12.153	–	–	–
–	–	–	3.606	75	–	–	–
–	–	–	3.234.182	660.451	1.129.078	–	–
–	–	–	430.000	–	–	–	–
–	61.627	–	160.512	356.409	–	–	85
–	87	5.127	5.478	1.272	1.368	–	–
49.241	81.422.958	4.991.501	333.455.851	79.958.300	99.602.169	10.286	298.002.991
–	–	656	4.219.461	1.478.334	284.878	–	1.338
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	7.209.299	–	–
36.082	123.828	–	9.722	–	–	–	619
13.159	106.255	14.295	161.814	83.163	83.654	10.286	248.565
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	12.011	–	501.225	–	–
–	–	–	430.000	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
49.241	230.083	14.951	4.833.008	1.561.497	8.079.056	10.286	250.522
–	81.192.875	4.976.550	328.622.843	78.396.803	91.523.113	–	297.752.469

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

		BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021 [^]
	Hinweise	USD	EUR	USD
Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
	16	993.362.920	950.668.738	18.537.427.725
Barmittel und Bargegenwerte	9	5.645.506	27180.236	855.591.361
Forderungen aus Erträgen		8.717.971	6.012.461	99.499.032
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	4.087.391
Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft)	6	–	7.836	93.622
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	2.078.380	132.975.391
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	17.970.685
Forderungen aus Zeichnungen		1.530.197	1.406.858	45.978.876
Sonstige Forderungen		318	–	94.765
		1.009.256.912	987.354.509	19.693.718.848
Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres)				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
	16	29.655	2.106.646	163.830.966
Banküberziehung	9	–	–	995.933
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	21.542.420
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		1.525.357	377.670	18.863.705
Zahlbare Aufwendungen		619.176	489.448	15.014.563
Zahlbare Performancegebühren	3	–	–	105.124
Margen auf Derivatkontrakte	9	–	128.275	21.398.617
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	17.970.685
Auf Swaps zu zahlende Erträge		–	16.666	289.628
Finanzierungskosten für Swaps		–	–	82.557
Zahlbare Steuern	10	–	–	1.538.141
		2.174.188	3.118.705	261.632.339
Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen		1.007.082.724	984.235.804	19.432.086.509

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

[^] Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Freitag, 31. Dezember 2021 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

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 Future Earth Fund	BNY Mellon Future Food 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 –	2.164.937 –	2.766.825 –	2.351.576 –	434.682.361 –	442.961.954 –	432.993.493 –
(41.356.286)	(8.208.031)	(492.208)	(397.172)	(262.155)	(70.835.489)	(86.914.750)	(46.382.410)
20.311.347	22.688.502	10.694	17.846	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	10.694	(442.669)	12.645	44.508.641	28.701.973	(41.610.021)
176.583.489	43.864.621	1.683.423	1.926.984	2.102.066	408.355.513	384.749.177	345.001.062

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Forts.)

	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	BNY Mellon Global Equity Fund**	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	53.039.682	505.772.156	411.101.299	166.693.695	227.707.584
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(12.692.790)	(104.442.245)	(23.452.808)	(26.568.775)	(49.064.913)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbarer, partizipierenden Anteilen	12.880.573	172.174.830	271.192.841	14.962.528	105.578.611
Kosten aus zurückgenommenen einlösbarer, partizipierenden Anteilen	(17.881.471)	(180.419.602)	(123.107.642)	(45.204.205)	(161.960.756)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(5.000.898)	(8.244.772)	148.085.199	(30.241.677)	(56.382.145)
Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	35.345.994	393.085.139	535.733.690	109.883.243	122.260.526
	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
	EUR	USD	EUR	USD	EUR
Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	1.600.784.047	993.610.089	81.192.875	4.976.550	328.622.843
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(226.817.385)	(325.716.548)	(10.731.504)	(1.772.047)	(29.904.617)
Erlöse aus ausgegebenen einlösbarer, partizipierenden Anteilen	198.563.838	135.766.447	12.650.466	20.005.144	76.476.638
Kosten aus zurückgenommenen einlösbarer, partizipierenden Anteilen	(420.706.108)	(340.368.032)	(39.924.697)	(2.962)	(42.004.462)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(222.142.270)	(204.601.585)	(27.274.231)	20.002.182	34.472.176
Inhabern von einlösbarer, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	1.151.824.392	463.291.956	43.187.140	23.206.685	333.190.402

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Samstag, 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.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr 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
USD	USD	EUR	GBP	USD	USD	USD	JPY
65.357.060	37.198.450	3.121.728.759	65.897.045	437.609.335	792.573.372	32.551.101	21.102.568.351
-	-	-	-	-	-	-	-
(15.304.287)	(8.331.739)	(335.503.368)	(5.771.645)	(39.693.317)	(105.159.098)	(7.167.081)	1.347.277.985
15.663.966	13.417.142	331.953.430	16.575.847	87.848.231	206.433.680	445.296	6.807.697.021
(19.219.302)	(15.175.639)	(1.012.995.707)	(16.352.698)	(139.226.633)	(358.566.694)	-	(5.898.648.235)
(3.555.336)	(1.758.497)	(681.042.277)	223.149	(51.378.402)	(152.133.014)	445.296	909.048.786
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
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets 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	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2022*
USD	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)
696.269	(13.950.316)	(12.830.670)	3.449.847	(214.142.096)	(145.935.914)	(4.287.253)	(2.999.419.990)
9.996.746	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)
9.996.746	23.511.083	1.579.927	55.515.216	97.437.533	170.963.835	30.157.075	(764.544.787)
10.693.015	87.957.570	80.272.370	356.717.532	890.378.161	1.009.263.725	25.869.822	15.115.203.291

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

	BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Asian Opportunities Fund [€]
	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	420.597.176	241.339.578	33.223.020	36.440.997	66.360.687
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	17.149.901	(4.131.036)	3.401.406	1.262.212	(6.928.798)
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	53.636.457	16.156.714	104.038.240	12.339.657	31.363.694
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(70.550.305)	(129.659.385)	(45.514.502)	(35.063.120)	(31.971.018)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(16.913.848)	(113.502.671)	58.523.738	(22.723.463)	(607.324)
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	420.833.229	123.705.871	95.148.164	14.979.746	58.824.565
	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 einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	770.676.813	392.457.935	39.274.388	164.668.641	28.263.991
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(28.236.130)	(35.306.357)	(1.156.424)	(14.847.989)	(2.834.881)
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	702.548.910	324.285.728	3.840.724	10.329.323	7.284.178
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(718.377.890)	(127.171.115)	(8.823.788)	(46.590.245)	(4.830.000)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(15.828.980)	197.114.613	(4.983.064)	(36.260.922)	2.454.178
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	726.611.703	554.266.191	33.134.900	113.559.730	27.883.288

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

†† Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund**	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
15.864.824	70.198.270	–	16.366.070	536.212.842	26.335.612	44.168.089	1.203.350.910
–	–	–	–	–	–	–	–
(5.327.076)	(8.041.158)	(249.078)	49.980	142.493.211	(9.716.272)	(1.103.633)	7.068.912
124.365.027	28.489.209	25.000.083	11.623	157.194.251	237.848.407	499.778	1.200.824.241
(39.777.422)	(48.030.082)	–	(16.427.673)	(189.976.190)	(63.169.087)	(22.872.929)	(489.935.891)
84.587.605	(19.540.873)	25.000.083	(16.416.050)	(32.781.939)	174.679.320	(22.373.151)	710.888.350
95.125.353	42.616.239	24.751.005	–	645.924.114	191.298.660	20.691.305	1.921.308.172
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Future Earth Fund*	BNY Mellon Future Food Fund**	BNY Mellon Future Life Fund*	BNY Mellon Global Bond Fund	BNY Mellon Global Credit Fund
USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD
165.595.940	442.908.116	40.498.739	–	–	–	614.883.298	803.381.804
–	–	–	–	–	–	–	–
(20.906.716)	(12.626.519)	(246.042)	162.082	255.045	345.511	(44.428.151)	(16.797.997)
7.999.341	53.048.478	8.060.287	2.002.855	2.782.025	2.006.065	192.935.665	125.216.450
(27.011.240)	(207.407.902)	(7.574.775)	–	(270.245)	–	(328.708.451)	(468.838.303)
(19.011.899)	(154.359.424)	485.512	2.002.855	2.511.780	2.006.065	(135.772.786)	(343.621.853)
125.677.325	275.922.173	40.738.209	2.164.937	2.766.825	2.351.576	434.682.361	442.961.954

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund [†]	BNY Mellon Global Equity Fund ^{††}	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	498.134.113	54.195.828	439.208.591	769.230.682	153.424.293
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(23.480.130)	(4.761.159)	76.156.244	63.307.656	431.372
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	102.301.016	63.086.911	170.891.213	124.222.479	42.864.484
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	(143.961.506)	(59.481.898)	(180.483.892)	(545.659.518)	(30.026.454)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	(41.660.490)	3.605.013	(9.592.679)	(421.437.039)	12.838.030
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	432.993.493	53.039.682	505.772.156	411.101.299	166.693.695
	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker**
	USD	JPY	EUR	USD	USD
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	29.990.159	15.317.409.324	1.571.112.825	474.197.314	36.865.576
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	2.195.017	2.595.549.972	369.846.625	97.177.693	354.480
Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	365.925	11.283.742.500	553.161.861	692.923.660	91.060
Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen	–	(8.094.133.445)	(893.337.264)	(270.688.578)	(37.311.116)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	365.925	3.189.609.055	(340.175.403)	422.235.082	(37.220.056)
Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	32.551.101	21.102.568.351	1.600.784.047	993.610.089	–

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

†† Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund
USD	USD	EUR	USD	EUR	GBP	USD	USD
146.439.027	39.090.903	20.744.725	35.977.689	2.926.880.946	62.762.505	300.822.877	701.716.479
–	–	–	–	–	–	–	–
17.425.692	9.068.723	813.913	6.382.037	205.358.249	3.603.582	23.621.801	(15.882.499)
131.963.408	28.318.194	247.309	11.027.018	1.076.774.053	20.898.782	174.051.367	317.764.226
(68.120.543)	(11.120.760)	(21.805.947)	(16.188.294)	(1.087.284.489)	(21.367.824)	(60.886.710)	(211.024.834)
63.842.865	17.197.434	(21.558.638)	(5.161.276)	(10.510.436)	(469.042)	113.164.657	106.739.392
227.707.584	65.357.060	–	37.198.450	3.121.728.759	65.897.045	437.609.335	792.573.372
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund**	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
EUR	USD	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
60.661.744	5.003.928	271.321.884	34.247.376	92.952.258	3.704.307	230.267.279	613.916.282
–	–	–	–	–	–	–	–
13.834.206	(27.937)	(5.337.962)	4.004.052	(2.437.366)	341.195	60.800.825	(44.747.789)
25.734.919	4.924	83.514.835	46.432.605	1.008.221	134.633	92.344.107	696.030.945
(19.037.994)	(4.365)	(20.875.914)	(6.287.230)	–	(4.180.135)	(85.659.742)	(258.116.714)
6.696.925	559	62.638.921	40.145.375	1.008.221	(4.045.502)	6.684.365	437.914.231
81.192.875	4.976.550	328.622.843	78.396.803	91.523.113	–	297.752.469	1.007.082.724

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

	Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*	Gesamt 31. Dezember 2021 [^]
	EUR	USD
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	–	17.275.464.309
Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1)	–	(550.157.685)
Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(5.724.870)	1.024.577.792
Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	1.271.182.451	9.741.419.653
Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen	(281.221.777)	(8.059.217.560)
Nettozunahme/(Nettoabnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften	989.960.674	1.682.202.093
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen	984.235.804	19.432.086.509

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

[^] Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum Freitag, 31. Dezember 2021 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und Schätztechniken, die bei der Erstellung dieses Abschlusses angewandt wurden, sind im Folgenden aufgeführt:

ENTSPRECHENSERKLÄRUNG

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde gemäß dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102 aufgestellt: „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 dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Umrechnungskursen erneut umgerechnet wird, wie in der Aufstellung der Veränderungen des Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens angegeben. Diese Zuweisungsmethode wirkt sich nicht auf den Wert des Nettovermögens aus, das den einzelnen Fonds zugewiesen wird.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – KLASSIFIZIERUNG

Diese Kategorie hat zwei Unterkategorien: finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und solche, die zu Beginn als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft werden.

Finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, wenn sie gekauft oder eingegangen werden, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen, oder wenn sie beim erstmaligen Ansatz Teil eines aus identifizierbaren, gemeinsam verwalteten Finanzinstrumenten bestehenden Portfolios sind, bei dem sich derzeit ein Vorgehensmuster abzeichnet, das auf kurzfristige Gewinnmitnahmen abzielt. Derivate werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die bei der Erstbewertung erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft aber verwaltet werden und deren Wertentwicklung auf der Grundlage ihres beizulegenden Zeitwerts gemäß der im Prospekt genannten Anlagestrategie der Fonds bewertet wird.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – ANSATZ, AUSBUCHUNG UND BEWERTUNG

Reguläre Käufe und Verkäufe von Anlagen werden am Handelstag ausgewiesen, d. h. zu dem Datum, an dem die Gesellschaft sich verpflichtet, die Anlage zu kaufen oder zu verkaufen. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Die Transaktionskosten werden als Aufwendung in der Gesamtergebnisrechnung verbucht.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die Rechte auf den Erhalt von Cashflows aus den bzw. auf Zahlung von Cashflows für die Anlagen erloschen sind oder die Gesellschaft im Wesentlichen alle mit dem Eigentum verbundenen Risiken und Chancen übertragen hat.

Die Folgebewertung aller erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten erfolgt zum beizulegenden Zeitwert. Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung im Geschäftsjahr ihres Entstehens anhand der Durchschnittskostenmethode verbucht.

Bei Devisenterminkontrakten auf der Ebene abgesicherter Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den entsprechenden Anteilsklassen zugewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Absicherungstätigkeiten werden in der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ in der Bilanz ausgewiesen.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – 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 und von The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin (die „Verwahrstelle“) zu diesem Zweck zu genehmigen, unter Rücksprache mit dem entsprechenden Anlageverwalter, um den wahrscheinlichen Veräußerungswert solcher Anlagen zu bestimmen.
- (d) Für den Fall, dass finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten nicht an einer anerkannten Börse notiert sind oder gehandelt werden, werden diese Vermögenswerte vom Verwaltungsrat mit Sorgfalt und nach Treu und Glauben und in Absprache mit dem jeweiligen Anlageverwalter zum wahrscheinlichen Veräußerungswert bewertet. Dieser wahrscheinliche Veräußerungswert kann anhand von Kursinformationen eines Maklers festgelegt werden.
- (e) Barmittel und andere liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert bewertet, gegebenenfalls mit aufgelaufenen Zinsen.
- (f) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (außer solchen, die gemäß (a) oder (b) oben bewertet wurden) werden zum letzten verfügbaren Nettoinventarwert des entsprechenden Organismus für gemeinsame Anlagen als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet.
- (g) An einem Markt gehandelte derivative Instrumente werden zum Abrechnungspreis dieser Instrumente an einem solchen Markt bewertet. Wenn diese derivativen Instrumente nicht an einem Markt gehandelt werden entspricht ihr Wert dem Tageskurs eines unabhängigen Kursdienstes oder unabhängiger Marktmacher.
- (h) Der Marktwert von Devisenterminkontrakten wird von einer unabhängigen Preisquelle bestimmt, wobei der Preis herangezogen wird, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Höhe und Fälligkeit abgeschlossen werden könnte.
- (i) Einschusszahlungen erfolgen beim Abschluss von Terminkontrakten (Futures) und werden im Allgemeinen in Form von Barmitteln oder Bargegenwerten geleistet. Der beizulegende Zeitwert von Terminkontrakten wird auf der Basis ihres täglichen Abrechnungskurses bestimmt. Wertänderungen offener Terminkontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten erfasst, bis die Kontrakte beendet werden, wobei zu diesem Zeitpunkt die realisierten Gewinne und Verluste erfasst werden. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten sind in der Aufstellung der Wertpapierbestände aufgeführt. Nachschussforderungen/-verbindlichkeiten zum Bilanzstichtag werden als Forderung bzw. Verbindlichkeit in der Bilanz ausgewiesen.
- (j) Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Put-Optionen wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung abgezogen. Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Call-Optionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Prämien, die für den Kauf von Optionen, welche ohne Ausübung verfallen, gezahlt werden, werden als realisierte Verluste behandelt. Die Optionsprämie auf verkaufte Call-Optionen, die ausgeübt wurden, wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers bzw. der Währung hinzuaddiert. Die Optionsprämie auf verkaufte Put-Optionen, die ausgeübt wurden, wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Fremdwährungen abgezogen. Prämien, die beim Verkauf von Optionen, die ohne Ausübung verfallen, vereinnahmt werden, werden als realisierte Gewinne behandelt.
- (k) Zinsswap-, Credit Default Swap- und Total Return Swap-Kontrakte werden auf Basis der Notierungen eines unabhängigen Kursdienstes oder von Marktmachern täglich bewertet, und eine etwaige Änderung wird als nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Zahlungen, die aufgrund einer Vertragskündigung vereinnahmt oder entrichtet wurden, werden abzüglich von Vorauszahlungen als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Erträge aus (im Freiverkehr gehandelten) OTC-Derivaten fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) oder anderen Parteien.
- (l) Commercial Paper und Termineinlagen werden zu den fortgeführten Anschaffungskosten als beste 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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

- (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.
- (n) Bestimmte Fonds können „TBA“-Kaufverpflichtungen (To Be Announced) eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Anteilspreis zu einem zukünftigen Zeitpunkt außerhalb der üblichen Abrechnungszeit zu kaufen. Obwohl der Anteilspreis feststeht, ist der Kapitalwert noch nicht endgültig festgelegt. Die Fonds halten bis zum Abrechnungstermin Barmittel oder erstklassige Schuldverschreibungen in einer Höhe, die ausreicht, um den Kaufpreis zu erfüllen, oder die Fonds schließen gegenläufige Kontrakte für den Terminverkauf anderer Wertpapiere, die sie besitzen, ab. Die Erträge aus den Wertpapieren werden erst am Abrechnungstag erzielt. TBA-Kaufverpflichtungen können als Wertpapiere an sich betrachtet werden und bergen ein Verlustrisiko, wenn der Wert des zu kaufenden Wertpapiers vor dem Abrechnungstermin sinkt, was zusätzlich zu dem Risiko eines Wertverlusts der anderen Vermögenswerte der Fonds besteht. Nicht abgewickelte TBA-Kaufverpflichtungen werden zum aktuellen Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere bewertet. Obwohl die Fonds TBA-Kaufverpflichtungen mit der Absicht eingehen können, Wertpapiere für ihre Portfolios zu erwerben oder gemäß von ihnen geschlossenen Optionskontrakten zu liefern, können die Fonds eine TBA-Kaufzusage vor dem Abrechnungstermin veräußern, wenn der Anlageverwalter dies für angemessen hält.
- (o) Aktien-Swaps werden entsprechend der Preisgrundlage für die zugrunde liegenden Aktienpositionen bewertet. Finanzierungskosten für Aktien-Swaps laufen täglich auf, werden monatlich angepasst und werden durch den Verkauf von Aktien-Swaps abgerechnet. Erträge aus Aktien-Swaps fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der Verwaltungsgesellschaft oder anderen Parteien.
- (p) Darlehen werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, der vom Daten- und Informationsdienstleister Markt bereitgestellt wird. Eingenommene oder gezahlte Gebühren sowie der Erhalt von Kapitalzahlungen werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. In Fällen, in denen Markt keinen Wert für ein Darlehen stellen kann, wird das Darlehen zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage einer von einem Finanzinstitut vorgenommenen Bewertung bewertet. Offene Darlehen werden auf Grundlage des vereinbarten Kaufpreises zum beizulegenden Zeitwert bewertet, bis eine Bewertung von einem Preisdienst zur Verfügung steht.
- (q) Einige Fonds können Genussscheine (Participatory Notes, P-Notes) nutzen, die an zulässigen Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Über diese Genussscheine erhalten die Fonds wirtschaftlichen Zugang zu bestimmten Aktien in beschränkt zugänglichen 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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

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.

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 2022 investieren der BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Euroland Bond Fund und der BNY Mellon European Credit Fund in andere Fonds der Gesellschaft (31. Dezember 2021: 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 Devisenkassakontrakten wurden mit Wirkung zum 31. Dezember 2022 in die Salden für Barmittel und Bargegenwerte bzw. Banküberziehungen einbezogen. Für das Vorjahr zum 31. Dezember 2021 erfolgte keine Anpassung der Behandlung nicht realisierter Gewinne und Verluste aus Devisenkassakontrakten, da sie unwesentlich waren.

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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

BESTEUERUNG

Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Praktiken sind von den Fonds keine Einkommen-, Kapitalertrag- oder sonstigen Steuern zu zahlen. Den Fonds entstehen derzeit Quellensteuern, die von bestimmten Ländern auf ihre Anlageerträge und Veräußerungsgewinne erhoben werden. Quellensteuern werden in der Gesamtergebnisrechnung gesondert und nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragsteuer auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Die Kapitalertragsteuer wird in Übereinstimmung mit den Steuervorschriften des jeweiligen Landes und den Steuersätzen für irische Anleger ausgewiesen. Die Kapitalertragsteuer und die am Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind in den Posten „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ und „Zu zahlende Steuern“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz aufgeführt.

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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

VERWÄSSERUNGS AUSGLEICH Forts.

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 Anteilhaber ist. Der sich daraus ergebende Betrag ist der Preis, der auf die vom Verwaltungsrat für angemessen erachtete Anzahl von Dezimalstellen gerundet wird.

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 (z. B. den Marktbedingungen, die sich aus den Auswirkungen der COVID-19-Pandemie, anderen Marktkrisen oder einem Markteinbruch ergeben) 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 Anteilhaber zu einer Stimme je Anteil bei einer Abstimmung. Anteile werden von den Anteilhabern zu Preisen eingelöst, die auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse basieren.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sind wie folgt:

Fonds	Währung der	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	–	–	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

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 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
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

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 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 Food Fund**						
	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 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene 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 Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Equity Fund**						
	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 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

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 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
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

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 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
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

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
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
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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 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	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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 ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene 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

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 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.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr zum Freitag, 31. Dezember 2021 waren wie folgt:

Fonds	Währung der	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
	Klasse C	EUR	3.099	–	–	3.099
	Klasse C (Inc)	EUR	2.070	–	(2.070)	–
	Klasse R	EUR	54.980	1.618	(17.395)	39.203
	Klasse R (Hedged)	USD	12.034	73	(3.526)	8.581
	Klasse R (Inc)	EUR	7.408	1.270	(3.709)	4.969
	Klasse S	EUR	71.835	10.282	(35.054)	47.063
	Klasse T (Hedged)	CHF	343	–	(210)	133
	Klasse T (Hedged)	USD	78.701	–	–	78.701
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	98.014	4.755	(8.029)	94.740
	Klasse W (Acc)	EUR	1.238	–	–	1.238
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	25.294	8.936	(25.928)	8.302
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	961.230	93.847	(254.946)	800.131
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.951	104	(1.951)	104
	Klasse X	EUR	1.434.832	54.886	(252.283)	1.237.435
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	866.542	228.587	(15.894)	1.079.235

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	212.885	–	(497)	212.388
	Klasse R (Hedged)	CHF	17.026	–	–	17.026
	Klasse R (Hedged)	EUR	49.396.435	3.124.749	(20.136.605)	32.384.579
	Klasse R (Hedged)	USD	6.019.450	516.834	(2.157.078)	4.379.206
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	3.323.266	60.447	(780.861)	2.602.852
	Sterling R (Acc)	GBP	736.091	157.339	(159.986)	733.444
	Sterling S (Acc)	GBP	239.506	8.422	(85.256)	162.672
	Klasse T (Hedged)	EUR	31.251.987	2.885.487	(12.701.687)	21.435.787
	Klasse T (Hedged)	USD	588.862	–	–	588.862
	Klasse U (Hedged)	EUR	65.241.453	6.417.331	(6.627.946)	65.030.838
	Klasse U (Hedged)	USD	2.219.154	500.314	(1.546.922)	1.172.546
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	19	–	–	19
	Sterling U (Acc)	GBP	3.537.380	2.748.653	(2.155.988)	4.130.045
	Sterling X (Acc)	GBP	69.174.413	36	(63.682.511)	5.491.938
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund						
	Klasse F (Acc)	EUR	503.305	4.099.064	(188.832)	4.413.537
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	–	1.229.388	(10.000)	1.219.388
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	2.608.089	4.502.893	(2.140.627)	4.970.355
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	2.057.015	11.850.431	(592.219)	13.315.227
	Klasse R (Acc)	EUR	–	55.000	–	55.000
	Klasse U (Acc)	EUR	19.795.137	131.349	(730)	19.925.756
	Klasse U (Acc) (Hedged)	CHF	–	12.093.083	(224.234)	11.868.849
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	745.772	62.533	(84.000)	724.305
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	–	100.000
	Klasse X (Acc)	EUR	4.936.321	4.458	(4.936.321)	4.458
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	58.716.928	(31.361.845)	27.355.083
BNY Mellon Asian Income Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	15.977	–	(14.997)	980
	Klasse A (Inc)	USD	–	106.715	(127)	106.588
	Klasse A (Inc)	EUR	54.958	235.901	(59.269)	231.590
	Klasse B (Acc)	USD	107.267	–	–	107.267
	Klasse C (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	Klasse W (Acc)	EUR	–	8.548.921	(668.915)	7.880.006
	Klasse W (Inc)	EUR	21.647.011	871.999	(21.883.635)	635.375
	Klasse W (Inc)	USD	3.546.000	–	(354.812)	3.191.188
	Sterling W (Inc)	GBP	217.453	2.542	(30.123)	189.872

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile	Während des Geschäftsjahres ausgegeben Anteile	Während des Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Asian Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	4.042.498	1.804.246	(1.931.494)	3.915.250
	Klasse A	EUR	3.758.429	3.118.548	(2.308.581)	4.568.396
	Klasse B	USD	2.521.396	79.538	(146.204)	2.454.730
	Klasse B	EUR	51.467	73.970	(10.000)	115.437
	Klasse C	USD	705.937	31.652	(537.078)	200.511
	Klasse C	EUR	394.407	496.275	(656.384)	234.298
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	Klasse W	USD	660.749	316.722	(394.629)	582.842
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	53.920	14.254.077	(2.989.955)	11.318.042
	Klasse A (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse B (Inc)	SGD	–	5.000	–	5.000
	Klasse C (Acc)	USD	–	1.376.316	(5.000)	1.371.316
	Klasse E (Acc)	USD	196.450	255.843	(22.235)	430.058
	Klasse E (Acc)	EUR	315.700	17.545.631	(7.654.918)	10.206.413
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	–	1.520.664	(606.587)	914.077
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	3.846.860	(51.700)	3.800.160
	Klasse G (Acc)	EUR	–	90.022	–	90.022
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	481.211	20.300.014	(3.983.636)	16.797.589
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse K (Acc)	USD	1.399.704	178.050	(849.849)	727.905
	Klasse K (Acc)	EUR	1.983.904	255.788	(480.480)	1.759.212
	Klasse W (Acc)	USD	4.978.700	4.236.971	(3.654.010)	5.561.661
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	841.545	(10.000)	831.545
BNY Mellon Brazil Equity Fund						
	Klasse A	USD	11.211.263	1.505.236	(3.649.597)	9.066.902
	Klasse A	EUR	14.680.237	6.017.357	(11.066.049)	9.631.545
	Klasse B	USD	2.618.496	395.860	(1.624.309)	1.390.047
	Klasse B	EUR	105.398	–	–	105.398
	Sterling B (Acc)	GBP	195.131	42.834	(180.710)	57.255
	Klasse C	USD	6.259.248	5.753.738	(6.472.375)	5.540.611
	Klasse C	EUR	5.919.756	520.133	(6.286.866)	153.023
	Sterling C (Inc)	GBP	31.340	109.211	(36.374)	104.177
	Klasse G (Acc)	EUR	1.653.156	345.330	(345.330)	1.653.156
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.359.231	969.880	(1.241.387)	1.087.724
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	5.006.428	1.037.756	(3.771)	6.040.413
	Klasse W (Acc)	USD	993.387	79.415	(437.306)	635.496
	Klasse W (Acc)	EUR	561.080	149.802	(291.026)	419.856
	Sterling W (Acc)	GBP	3.335.679	3.285.851	(3.335.557)	3.285.973

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 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 Total Return Fund**						
	Klasse A (Acc)	USD	11.806	–	(11.806)	–
	Klasse C (Acc)	USD	310.749	–	(310.749)	–
	Klasse E (Acc)	USD	14.519.613	–	(14.519.613)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	148.618	–	(148.618)	–
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse X (Acc)	USD	50.205	–	(50.205)	–
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	56	568.303	(3.831)	564.528
	Klasse A (Inc)	USD	80.276	272.825	(90.289)	262.812
	Klasse C (Acc)	USD	79.747.465	7.732.190	(38.442.165)	49.037.490
	Klasse G (Acc)	USD	1.023.990	152.709	(847.124)	329.575
	Klasse G (Acc)	EUR	130.259	286.732	(123.872)	293.119
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	14.484.481	172.457	(14.649.580)	7.358
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	3.497.367	273.059	(3.735.760)	34.666
	Klasse W (Acc)	USD	40.751.080	19.924.760	(31.430.338)	29.245.502
	Klasse W (Acc)	EUR	53.633.658	8.039.186	(9.475.546)	52.197.298
	Klasse W (Inc)	EUR	71.942.297	54.824.423	(13.282.444)	113.484.276
	Sterling W (Acc)	GBP	–	206.980	–	206.980
	Klasse X (Acc)	USD	90.100.439	–	(56.515)	90.043.924

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Efficient Global High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse E (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	55.791.916	(1.657.014)	54.234.902
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	51.095.373	(19.749.671)	31.445.702
	Klasse E (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.198	(97.853)	11.516
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	100.170	24.403.811	(961.143)	23.542.838
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.205	(97.859)	11.517
	Klasse W (Acc)	USD	23.355.282	–	(23.350.671)	4.611
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	100.000	–	(90.000)	10.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	33.300.715	(3.015.762)	30.384.953
	Klasse W (Inc)	USD	5.009	457	(229)	5.237
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	100.171	9.200	(97.855)	11.516
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.170	1.508.820	(373.440)	1.235.550
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	30.483.755	11.927	(15.872.695)	14.622.987
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(86.811)	13.189
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	(5.000)	–

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	72.000	5.154.889	(1.877.520)	3.349.369
	Klasse C (Acc)	USD	339.875	10.527.003	(1.645.932)	9.220.946
	Klasse C (Inc)	USD	–	1.288.309	(81)	1.288.228
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	–	65.232.470	(100.000)	65.132.470
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	–	2.556.055	(729.912)	1.826.143
	Klasse N (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse N (Inc) (M)	USD	–	5.112	(56)	5.056
	Klasse W (Acc)	USD	48.046.390	249.926.179	(71.847.770)	226.124.799
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	5.189.226	(5.101.033)	88.193
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Klasse W (Inc)	USD	–	5.194	(97)	5.097
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	8.642.783	904.977	(91.279)	9.456.481
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	102.030	(102.030)	–
	Klasse X (Acc)	USD	214.308.117	323.677.979	(103.475.620)	434.510.476
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	208.797.923	122.833.508	(68.075.478)	263.555.953
	Klasse X (Inc)	USD	549.202.955	117.906.640	(162.003.039)	505.106.556
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	100.044	67.950.392	(104.656)	67.945.780
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
	Klasse A (Inc)	USD	34.017	189.885	(34.017)	189.885
	Klasse A (Inc)	EUR	609.577	2.354.732	(30.612)	2.933.697
	Klasse C (Acc)	USD	188.437	–	(136.000)	52.437
	Klasse C (Inc)	USD	5.139	458	(5.597)	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	38.577.634	2.127.230	(4.983.203)	35.721.661
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	257.899.993	29.608.004	(214.294.486)	73.213.511
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	102.124	6.355	(108.479)	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	82.815	(86.755)	96.060
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	13.031	1.340.000	(1.340.000)	13.031
	Klasse K (Acc)	USD	313.433	–	–	313.433
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(88.281)	11.719
	Klasse L (Acc)	USD	65.643.817	235.114.219	(82.405.487)	218.352.549
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	57.894.039	54.229.098	(70.737.424)	41.385.713
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(88.959)	11.041
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	17.097.207	8.099.782	(1.638.686)	23.558.303
	Klasse W (Acc)	USD	63.099.253	–	(49.206.229)	13.893.024
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse W (Inc)	USD	5.087	492.381	(297)	497.171
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	26.021.008	7.933.138	(1.339.000)	32.615.146
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	101.740	14.832.582	(1.374.781)	13.559.541
	Klasse X (Acc)	USD	5.087.338	89.909.009	(19.331.525)	75.664.822
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	21.620.243	36.993.989	(58.614.232)	–
	Klasse X (Inc)	USD	5.127	457	(5.584)	–
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	–	45.068.678	–	45.068.678

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Emerging Markets Corporate Debt Fund						
	Klasse A	USD	29.163	204.001	(28.543)	204.621
	Klasse A	EUR	90.099	69.775	(71.253)	88.621
	Klasse A (Inc)	USD	51	1	(52)	–
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	327	593	(504)	416
	Klasse B	USD	2.172	557	(444)	2.285
	Klasse C	USD	94.118	32.732	(28.824)	98.026
	Klasse C	EUR	58.848	61.711	(39.064)	81.495
	Klasse G (Inc)	USD	17.710	5.221	(5.286)	17.645
	Klasse H (Hedged)	EUR	124.861	20.826	(65.661)	80.026
	Klasse I (Hedged)	EUR	130.581	23.383	(45.337)	108.627
	Klasse W	USD	255.631	68.788	(57.939)	266.480
	Klasse W	EUR	7.006	3.664	(2.714)	7.956
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	135.169	246.116	(11.937)	369.348
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	243.405	689.502	(61.983)	870.924
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	58.160	20.000	(8.160)	70.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	212.650	–	(1.100)	211.550
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	27.930	11.309	(9.831)	29.408
	Klasse X	USD	673.975	522.242	(122.737)	1.073.480
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	173.939	–	(173.939)	–
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund						
	Klasse A	USD	532.145	50.531	(129.769)	452.907
	Klasse A	EUR	4.280.343	364.042	(1.139.779)	3.504.606
	Klasse C	USD	5.093.433	626.642	(945.858)	4.774.217
	Klasse C	EUR	3.002.021	145.179	(375.669)	2.771.531
	Klasse C (Inc)	USD	798.050	–	(706.063)	91.987
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1.339.284	299.459	(1.066.532)	572.211
	Klasse W	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	2.630.319	129.566	–	2.759.885

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
	Klasse A	USD	8.092.103	6.908	(2.366.576)	5.732.435
	Klasse A	EUR	13.646.522	615.621	(4.764.176)	9.497.967
	Klasse A (Inc)	USD	52.723	43	(33.121)	19.645
	Klasse A (Inc)	EUR	1.888.858	509.404	(317.362)	2.080.900
	Sterling A (Acc)	GBP	227.859	–	(50.809)	177.050
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	Klasse C	USD	1.469.138	983.283	(1.526.363)	926.058
	Klasse C	EUR	621.038	228.088	(269.226)	579.900
	Klasse C (Inc)	USD	328.123	95.858	(404.481)	19.500
	Klasse C (Inc)	EUR	15.487.661	5.000	(6.668.160)	8.824.501
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	–	–	1.615
	Sterling C (Inc)	GBP	153.349	7	(15.337)	138.019
	Klasse H (Hedged)	EUR	11.660.523	175.846	(7.066.556)	4.769.813
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.533.104	3.863.198	(2.472.366)	3.923.936
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	Klasse W	USD	86.541.800	661.577	(626.743)	86.576.634
	Klasse W	EUR	4.704.059	881.198	(3.109.030)	2.476.227
	Klasse W (Hedged)	EUR	8.982.606	731.918	(8.933.197)	781.327
	Klasse W (Inc)	EUR	767.287	–	–	767.287
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	487.950	14.530	(488.131)	14.349
	Sterling W (Inc)	GBP	7.302.134	143.022	(6.799.536)	645.620
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	37.081	49.243	(48.572)	37.752
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
	Klasse A	EUR	23.504	28.859	–	52.363
	Klasse C	USD	256.500	–	–	256.500
	Klasse W (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse X (Inc)	USD	27.155.049	7.494.102	(5.019.666)	29.629.485
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	66.429.041	2.895.132	(16.330.325)	52.993.848
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(86.035)	13.965
	Klasse W (Acc)	USD	64.610.852	–	(4.905.808)	59.705.044
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	7.349	–	–	7.349
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	211.011	61.163	(19.136)	253.038
	Klasse X (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Euroland Bond Fund						
	Klasse A	EUR	115.491.909	7.060.206	(58.148.672)	64.403.443
	Klasse A (Inc)	EUR	8.088.463	197.246	(2.571.118)	5.714.591
	Klasse B	EUR	62.950	–	(6.940)	56.010
	Klasse B (Inc)	EUR	16.640	–	–	16.640
	Klasse C	EUR	42.672.639	1.141.054	(25.571.587)	18.242.106
	Klasse C (Inc)	EUR	2.622.554	39.060	(798.090)	1.863.524
	Klasse G (Acc)	EUR	1.578.698	–	(50.628)	1.528.070
	Klasse H (Hedged)	CHF	3.026.540	35.000	(345.145)	2.716.395
	Klasse I (Hedged)	CHF	1.208.515	6.717.600	(437.654)	7.488.461
	Klasse W (Acc)	EUR	60.883.193	17.816.240	(17.781.729)	60.917.704
	Klasse Z^^	EUR	14.014.449	5.499.932	(5.711.428)	13.802.953
BNY Mellon European Credit Fund						
	Klasse A	EUR	8.415	1.715	(2.229)	7.901
	Klasse C	EUR	40.381	21.501	(12.551)	49.331
	Klasse W (Acc)	EUR	847	517	(276)	1.088
	Klasse X	EUR	247.226	33.065	(40.400)	239.891
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 Food Fund*◀◀						
	Klasse E (Acc)	EUR	–	605.000	(205.000)	400.000
	Klasse W (Acc)	USD	–	2.000.000	–	2.000.000
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 Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Global Bond Fund						
	Klasse A	USD	42.245.454	9.971.492	(16.341.531)	35.875.415
	Klasse A	EUR	21.615.304	1.052.908	(10.280.978)	12.387.234
	Klasse B	USD	750.738	42.244	(79.294)	713.688
	Klasse C	USD	62.411.076	16.288.991	(33.680.105)	45.019.962
	Klasse C	EUR	81.091.176	23.657.317	(58.404.500)	46.343.993
	Klasse C (Inc)	USD	553.933	163.454	(207.965)	509.422
	Sterling C (Inc)	GBP	3.235.412	342.998	(856.264)	2.722.146
	Klasse H (Hedged)	EUR	2.009.139	113.067	(703.083)	1.419.123
	Klasse I (Hedged)	EUR	5.237.009	95.419	(4.811.116)	521.312
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	–	10.273.565	(10.259.870)	13.695
	Klasse W (Acc)	USD	18.738.087	37.235.300	(14.245.065)	41.728.322
	Klasse W (Acc)	EUR	4.546	5.000	(4.546)	5.000
	Klasse X	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1.409.377	1.490.744	(467.130)	2.432.991
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	4.219.864	7.814.033	(1.139.211)	10.894.686
BNY Mellon Global Credit Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse A (Inc) (Q)	USD	5.012	28	(5.040)	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	10.289.102	5.403.712	(2.265.299)	13.427.515
	Klasse W (Acc)	USD	6.854.065	3.078.441	(7.784.478)	2.148.028
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	393.476	167.463	(229.704)	331.235
	Klasse X (Acc)	USD	198.786.267	14.267.370	(175.514.874)	37.538.763
	Klasse X (Acc)	JPY	–	21.509.574	(822)	21.508.752
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	463.472.278	–	(192.909.786)	270.562.492
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	–	65.059.740	(2.733)	65.057.007

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A	USD	3.389.842	309.402	(1.542.002)	2.157.242
	Klasse A	EUR	1.634.650	572.576	(1.163.410)	1.043.816
	Klasse A (Inc)	USD	178.103	668	–	178.771
	Klasse C	USD	110.208.727	35.890.815	(16.935.623)	129.163.919
	Klasse G (Acc)	EUR	67.120	–	(13.931)	53.189
	Klasse H (Hedged)	EUR	5.274.262	1.273.620	(3.752.751)	2.795.131
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	639.413	60.279	(373.780)	325.912
	Klasse I (Hedged)	EUR	10.595.082	619.547	(4.665.112)	6.549.517
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	–	10.000	–	10.000
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	1.340.481	188.300	(80.236)	1.448.545
	Klasse W	USD	128.431.502	8.887.506	(48.125.842)	89.193.166
	Klasse W (Hedged)	EUR	74.519.118	23.557.001	(32.699.595)	65.376.524
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	139.782	9.672	(149.454)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	9.679.014	1.012.776	(127.890)	10.563.900
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	8.565.353	1.397.397	(2.275.156)	7.687.594
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.880	714	(101.594)	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	19.689.028	–	(54.141)	19.634.887
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	10.038.007	6.289	(132.516)	9.911.780
	Klasse Z (Acc)	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse Z (Inc)	USD	5.000	85	(5.085)	–
	Sterling Z (Acc)	GBP	3.210.869	24.696	(1.994.071)	1.241.494
	Sterling Z (Inc)	GBP	59.550	24.000	(15.550)	68.000
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	(89.361)	10.639
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	100.859	1.530	(91.480)	10.909

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Emerging Markets Opportunities Fund<						
	Klasse A	USD	273.888	4.696.253	(4.740.593)	229.548
	Klasse A	EUR	1.044.155	2.076.230	(2.430.596)	689.789
	Klasse A (Inc)	EUR	87.417	918.417	(719.177)	286.657
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Acc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Inc)	USD	5.170	169.319	(5.235)	169.254
	Klasse B (Inc)	EUR	94.342	21.778	(12.545)	103.575
	Klasse C	USD	135.000	5.597	–	140.597
	Klasse C (Acc)	USD	19.394.549	13.775.846	(16.730.443)	16.439.952
	Klasse C (Acc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse C (Inc)	USD	52.676	70.256	(58.180)	64.752
	Sterling C (Inc)	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse E (Acc)	USD	2.396.890	3.694.637	(1.912.006)	4.179.521
	Klasse E (Acc)	CHF	874.464	131.561	(274.455)	731.570
	Klasse H (Hedged)	EUR	180.428	759.008	(515.689)	423.747
	Klasse I (Hedged)	EUR	1.018.814	642.761	(1.275.643)	385.932
	Klasse W (Acc)	USD	190.105	240.278	(351.244)	79.139
	Klasse W (Acc)	EUR	1.243.335	4.858.189	(1.554.026)	4.547.498
	Klasse W (Inc)	USD	236.198	–	(89.634)	146.564
	Klasse W (Inc)	EUR	66.211	2.169	(10.138)	58.242
BNY Mellon Global Equity Fund<<						
	Klasse A	USD	12.169.789	16.667.088	(18.711.168)	10.125.709
	Klasse A	EUR	1.383.653	9.659.069	(8.509.771)	2.532.951
	Klasse B	USD	3.273.634	136.320	(50.821)	3.359.133
	Klasse B	EUR	16.994	23.000	–	39.994
	Klasse C	USD	8.137.637	3.333.602	(7.379.495)	4.091.744
	Klasse I (Hedged)	EUR	243.605	–	–	243.605
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	–	10.068.962	(10.054.077)	14.885
	Klasse W (Acc)	USD	21.188.129	8.867.760	(7.954.831)	22.101.058
	Klasse W (Acc)	EUR	177.006.318	23.993.674	(20.656.476)	180.343.516

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Equity Income Fund						
	Klasse A	USD	10.085.112	4.435.849	(5.888.493)	8.632.468
	Klasse A	EUR	22.548.021	3.189.268	(8.259.696)	17.477.593
	Klasse A (Inc)	USD	2.899.281	544.009	(563.850)	2.879.440
	Klasse A (Inc)	EUR	6.030.788	1.126.067	(2.835.022)	4.321.833
	Sterling A (Acc)	GBP	293.069	–	(165.373)	127.696
	Klasse B	USD	5.388.669	61.835	(923.156)	4.527.348
	Klasse B	EUR	1.318.596	32.704	(413.278)	938.022
	Klasse B (Inc)	USD	3.725.187	93.411	(644.100)	3.174.498
	Klasse B (Inc)	EUR	1.586.893	242.937	(306.176)	1.523.654
	Sterling B (Inc)	GBP	1.034.895	52.440	(503.074)	584.261
	Klasse C	USD	37.784.278	5.102.756	(25.324.943)	17.562.091
	Klasse C	EUR	5.569.211	876.476	(1.283.738)	5.161.949
	Klasse C (Inc)	USD	7.200.537	2.250.522	(1.595.149)	7.855.910
	Klasse C (Inc)	EUR	18.981.884	22.856	(2.371.608)	16.633.132
	Sterling C (Inc)	GBP	743.722	7.732	(236.933)	514.521
	Klasse G (Acc)	EUR	1.126.081	57.676	(1.070.681)	113.076
	Klasse H (Hedged)	EUR	5.093.817	371.908	(2.194.918)	3.270.807
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	6.888.678	257.132	(982.973)	6.162.837
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.693.698	611.030	(1.926.905)	1.377.823
	Klasse W	USD	6.080.309	7.641.807	(11.437.532)	2.284.584
	Klasse W	EUR	15.760.320	4.014.191	(3.749.786)	16.024.725
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	209.957	63.737	(186.718)	86.976
	Klasse W (Inc)	USD	15.942.657	409.587	(2.713.973)	13.638.271
	Klasse W (Inc)	EUR	151.859.683	4.287.205	(142.935.726)	13.211.162
	Sterling W (Acc)	GBP	2.018.906	92.212	(1.004.866)	1.106.252
	Sterling W (Inc)	GBP	25.620.516	2.167.805	(13.670.266)	14.118.055
	Klasse Z (Acc)	USD	2.111.564	92.370	(27.000)	2.176.934
	Klasse Z (Acc)	EUR	38.120	14.983	(15.800)	37.303
	Klasse Z (Inc)	USD	3.131.227	–	(1.063.278)	2.067.949
	Klasse Z (Inc)	EUR	476.850	12.000	(18.977)	469.873
	Sterling Z (Acc)	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	Sterling Z (Inc)	GBP	3.135.118	772.004	(703.159)	3.203.963
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	Klasse A	EUR	5.910.931	1.363.441	(2.666.464)	4.607.908
	Klasse C	USD	40.815.719	9.747.259	(7.517.361)	43.045.617
	Klasse C	EUR	12.195	553.085	(223.094)	342.186
	Klasse C (Inc)	USD	398.288	–	–	398.288
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.168.660	126.919	(324.062)	971.517
	Klasse I (Hedged)	EUR	7.646.402	938.394	(455.241)	8.129.555
	Klasse W (Acc)	USD	14.136.406	9.908.175	(705.710)	23.338.871
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	968.200	257.825	(341.800)	884.225
	Klasse X (Inc)	USD	21.296.254	3.458.373	(4.197.623)	20.557.004
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	19.537.541	3.464.242	(2.803.866)	20.197.917

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Infrastructure Income Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	195.925	4.952	(195.925)	4.952
	Klasse A (Inc)	USD	716.993	42.503	(307.472)	452.024
	Klasse A (Inc)	EUR	5.545	27.646	(7.286)	25.905
	Klasse B (Acc)	SGD	7.885.537	11.297.593	(1.747.940)	17.435.190
	Klasse B (Acc)	USD	1.311.832	5.223.768	(1.573.040)	4.962.560
	Klasse B (Inc)	USD	6.491.158	13.357.532	(2.627.289)	17.221.401
	Klasse B (Inc)	SGD	4.429.644	11.153.723	(1.198.526)	14.384.841
	Klasse B (Inc) (M)	USD	–	5.380	(190)	5.190
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	–	5.370	(185)	5.185
	Klasse E (Inc)	USD	876.451	57.895.188	(6.033.568)	52.738.071
	Klasse E (Inc)	EUR	2.709.460	1.693.894	(432.166)	3.971.188
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	79.817.550	10.043.509	(35.942.625)	53.918.434
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	323.699	369.702	(20.881)	672.520
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1.071.548	58.788	(99.901)	1.030.435
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	669.773	956.919	(446.142)	1.180.550
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	1.935.403	5.352.237	(288.356)	6.999.284
	Klasse W (Acc)	USD	11.117.644	16.366.703	(10.109.046)	17.375.301
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	180.000	–	(82.713)	97.287
	Klasse W (Inc)	USD	2.182.226	5.541.300	(1.302.218)	6.421.308
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	17.900.000	–	–	17.900.000
BNY Mellon Global Leaders Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	861.649	241.476	(74.273)	1.028.852
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	1.122	–	6.122
	Klasse A (Inc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	7.556.560	(1.201.069)	6.360.491
	Klasse C (Acc)	USD	3.167.533	46.959	(257.082)	2.957.410
	Klasse E (Acc)	USD	10.663.143	4.658.627	(2.359.703)	12.962.067
	Klasse E (Acc)	EUR	991.680	–	(5.000)	986.680
	Sterling E (Acc)	GBP	2.926.036	1.456.739	(285.988)	4.096.787
	Klasse H (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	(55.942)	11.058
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	80.161	132.093	(82.140)	130.114
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	103.138	(75.075)	116.063
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(84.355)	12.645
	Klasse W (Acc)	USD	749.322	672.905	(794.963)	627.264
	Klasse W (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	(56.680)	10.320
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(75.249)	12.751
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(84.525)	12.475
	Sterling W (Acc)	GBP	993.773	677.880	(332.658)	1.338.995

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Multi-Asset Income Fund**						
	Klasse A (Acc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse A (Inc)	EUR	2.443.887	44.976	(2.488.863)	–
	Klasse A (Inc)	USD	5.049	96	(5.145)	–
	Klasse C (Acc)	EUR	5.930	–	(5.930)	–
	Klasse E (Inc)	EUR	6.167.284	81.813	(6.249.097)	–
	Klasse W (Acc)	EUR	10.635.492	–	(10.635.492)	–
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
	Klasse A	USD	2.037.553	802.970	(926.604)	1.913.919
	Klasse A	EUR	7.456.242	1.223.328	(2.310.197)	6.369.373
	Klasse B	USD	765.528	52.438	(112.642)	705.324
	Klasse C	USD	258.231	5.089	(11.260)	252.060
	Klasse C	EUR	52.416	101.681	(99.487)	54.610
	Klasse H (Hedged)	EUR	242.445	2.544	(114.785)	130.204
	Klasse I (Hedged)	EUR	14.931	–	–	14.931
	Klasse W (Acc)	USD	3.600	1.971.385	(1.972.779)	2.206
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A	EUR	556.965.607	362.787.911	(279.273.351)	640.480.167
	Klasse A (Inc)	EUR	17.522.756	5.498.484	(2.806.338)	20.214.902
	Klasse C	EUR	137.886.714	122.695.929	(154.759.993)	105.822.650
	Klasse C (Inc)	EUR	4.428.295	4.928.019	(2.146.053)	7.210.261
	Klasse G (Acc)	EUR	9.764.885	15.216.791	(3.172.123)	21.809.553
	Klasse G (Inc)	EUR	4.291.694	908.320	(720.557)	4.479.457
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	4.521.594	353.535	(865.271)	4.009.858
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	2.494.943	1.563.805	(320.951)	3.737.797
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1.248.102	360.099	(294.216)	1.313.985
	Klasse W	EUR	536.534.496	95.683.635	(152.805.399)	479.412.732
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	520.362	248.770	(23.626)	745.506
	Klasse W (Inc)	EUR	1.039.717	735.397	–	1.775.114
	Klasse X	EUR	655.544.243	58.910.365	(112.184.007)	602.270.601
	Klasse Z (Acc)	EUR	69.990.795	40.089.697	(1.617.690)	108.462.802
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
	Sterling B (Acc)	GBP	959.396	440.983	(459.882)	940.497
	Sterling B (Inc)	GBP	402.024	115.134	–	517.158
	Sterling C (Inc)	GBP	262.366	–	(97.076)	165.290
	Sterling W (Acc)	GBP	11.550.607	6.523.896	(4.161.838)	13.912.665
	Sterling W (Inc)	GBP	9.779.977	2.097.964	(2.268.300)	9.609.641
	Sterling X (Acc)	GBP	23.644.409	5.321.740	(8.308.537)	20.657.612

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Global Real Return Fund (USD)						
	Klasse A	USD	61.832.404	50.401.055	(14.009.186)	98.224.273
	Klasse C	USD	26.138.741	34.246.389	(8.715.349)	51.669.781
	Klasse C (Inc)	USD	8.993	70.000	–	78.993
	Klasse G (Acc)	USD	4.250	163.379	–	167.629
	Klasse W	USD	13.048.442	7.519.465	(4.190.389)	16.377.518
	Klasse W (Inc)	USD	9.459.564	2.408.415	(1.270.365)	10.597.614
	Klasse X	USD	61.865.762	5.505.304	(6.581.478)	60.789.588
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	3.479.928	2.038.917	(1.074.775)	4.444.070
	Klasse A (Inc)	USD	104.868	663.597	(38.264)	730.201
	Klasse C (Acc)	USD	8.777.559	1.623.805	(2.307.655)	8.093.709
	Klasse G (Acc)	USD	170.550	233.422	(10.000)	393.972
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	61.159.515	33.431.903	(14.712.760)	79.878.658
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	2.075.534	701.600	(435.619)	2.341.515
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	12.375.078	2.228.809	(5.285.210)	9.318.677
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	710.936	2.615.655	(306.140)	3.020.451
	Klasse W (Acc)	USD	49.014.543	27.758.389	(10.717.197)	66.055.735
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	121.900	852.057	(10.050)	963.907
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	52.457.305	52.061.445	(7.267.613)	97.251.137
	Klasse W (Inc)	USD	30.073.325	8.017.039	(30.153.249)	7.937.115
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1.263.000	–	(360.000)	903.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	30.831.132	20.129.465	(18.234.340)	32.726.257
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	2.610.285	1.998.973	(613.881)	3.995.377
	Klasse X (Acc)	USD	4.363	39.031.385	(4.949.148)	34.086.600
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	50.884.969	–	(28.287.669)	22.597.300
	Klasse Y (Acc)	USD	155.815.437	–	(13.306.431)	142.509.006
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	7.388.586	–	–	7.388.586
	Klasse Z (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Inc)	USD	–	736.446	(148)	736.298
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	2.500.941	1.566.416	(1.457.130)	2.610.227
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	80.889.803	32.021.842	(25.339.914)	87.571.731
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 Geschäftsjahres zurückgenommene Anteile	Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	136.827	2.406.031	(2.188.053)	354.805
	Klasse C	JPY	700.701	1.841.559	(808.501)	1.733.759
	Klasse C	USD	–	28.139.699	(28.134.699)	5.000
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.994.995	529.036	(2.897.831)	1.626.200
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	–	(5.000)	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1.083.387	486.838	(81.198)	1.489.027
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	489.734	33.441	(296.092)	227.083
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(82.791)	5.209
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(91.520)	5.480
	Klasse H (Hedged)	EUR	1.315.391	1.772.674	(962.746)	2.125.319
	Klasse H (Hedged)	USD	253.312	7.012	(34.684)	225.640
	Klasse I (Hedged)	EUR	2.523.308	6.161.378	(6.418.772)	2.265.914
	Klasse I (Hedged)	USD	465.609	8.604.461	–	9.070.070
	Klasse W	JPY	18.889.337	3.562.173	(2.267.903)	20.183.607
	Klasse W (Acc)	EUR	25.182.710	2.898.589	(2.821.791)	25.259.508
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	630.303	4.003	(38.177)	596.129
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(82.728)	5.272
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	(91.474)	5.526
	Sterling W (Acc)	GBP	1.054.479	575.679	(355.362)	1.274.796
	Sterling W (Inc)	GBP	5.316.378	952.120	(442.917)	5.825.581

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Long-Term Global Equity Fund						
	Klasse A	EUR	84.506.257	19.632.881	(22.099.729)	82.039.409
	Klasse A	USD	31.911.348	7.333.249	(10.485.469)	28.759.128
	Klasse A (Inc)	EUR	2.708.345	297.489	(927.325)	2.078.509
	Sterling A (Acc)	GBP	799.496	632.725	(102.096)	1.330.125
	Klasse B	EUR	1.335.311	378.483	(428.597)	1.285.197
	Klasse B	USD	11.094.298	23.403.366	(6.288.751)	28.208.913
	Klasse B (Acc)	SGD	8.327.925	12.228.238	(2.535.801)	18.020.362
	Sterling B (Inc)	GBP	285.939	510.913	(51.685)	745.167
	Klasse C	EUR	48.207.401	9.034.881	(10.083.083)	47.159.199
	Klasse C	USD	95.232.761	7.362.562	(55.615.855)	46.979.468
	Klasse G (Acc)	EUR	2.522.228	289.882	(779.840)	2.032.270
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)	JPY	–	10.000	–	10.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	644.076	3.729.333	(123.224)	4.250.185
	Klasse S	EUR	41.110.627	10.400.522	(7.293.226)	44.217.923
	Klasse S (Acc) 1	USD	31.667.725	–	(3.269.470)	28.398.255
	Klasse W	EUR	97.268.019	78.396.848	(71.397.644)	104.267.223
	Klasse W	USD	40.091.670	10.399.889	(14.447.314)	36.044.245
	Klasse W (Hedged)	USD	2.176.148	2.757.490	(1.041.737)	3.891.901
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	276.929	185.296	(100.000)	362.225
	Klasse W (Inc)	EUR	110.280.944	9	(110.280.953)	–
	Klasse W (Inc)	USD	13.457.168	65.548	(789.863)	12.732.853
	Sterling W (Acc)	GBP	9.728.969	2.325.910	(5.837.702)	6.217.177
	Sterling W (Inc)	GBP	3.947.027	2.448.363	(478.485)	5.916.905
	Klasse X (Acc)	USD	96.371.579	37.126.294	(133.497.873)	–
	Sterling X	GBP	7.143.040	–	(2.287.029)	4.856.011

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Mobility Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	15.392.119	19.825.045	(8.435.399)	26.781.765
	Klasse A (Acc)	EUR	13.603.780	49.640.157	(7.799.293)	55.444.644
	Klasse A (Inc)	USD	564.120	395.906	(247.091)	712.935
	Klasse A (Inc)	EUR	3.253.144	5.185.678	(1.841.430)	6.597.392
	Klasse B (Acc)	USD	11.262.547	5.606.733	(2.214.444)	14.654.836
	Klasse B (Acc)	SGD	–	255.652	–	255.652
	Klasse C (Acc)	USD	105.000	4.490.567	(1.809.762)	2.785.805
	Klasse C (Acc)	EUR	8.494.708	14.487.988	(11.642.959)	11.339.737
	Klasse C (Inc)	EUR	1.083.000	31.502	(117.000)	997.502
	Klasse E (Acc)	USD	56.662.786	67.825.096	(19.278.804)	105.209.078
	Klasse E (Acc)	CHF	14.164.783	4.402.094	(3.456.006)	15.110.871
	Klasse E (Acc)	EUR	5.643.411	3.148.925	(1.203.674)	7.588.662
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	15.222.635	4.870.619	(4.105.070)	15.988.184
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	15.437.443	19.281.594	(6.573.897)	28.145.140
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	3.509.649	3.783.077	(350.631)	6.942.095
	Klasse G (Acc)	USD	5.000	135.221	–	140.221
	Klasse G (Acc)	CHF	364.270	163.505	(39.500)	488.275
	Klasse G (Acc)	EUR	13.130	22.944.323	(22.754.408)	203.045
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	424.699	(113.500)	411.199
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	–	109.519	–	109.519
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	11.880.424	19.134.025	(8.153.399)	22.861.050
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(100.000)	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	257.654	521.415	(222.636)	556.433
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	–	–	615.969
	Klasse K (Acc)	USD	8.242.207	12.566.546	(2.792.296)	18.016.457
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	2.558.128	1.018.307	(711.736)	2.864.699
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	7.565.499	10.378.286	(3.062.453)	14.881.332
	Klasse K (Acc) (Hedged)	SGD	–	2.547.367	(664.173)	1.883.194
	Klasse K (Inc)	USD	983.707	1.216.712	(184.396)	2.016.023
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	170.038	227.615	(140.614)	257.039
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	390.711	413.713	(144.093)	660.331
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	127.171	396.693	(166.008)	357.856
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	689.217	752.108	(123.980)	1.317.345
	Klasse W (Acc)	USD	45.075.993	58.000.781	(19.538.679)	83.538.095
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	383.064	616.784	(165.530)	834.318
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	32.705.461	33.743.863	(20.274.901)	46.174.423
	Sterling W (Acc)	GBP	–	202.888	–	202.888
	Klasse W (Inc)	USD	46.276	672.807	(5.019)	714.064
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	2.405	35.301	(2.405)	35.301
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker**						
	Klasse A	USD	4.753.892	3.222	(4.757.114)	–
	Klasse A	EUR	1.736.077	23.452	(1.759.529)	–
	Klasse C	USD	3.553.700	–	(3.553.700)	–
	Klasse C	EUR	206.768	–	(206.768)	–

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Small Cap Euroland Fund						
	Klasse A	EUR	2.559.604	497.383	(566.673)	2.490.314
	Klasse A	USD	119.230	62.007	(36.086)	145.151
	Klasse B	EUR	53.912	49.829	–	103.741
	Klasse C	EUR	3.830.665	1.064.634	(1.342.848)	3.552.451
	Klasse C	USD	8.702.409	5.180.810	(1.060.445)	12.822.774
	Klasse W (Acc)	EUR	6.601.948	4.139.568	(2.129.036)	8.612.480
	Sterling W (Acc)	GBP	2.842	–	(2.842)	–
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse B (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse B (Acc)	SGD	5.000	–	–	5.000
	Klasse C (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Klasse E (Acc)	USD	5.000	4.605	(4.605)	5.000
	Sterling E (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	–	–	100.000
	Klasse W (Acc)	USD	4.398.090	–	–	4.398.090
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	7.000.331	4.336.597	(4.432.807)	6.904.121
	Klasse A (Acc)	USD	533.306	344.033	(212.600)	664.739
	Klasse A (Inc)	EUR	5.049	1.232.061	(30)	1.237.080
	Klasse C (Acc)	EUR	5.001	–	(1)	5.000
	Klasse E (Acc)	EUR	85.230.803	–	(2.000)	85.228.803
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	12.383.665	2.408.524	(1.394.444)	13.397.745
	Klasse G (Acc)	EUR	2.352.825	214.270	(35.839)	2.531.256
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	494.292	276.414	(40.050)	730.656
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Acc)	EUR	25.959.593	51.005.586	(11.456.899)	65.508.280
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	30.717.378	12.122.450	(1.610.673)	41.229.155
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	(88.000)	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	2.266.756	4.232.468	(495.350)	6.003.874
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	204.908	469.032	(165.692)	508.248
	Klasse W (Inc)	EUR	5.000	110	(55)	5.055
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	269.756	364.334	(236.055)	398.035
	Klasse X (Acc)	EUR	92.606.686	–	–	92.606.686
	Klasse Z (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	USD	100.000	–	(100.000)	–
	Klasse Z (Inc)	EUR	–	5.101	(50)	5.051
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	100.000	728.573	(90.579)	737.994

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Sustainable Global Real Return Fund (EUR)						
	Klasse A (Acc)	EUR	178.775	17.276.790	(59.348)	17.396.217
	Klasse A (Inc)	EUR	5.000	13	(7)	5.006
	Klasse E (Acc)	EUR	12.954.335	23.184.578	(4.562.772)	31.576.141
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1.324.319	49.450	(40.000)	1.333.769
	Klasse E (Inc)	EUR	5.000	94	(5.094)	–
	Klasse G (Acc)	EUR	5.000	90.061	(89.688)	5.373
	Klasse W (Acc)	EUR	17.175.274	527.497	(630.741)	17.072.030
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	–	105.514	–	105.514
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	270.520	(100.000)	270.520
	Klasse W (Inc)	EUR	5.000	74	(37)	5.037
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.000	1.374	(89.806)	11.568
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	66.115.897	268.275	–	66.384.172
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund**						
	Klasse A	USD	548.341	16.025	(564.366)	–
	Klasse A	EUR	435.964	22.474	(458.438)	–
	Klasse B	USD	94.858	–	(94.858)	–
	Klasse C	USD	48.863	–	(48.863)	–
	Klasse C	EUR	583	–	(583)	–
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	Klasse A (Acc)	EUR	4.677	43.333	–	48.010
	Klasse B (Inc)	USD	5.156	95.373	(58.862)	41.667
	Klasse C (Acc)	USD	–	37.005.000	–	37.005.000
	Klasse C (Inc)	USD	908.914	3.825	(908.950)	3.789
	Klasse E (Acc)	EUR	233.288	–	(233.288)	–
	Klasse E (Inc)	USD	4.012.257	306.865	(2.985.450)	1.333.672
	Klasse E (Inc)	EUR	93.090	13.250	–	106.340
	Sterling E (Acc)	GBP	26.112.518	2.666.272	(8.381.288)	20.397.502
	Sterling E (Inc)	GBP	75.972.715	14.212.203	(16.645.516)	73.539.402
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1.194.700	642.100	(601.000)	1.235.800
	Klasse W (Acc)	USD	19.884.479	7.007.205	(2.202.528)	24.689.156
	Klasse W (Acc)	EUR	16.027.667	3.822.563	(5.046.682)	14.803.548
	Klasse W (Inc)	USD	5.575.000	3.225.000	(625.000)	8.175.000
	Sterling W (Inc)	GBP	14.160.007	1.767.538	(14.642.797)	1.284.748

2. ANTEILSKAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	Klasse A (Acc)	USD	154.164	1.511.572	(638.380)	1.027.356
	Klasse A (Inc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse A (Inc) (M)	USD	–	5.241	(120)	5.121
	Klasse C (Acc)	USD	130.071.488	28.033.544	(46.067.613)	112.037.419
	Klasse E (Acc)	USD	21.402.258	3.867.095	(227.000)	25.042.353
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	3.550.000	1.049.500	(90.000)	4.509.500
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	4.825.000	1.691.000	–	6.516.000
	Klasse E (Inc) (Hedged)	EUR	8.248.264	243.687	(121.843)	8.370.108
	Klasse G (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling G (Inc) (Hedged)	GBP	–	100.799	(90.719)	10.080
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	3.361.733	24.626.845	(6.291.619)	21.696.959
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	–	100.000	(85.328)	14.672
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(87.818)	12.182
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	167.930	569.350	(158.014)	579.266
	Klasse P (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse P (Acc) (Hedged)	AUD	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Acc) (Hedged)	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Inc)	USD	–	5.112	(56)	5.056
	Klasse P (Inc) (Hedged)	AUD	–	10.000	–	10.000
	Klasse P (Inc) (Hedged)	EUR	–	10.000	–	10.000
	Klasse W (Acc)	USD	40.308.451	138.721.862	(11.777.376)	167.252.937
	Klasse W (Acc)	EUR	5.091	56.000.475	(3.634.343)	52.371.223
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	27.244.051	7.090.572	(5.254.960)	29.079.663
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	33.024.845	179.612.227	(33.864.563)	178.772.509
	Klasse W (Inc)	USD	62.960.471	31.527.679	(72.141.697)	22.346.453
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	6.574.781	1.000.000	(574.781)	7.000.000
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	143.328.872	57.079.312	(23.953.045)	176.455.139
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	215.000	(90.000)	125.000
	Klasse X (Acc)	USD	7.976.912	–	(7.976.912)	–
	Klasse Z (Acc)	USD	–	5.000	–	5.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	–	100.000	(90.000)	10.000
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	–	598.025	(90.000)	508.025
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	–	100.000	(90.000)	10.000
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*						
	Klasse A (Acc)	EUR	–	5.000	–	5.000
	Klasse G (Acc)	EUR	–	208.615	–	208.615
	Klasse W (Acc)	EUR	–	1.088.955.974	(274.778.335)	814.177.639
	Klasse W (Inc)	EUR	–	2.505.000	–	2.505.000
	Klasse X (Acc)	EUR	–	7.349	(2.350)	4.999
	Klasse Z (Acc)	EUR	–	177.838.000	(6.284.299)	171.553.701

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

† Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

†† Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

††† 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:

Währung der	Satz	Währung der	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	0,40 % - 1,00 %
Klasse E	0,08 % - 0,55 %	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	0,16 %		

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.

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 Tage 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 (90 Tage aufgezinst) / SONIA (90 Tage aufgezinst) / SARON (90 Tage aufgezinst)	Klassen D, R, S, T und U – 15,00 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	1-Monats-EURIBOR / SOFR (90 Tage aufgezinst) / SONIA (90 Tage aufgezinst) / SARON (90 Tage aufgezinst) / TONAR (90 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 – 10,00 %
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.

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 2022 und 31. Dezember 2021 aufgeführt, aufgeschlüsselt nach Anteilsklassen der Fonds:

Fonds	Währung der	Währung	Basiswährung des Fonds	Performancegebühr	Performancegebühr
				Basiswährung 31. Dezember 2022	Basiswährung 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			Gesamt	17.648	160
	Klasse D (Acc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse R	EUR	EUR	–	–
	Klasse R (Hedged)	USD	EUR	436	160
	Klasse R (Inc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse S	EUR	EUR	–	–
	Klasse S (Inc)	EUR	EUR	–	–
	Klasse T (Hedged)	CHF	EUR	–	–
	Klasse T (Hedged)	USD	EUR	–	–
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	17.212	–
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			Gesamt	4.543	4.569
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	CHF	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse R (Hedged)	USD	GBP	1.076	425
	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	1.050
	Klasse U (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Klasse U (Hedged)	USD	GBP	2.885	3.093
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	GBP	–	–
	Sterling U (Acc)	GBP	GBP	42	1
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			Gesamt	1	92.174
	Klasse F (Acc)	EUR	EUR	–	6.709
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	EUR	–	1.993
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	EUR	–	10.501
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	1	33.373
	Klasse R (Acc)	EUR	EUR	–	69
	Klasse U (Acc)	EUR	EUR	–	34.689
	Klasse U (Acc) (Hedged)	CHF	EUR	–	3.016
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	EUR	–	1.739
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	EUR	–	85
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund			Gesamt	–	–
	Klasse S (Acc)	USD	EUR	–	–
	Klasse S (Acc) 1	USD	EUR	–	–

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 Anteilsinhabern mitgeteilt. Zum Datum dieses Abschlusses gelten die folgenden Ausgabenobergrenzen:

Fonds	Vereinbarte Grenze für die Gesamtkostenquote („TER“)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	TER-Grenze der jährlichen Verwaltungsgebühr („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 (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum, dem 18. November 2021)	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte ⁽¹⁾
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 26. Februar 2021)	TER-Grenze der JVG plus 22 Basispunkte ⁽²⁾
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte
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 Total Return Fund	TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte ⁽⁷⁾
BNY Mellon Future Earth Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Future Food Fund** (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Future Life Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Global Credit Fund ⁽⁸⁾	
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 Multi-Asset Income Fund (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 26. März 2021)	TER-Grenze der JVG plus 12 Basispunkte
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte ⁽⁹⁾
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte ⁽¹⁰⁾
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

6. AUSGABENBEREICH FORTS.

Fonds	Vereinbarte TER-Grenze
BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker (mit Höchstgrenze ab dem 24. Juni 2020 bis zum Schließungstermin am 15. Januar 2021)	TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte ⁽¹¹⁾
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. Dynamic Value Fund* (mit Höchstgrenze ab dem 5. November 2020 bis zum Schließungstermin am 5. März 2021)	TER-Grenze der JVG plus 24 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 Euro Corporate Bond Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum, dem 27. März 2021)	TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte ⁽¹²⁾
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum, dem 10. Januar 2022)	TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte ⁽¹³⁾

⁽¹⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen EUR X (Acc) (Hedged), Sterling X (Acc) und USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6,3 Basispunkte.

⁽²⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte.

⁽³⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

⁽⁴⁾ In Bezug auf die Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) wurde die TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte mit Wirkung vom 1. Oktober 2021 in eine TER-Grenze ohne JVG plus 8 Basispunkte geändert. Dies führte zu einem Managementgebührenverzicht für die Klasse Sterling L (Acc) (Hedged) in Höhe von 15.024 USD für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (4.147 USD für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 31. Dezember 2021).

⁽⁵⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD X (Acc), USD X (Inc), Sterling X (Acc) (Hedged) und Sterling X (Inc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte sowie EUR N (Acc) (Hedged), USD N (Acc) und USD N (Inc) (M) mit einer TER-Grenze der JVG.

⁽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 der JVG plus 5,8 Basispunkte.

⁽⁷⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

⁽⁸⁾ Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte und Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 7 Basispunkte.

⁽⁹⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklassen Sterling Y (Acc) (Hedged) und USD Y (Acc).

⁽¹⁰⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged).

⁽¹¹⁾ 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.

⁽¹²⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte.

⁽¹³⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen EUR X (Acc), Sterling X (Acc) (Hedged) und USD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,5 Basispunkte.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Die Gesamtkosten, welche die Obergrenze überschreiten, die der Gesellschaft während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 in Rechnung gestellt wurden, betragen 1.827.533 USD (31. Dezember 2021: 1.595.729 USD).

7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN

Die in der Gesamtergebnisrechnung enthaltenen betrieblichen Aufwendungen beinhalten:

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Aufwendungen	USD	USD
Verwaltungsgebühr	10.394.895	12.290.441
Prüfungsgebühr	705.374	835.924
Verwaltungsrats honorare	96.936	108.786
Sonstige Aufwendungen	3.326.878	2.862.284
Betriebliche Aufwendungen insgesamt	14.524.083	16.097.435

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 2022	31. Dezember 2021
	USD	USD
Abschlussprüfung des Jahresabschlusses (Irland)	516.780	586.172
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Vereinigtes Königreich)	92.775	160.690
Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Österreich)	95.819	89.062
Gesamt	705.374	835.924

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 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund>	EUR	156.092	135.107
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	742.994	712.251
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund>	EUR	1.656.844	992.374
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	13.998	62.558
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	USD	72.000	136.887
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	41.488	70.984
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	130.397	111.398
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	37.523	9.459
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	k. A.	2.327
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	39.252	34.261
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund>	USD	623	k. A.
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund>	USD	k. A.	652
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund>	USD	3.051	31.657
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund>	USD	2.079	3
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund>	USD	k. A.	5.301
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund>	USD	715	1.029
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund>	USD	218	k. A.
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund>	USD	244	101
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund>	USD	5.570	2.434
BNY Mellon Euroland Bond Fund>	EUR	6.030	40.423
BNY Mellon European Credit Fund>	EUR	8.386	4.177
BNY Mellon Future Earth Fund	USD	1.364	3.028
BNY Mellon Future Food Fund**	USD	583	2.579
BNY Mellon Future Life Fund	USD	1.498	2.221
BNY Mellon Global Bond Fund>	USD	17.875	18.499
BNY Mellon Global Credit Fund>	USD	6.012	42.510
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund>	USD	48.129	38.020
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	78.429	175.682
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	312.505	180.830
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	504.902	605.809
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund>	USD	k. A.	84
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	428.544	363.151
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	21.691	23.041
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	EUR	k. A.	11.011
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	16.829	17.639

8. TRANSAKTIONSKOSTEN Forts.

Fonds	Basiswahrung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	1.926.676	2.196.358
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)>	GBP	46.829	41.911
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)>	USD	308.530	298.791
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund>	USD	1.575	3.234
BNY Mellon Global Unconstrained Fund>	USD	6.279	14.326
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	10.095.068	8.632.704
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	166.522	489.111
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	444.735	631.663
BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker	USD	k. A.	1.692
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	75.987	95.927
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	19.962	2.982
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund>	EUR	30.185	16.808
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	USD	11.931	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)>	EUR	112.625	80.897
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund>	USD	21.655	5.369
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	k. A.	1.556
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	308.694	170.009
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	23.043	13.741
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	EUR	k. A.	k. A.

* Siehe Erluterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erluterung 20 zum Abschluss.

› Die Transaktionskosten fur den Kauf und Verkauf von Anleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie konnen jedoch weder zweckmaig noch zuverlassig zusammengestellt noch getrennt uberpruft oder offen gelegt werden.

9. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE

Die Barmittel der Gesellschaft sind bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, hinterlegt und werden von den Kontrahenten (Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse AG, Goldman Sachs, HSBC Bank plc, JPMorgan Chase Bank, Lloyds Bank plc, Morgan Stanley, Royal Bank of Canada, Royal Bank of Scotland, State Street Bank, Toronto Dominion Bank und UBS AG) in Bezug auf die erforderlichen Sicherheiten und Margenanforderungen gehalten. Barguthaben umfassen taglich in kurzfristige Anlageinstrumente investierte Barmittel.

Kassakontovereinbarungen wurden fur die Fonds infolge neuer Anforderungen fur die Sammelkonten fur Zeichnungs- und Rucknahmebetrage gema dem (Supervision and Enforcement) Act 2013 der (Section 48(i)) Investor Money Regulations 2015 fur Fonds-Dienstleister (Fund Service Providers) („Vorschriften fur Anlegergelder“ – „Investor Money Regulations“) getroffen.

Diese Kassakonten, die bei der globalen Unterdepotbank fur den Einzug von Zeichnungen und Rucknahmezahlungen sowie fur Ausschuttungen der Fonds gehalten werden, gelten als Vermogenswerte der Fonds. Die Guthaben auf diesen Kassakonten am Samstag, 31. Dezember 2022 und am 31. Dezember 2021 werden in Bezug auf den jeweiligen Fonds, dem sie zustehen, als unwesentlich betrachtet, mit Ausnahme von Barmittelguthaben in Hohe von 23.296 EUR (31. Dezember 2021: 21.942 EUR) fur den BNY Mellon Pan European Fund (geschlossen am 9. Marz 2017) und in Hohe von 33.925 USD (31. Dezember 2021: 36.082 USD) fur den BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker (geschlossen am 15. Januar 2021).

10. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und gangiger Praxis ist die Gesellschaft ein Anlageorganismus im Sinne der Definition in Section 739B des Tax Consolidation Acts von 1997 in der jeweils gultigen Fassung. Auf dieser Grundlage unterliegen ihre Ertrage und Kapitalgewinne nicht der irischen Steuer.

Allerdings kann eine irische Steuer erhoben werden, wenn ein „steuerpflichtiges Ereignis“ eintritt. Zu den steuerpflichtigen Ereignissen gehoren alle Ausschuttungen an Anteilsinhaber oder Einlosungen, Rucknahmen, Annullierungen oder Ubertragungen 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 Anteilshabern beziehen, nicht steuerpflichtig:

- (a) Anteilshaber, 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 Anteilshabern 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 2022 wurden für den BNY Mellon Asian Opportunities Fund* Kapitalertragsteuerforderungen in Höhe von 8.101 USD (31. Dezember 2021: offene Kapitalertragsteuern in Höhe von 311.766 USD), offene Kapitalertragsteuern in Höhe von 804.930 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2021: 1.041.327 USD), offene Kapitalertragsteuern in Höhe von null USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund* (31. Dezember 2021: 185.048 USD) und offene Kapitalertragsteuern in Höhe von 4 USD für den BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund* (31. Dezember 2021: null USD) in der Bilanz ausgewiesen. Für das abgelaufene Geschäftsjahr wurde die Auflösung einer Kapitalertragsteuerrückstellung von 319.867 USD für den BNY Mellon Asian Opportunities Fund* (31. Dezember 2021: 149.689 USD), ein Kapitalertragsteueraufwand von 332.193 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2021: 2.418.087 USD) und die Auflösung einer Kapitalertragsteuerrückstellung von 185.048 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund* (31. Dezember 2021: 111.396 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* und **, Walter Scott & Partners Limited, Newton Investment Management North America LLC* und **, ARX Investimentos Ltda, Insight Investment Management (Global) Limited*, Alcentra NY, LLC, BNY Mellon Asset Management Japan Limited** und Alcentra Limited, Insight North America LLC), die Unteranlageverwalter (Insight North America LLC and Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD, Newton Investment Management Limited* und ** und Newton Investment Management North America LLC* und **), der delegierte Anlageverwalter (Insight North America LLC*) sowie 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 „Verwahrstellengebühren“, der Erläuterung 6 „Ausgabenobergrenze“ und der Erläuterung 7 „Betriebliche Aufwendungen“ zum Abschluss vollständig ausgewiesen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind der Gesellschaft nahestehende Personen.

Greg Brisk, Gerald Rehn** und Mark Flaherty* sind auch Verwaltungsratsmitglieder der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die Verwaltungsgesellschaft).

Greg Brisk und Gerald Rehn** sind ferner Verwaltungsratsmitglieder der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited und Caylie Stallard* ist bei dieser Gesellschaft angestellt.

Greg Brisk, Gerald Rehn**, Caylie Stallard* und Mark Flaherty* haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Die im Geschäftsjahr angefallenen Honorare der Verwaltungsratsmitglieder werden in Erläuterung 7 zum Abschluss offen gelegt.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Greg Brisk ist zudem ein Verwaltungsratsmitglied bei den folgenden Anlageverwaltern der Fonds:

- Alcentra Limited,
- Alcentra NY, LLC,
- Newton Investment Management Limited,
- Insight Investment Management (Global) Limited und
- Insight North America LLC

Greg Brisk ist außerdem Verwaltungsratsmitglied der Insight Liquidity Funds Plc, in die einige Fonds der Gesellschaft investiert haben, sowie der BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited, einem der Gesellschaft nahestehenden Unternehmen. BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited hielt am 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 ein erhebliches wirtschaftliches Eigentum an den Anteilsklassen der nachstehend aufgeführten Fonds.

Name des Anlegers Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited			
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	10.435.963	21.827.261
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	20.468	4.474.114
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	23.339.106	24.751.005
BNY Mellon Future Earth Fund	USD	1.683.423	2.164.937
BNY Mellon Future Food Fund**	USD	1.926.984	2.222.200
BNY Mellon Future Life Fund	USD	2.102.066	2.351.576
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	23.204.920	4.976.550
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund	USD	10.693.015	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	EUR	22.873	17.298.255
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	EUR	25.869.822	k. A.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 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 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	30.778.339	38.545.235
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	GBP	12.958.011	12.006.736
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	EUR	9.456.426	6.876.198
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	17.750.000	28.749.161
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	3.737.054	4.014.000
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	EUR	2.165.146	2.426.564
BNY Mellon European Credit Fund				
	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	EUR	392.094	432.807
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	823.036	1.040.687
BNY Mellon Global Credit Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	8.241.218	850.000

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Fonds	Organismus für gemeinsame Anlagen (OGA)	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	5.104.833	6.620.068
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				
	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	USD	21.060.000	73.536.026

Im Geschäftsjahr wurden von den Anlageverwaltern der Verwahrstelle und den Anlageverwaltern nahestehenden Unternehmen zur Ausführung der Anlage- und Devisengeschäfte sowie zur Annahme von Einlagen im Auftrag der Anlageverwalter ausgewählt. The Bank of New York Mellon, New York, und The Bank of New York Mellon, London, waren Kontrahenten bei am Ende des Geschäftsjahres offenen Devisenterminkontrakten, die in der Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesen sind. Die Kontrahenten wurden von den Anlageverwaltern ausgewählt, und die Bedingungen dieser Geschäfte wurden von den Anlageverwaltern mit den entsprechenden Unternehmen ausgehandelt.

Die Verwaltungsgesellschaft besitzt 38.092 (31. Dezember 2021: 38,092) Zeichneranteile, wie in Erläuterung 2 des Abschlusses angegeben. Es gab keine oberste beherrschende Partei der Gesellschaft in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021.

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 unternehmensspezifische anlagebezogene Recherchen und die aktive Orderverwaltung durch Makler. 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 2022	31. Dezember 2021
Argentinischer Peso	176,7465	102,6909
Australischer Dollar	1,4688	1,3745
Brasilianischer Real	5,2798	5,5700
Kanadischer Dollar	1,3540	1,2650
Chilenischer Peso	848,2500	852,0000
Chinesischer Yuan	6,9207	6,3575
Kolumbianischer Peso	4.848,0000	4.066,0000
Tschechische Krone	22,5989	21,8494
Dänische Krone	6,9468	6,5321
Ägyptisches Pfund	24,7550	15,7100
Euro	0,9342	0,8783
Hongkong-Dollar	7,8055	7,7976
Ungarischer Forint	372,9975	324,4621
Indische Rupie	82,7300	74,3357
Indonesische Rupiah	15.567,5000	14.252,5000
Israelischer Schekel	3,5151	3,1090
Japanischer Yen	131,2400	115,0300

13. WECHSELKURSE Forts.

Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Kasachischer Tenge [^]	k. A.	434,8050
Koreanischer Won	1.264,5000	1.188,7500
Malaysischer Ringgit	4,4050	4,1660
Mexikanischer Peso	19,4865	20,4755
Neuseeländischer Dollar	1,5751	1,4601
Norwegische Krone	9,7968	8,8066
Peruanischer neuer Sol	3,7968	3,9915
Philippinischer Peso	55,7275	50,9925
Polnischer Zloty	4,3814	4,0292
Rumänischer Leu	4,6163	4,3468
Russischer Rubel	73,7500	75,0888
Singapur-Dollar	1,3394	1,3476
Südafrikanischer Rand	16,9913	15,9350
Pfund Sterling	0,8272	0,7388
Schwedische Krone	10,4349	9,0362
Schweizer Franken	0,9247	0,9112
Taiwan-Dollar	30,7355	27,6670
Thailändischer Baht	34,6350	33,4050
Türkische Lira	18,7023	13,2290
Uruguayischer Peso	39,9750	44,7000

[^] 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 2022		31. Dezember 2021	
	Schlusskurs	Mittelkurs	Schlusskurs	Mittelkurs
Euro	0,9342	0,9491	0,8783	0,8457
Japanischer Yen	131,2400	130,5648	115,0300	109,8126
Pfund Sterling	0,8272	0,8084	0,7388	0,7271

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Die Gesellschaft und jeder Fonds können für Anlagezwecke in derivative Finanzinstrumente („FDI“) investieren, sofern dies im jeweiligen Nachtrag zum Prospekt angegeben ist. Ferner kann jeder Fonds gemäß den von der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen Techniken und Instrumente für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung oder zur Absicherung gegen Wechselkursrisiken einsetzen.

Zu solchen Anlagetechniken und -instrumenten zählen u. a. Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Optionsscheine, Wertpapierleihvereinbarungen, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, Devisenterminkontrakte und „When issued“- und/oder „Delayed Delivery“-Wertpapiere.

Geschäfte mit dem Vermögen eines Fonds dürfen für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen werden, um eines der folgenden Ziele zu erreichen: eine Risikominderung, eine Kostensenkung ohne Erhöhung oder mit minimaler Erhöhung des Risikos oder eine Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder Einkommens ohne bzw. mit annehmbar geringem Risikoniveau (im Verhältnis zum erwarteten Ertrag). Die Gesellschaft legt derzeit in die in der jeweiligen Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesenen Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Devisenterminkontrakte und Genussscheine (P-Notes) an. Einzelheiten zu den am Ende des Geschäftsjahres offenen Transaktionen enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände.

Die Gesellschaft hat mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Verwahrstelle eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen. Die Erträge aus der Wertpapierleihe werden zurzeit im Verhältnis 81 % zu 19 % zwischen der Gesellschaft und The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, aufgeteilt.

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Wertpapierleihgeschäfte und die damit verbundenen Sicherheiten werden in Übereinstimmung mit den dreiseitigen (Tri-Party) und bilateralen Vereinbarungen abgewickelt und abgerechnet.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 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 Fund**	USD	19.159	(3.640)	15.519
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
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 U.S. Equity Income Fund	USD	13.565	(2.577)	10.988

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

[^] Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Die Gesellschaft vereinbarte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihgeschäften:

Fonds	Basiswährung	Bruttoerträge	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden)	Nettoerträge für die Gesellschaft [†]
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	66.986	(13.105)	53.881
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	5.491	(1.071)	4.421
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	8.938	(1.767)	7.171
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	839	(167)	672
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	USD	12	(2)	10
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	362.066	(69.391)	292.675
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	210	(42)	168
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	29.903	(5.888)	24.015
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	8.413	(1.615)	6.798
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	226	(44)	182
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	375.064	(72.813)	302.252
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	88.208	(17.076)	71.131
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	253.964	(48.767)	205.197
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	5.631	(1.099)	4.532
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	4.108	(783)	3.325
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	1.515	(295)	1.221
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	25.041	(4.826)	20.215
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	51.528	(10.065)	41.463
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	4.779	(925)	3.854
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	152.640	(29.874)	122.766
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	145.036	(28.413)	116.623
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	50.768	(9.923)	40.845
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	464	(93)	371
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	15.194	(3.020)	12.175
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	102.949	(20.424)	82.525
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	41.981	(8.136)	33.846
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	83.968	(16.183)	67.785
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	967	(192)	775
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	EUR	72	(14)	58
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	1.414	(280)	1.134
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	178.566	(34.989)	143.577
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	1.511	(301)	1.210
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	8.947	(1.784)	7.164
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	406.218	(78.793)	327.424
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.165	(427)	1.738
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	16.330.941	(3.207.779)	13.123.162
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	80.844	(16.073)	64.771
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	325.358	(63.887)	261.471
BNY Mellon S&P 500 [®] Index Tracker	USD	65	(13)	52
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	30.604	(5.980)	24.625
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	5	(1)	4
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	23.589	(4.589)	19.001

[†] Bis zum 30. Juni 2021 wurden die Erträge aus der Wertpapierleihe im Verhältnis 80 % zu 20 % zwischen der Gesellschaft und The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, aufgeteilt. Ab dem 1. Juli 2021 änderte sich das Aufteilungsverhältnis in 81 % zu 19 %. Die obigen Zahlen sind daher eine Summe der beiden aufgeteilten Anteile für das Geschäftsjahr.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt dar:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entlie- henen Wert- papiere am 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2022	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				EUR	EUR	%
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD Sovereign Debt - Supranationals (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 Sovereign Debt - Supranationals (Clearstream)	279.214	286.362	102,56 %
				9.018.528	9.333.862	103,50 %
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	176.644	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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 %
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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 Sovereign Debt - Supranationals (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 %
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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 %
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-Schuldtitle (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 Sovereign Debt - Supranationals (Clearstream)	2.981.580	3.044.674	102,12 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Government Debt - Supranationals (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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.			EUR	EUR	%
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 Sovereign Debt - Supranationals (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 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Euroclear Triparty - UK Gilts	303.413	318.790	105,07 %
			26.262.142	27.078.651	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-Schuldtitle (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-Schuldtitle (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 Sovereign Debt - Supranationals (Clearstream)	305.847	313.675	102,56 %
			3.495.133	3.601.066	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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.087.753	2.130.949	102,07 %
UBS AG	Schweiz	OECD Sovereign Debt - Supranationals (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 %
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 Sovereign Debt - Supranationals (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 Sovereign Debt - Supranationals (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 Fund**			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities PLC	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.665.586	5.136.561	110,09 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Equity Fund Forts.			USD	USD	%
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 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 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.200.851	1.225.572	102,06 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	OECD Sovereign Debt - Supranationals (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 Sovereign Debt - Supranationals (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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 %
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	196.190.070	105,68 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 Sovereign Debt - Supranationals (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	Government Debt - Supranationals (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 %
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 Sovereign Debt - Supranationals (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 %

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 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
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 %
			642.605.374	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 %
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 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2022	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.			EUR	EUR	%
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	18.923	19.879	105,06 %
			6.556.860	7.099.929	108,28 %
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.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellten sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt dar:

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			EUR	EUR	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	36.889.140	40.578.423	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.442.491	2.499.672	102,34 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.786.714	4.175.188	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	468.405	516.670	110,30 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.545.827	1.576.961	102,01 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	786.667	851.860	108,29 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	300.079	315.130	105,02 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.056.393	1.165.800	110,36 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	829.741	846.399	102,01 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	384.177	391.936	102,02 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.			EUR	EUR	%
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	375.150	393.887	104,99 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	100.026	102.045	102,02 %
			48.964.810	53.413.970	109,09 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			GBP	GBP	%
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	224.919	249.430	110,90 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	92.532	97.178	105,02 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	74.793	85.449	114,25 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Aktienindizes (TriParty)	73.101	80.611	110,27 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	136	149	109,78 %
			465.481	512.816	110,17 %
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	1.044.909	1.193.781	114,25 %
			1.044.909	1.193.781	114,25 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	8.999.820	9.899.892	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	167.437	176.096	105,17 %
MUFG Securities EMEA plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	4.161.413	4.578.147	110,01 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.212.603	2.260.050	102,14 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	510.247	520.521	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	208.342	218.800	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	188.622	207.634	110,08 %
			16.448.484	17.861.140	108,59 %
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			USD	USD	%
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.688.150	2.748.565	102,25 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	207.512	217.284	104,71 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	184.033	187.901	102,10 %
			3.079.695	3.153.750	102,40 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	74.223	75.718	102,01 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	69.253	70.809	102,25 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	12.395	12.978	104,70 %
			155.871	159.505	102,33 %
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	17.579.746	17.956.724	102,14 %
Goldman Sachs & Company	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.928.662	2.747.408	142,45 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	516.331	540.644	104,71 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	57.401	58.608	102,10 %
			20.082.140	21.303.384	106,08 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	26.073.885	26.621.962	102,10 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	4.735.739	4.842.174	102,25 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.347.247	2.397.581	102,14 %
J.P. Morgan Securities LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.279.233	1.310.047	102,41 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.102.469	1.125.639	102,10 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	896.594	938.812	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	212.856	223.504	105,00 %
			36.648.023	37.459.719	102,21 %
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	8.632.407	9.111.422	105,55 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.427.316	1.457.318	102,10 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	3.667.277	3.851.527	105,02 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.140.779	2.252.912	105,24 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.587.499	3.734.108	104,09 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.			USD	USD	%
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.295.353	3.366.018	102,14 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.184.458	3.334.406	104,71 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.432.594	2.670.630	109,79 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	1.195.552	1.255.519	105,02 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	866.822	910.934	105,09 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.775.664	1.864.801	105,02 %
Nomura Securities International Inc.	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.768.492	1.948.493	110,18 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	1.097.531	1.152.554	105,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	494.400	545.120	110,26 %
Morgan Stanley & Co. LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.324.163	1.356.032	102,41 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.234.215	1.261.953	102,25 %
BNP Paribas Securities Corp	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	617.920	630.907	102,10 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	532.452	555.704	104,37 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	194.816	204.613	105,03 %
Deutsche Bank Securities Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	181.781	219.907	120,97 %
			39.651.491	41.684.878	105,13 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			USD	USD	%
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	440.952	463.142	105,03 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	269.041	282.501	105,00 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	624.501	689.178	110,36 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	412.817	436.343	105,70 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	194.949	199.046	102,10 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	229.038	240.392	104,96 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Forts.			USD	USD	%
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	209.409	214.116	102,25 %
			2.380.707	2.524.718	106,05 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	7.389.531	8.147.615	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	799.832	882.247	110,30 %
			8.189.363	9.029.862	110,26 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.157.118	1.275.826	110,26 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	253.198	265.120	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	226.465	237.794	105,00 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	206.435	216.807	105,02 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	162.874	166.535	102,25 %
			2.006.090	2.162.082	107,78 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			USD	USD	%
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.305.556	6.952.436	110,26 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	1.191.157	1.313.893	110,30 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	1.194.054	1.219.153	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	913.469	965.527	105,70 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	244.058	256.254	105,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.595.496	1.653.563	103,64 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	597.088	626.910	104,99 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	511.058	535.122	104,71 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	483.642	509.053	105,25 %
			13.035.578	14.031.911	107,64 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Euroland Bond Fund			EUR	EUR	%
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	10.249.868	11.274.888	110,00 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	4.136.633	4.219.585	102,01 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	6.781.625	7.222.548	106,50 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	5.712.167	5.827.153	102,01 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	522.484	532.934	102,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.305.772	3.371.902	102,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.164.510	3.250.351	102,71 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.989.878	2.151.907	108,14 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.041.795	1.062.749	102,01 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	740.329	755.192	102,01 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.211.714	1.262.165	104,16 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	351.397	358.475	102,01 %
			39.208.171	41.289.850	105,31 %
BNY Mellon European Credit Fund			EUR	EUR	%
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	1.496.485	1.526.528	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	458.781	468.022	102,01 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	317.164	323.509	102,00 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	110.369	112.598	102,02 %
			2.382.798	2.430.658	102,01 %
BNY Mellon Global Bond Fund			USD	USD	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	17.591.293	19.350.454	110,00 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	15.545.993	16.316.683	104,96 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	57.497	60.369	105,00 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Bond Fund Forts.			USD	USD	%
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	9.963.920	10.306.625	103,44 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	4.040.190	4.192.556	103,77 %
Nomura International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.876.686	5.994.238	102,00 %
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	3.088.783	3.397.669	110,00 %
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	3.018.871	3.161.022	104,71 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	646.844	659.815	102,01 %
RBC Dominion Securities Inc	Kanada	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	229.140	252.057	110,00 %
			60.059.217	63.691.488	106,05 %
BNY Mellon Global Credit Fund			USD	USD	%
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	10.177.332	11.231.366	110,36 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	8.962.298	9.176.713	102,39 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Euroclear Triparty - UK Gilts	5.598.780	5.877.031	104,97 %
Toronto Dominion Bank	Kanada	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	2.956.651	3.015.592	101,99 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.056.444	5.188.377	102,61 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Britische Gilts (Euroclear TriParty)	542.611	553.343	101,98 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	4.121.519	4.533.679	110,00 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	2.757.014	3.032.463	109,99 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	480.066	499.637	104,08 %
			40.652.715	43.108.201	106,04 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund			USD	USD	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes	4.405.934	4.846.536	110,00 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.593.853	2.661.106	102,59 %
			6.999.787	7.507.642	107,26 %
BNY Mellon Global Equity Income Fund			USD	USD	%
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.884.007	2.945.851	102,14 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	488.471	512.992	105,02 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts.			USD	USD	%
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	221.068	243.350	110,08 %
			3.593.546	3.702.193	103,02 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	10.079.488	10.291.360	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.232.876	3.301.726	102,13 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	1.089.221	1.111.382	102,03 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	2.386.962	2.440.609	102,25 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	2.071.791	2.272.716	109,70 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	919.135	941.749	102,46 %
Deutsche Bank AG	Deutschland	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty)	905.812	940.680	103,85 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	695.413	730.293	105,02 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	652.114	665.159	102,00 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	455.311	464.482	102,01 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	424.663	445.981	105,02 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	408.068	416.818	102,14 %
Goldman Sachs & Company	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	196.684	280.179	142,45 %
			23.517.538	24.303.134	103,34 %
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			USD	USD	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	6.010.532	6.866.877	114,25 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	5.597.278	6.082.701	108,67 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.665.810	2.799.923	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	2.439.775	2.683.822	110,00 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	56.337	62.015	110,08 %
			16.769.732	18.495.338	110,29 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)			EUR	EUR	%
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	292.837	322.352	110,08 %
			292.837	322.352	110,08 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			GBP	GBP	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	165.980	169.468	102,10 %
			165.980	169.468	102,10 %
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund			USD	USD	%
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	23.258.138	23.911.718	102,81 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	9.275.601	9.470.576	102,10 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	8.218.722	8.548.268	104,01 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	19.770.754	21.739.880	109,96 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	13.716.231	13.992.499	102,01 %
UBS AG	Schweiz	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	2.328.459	2.561.092	109,99 %
BNP Paribas	Frankreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	6.244.981	6.567.820	105,17 %
BNP Paribas	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.835.752	5.953.600	102,02 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	5.282.985	5.496.633	104,04 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty)	348.913	363.138	104,08 %
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	3.811.447	3.908.233	102,54 %
Societe Generale	Frankreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	1.921.055	2.031.444	105,75 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	505.377	515.486	102,00 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	348.521	356.354	102,25 %
			100.866.936	105.416.741	104,51 %
BNY Mellon Global Unconstrained Fund			USD	USD	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty)	637.901	669.524	104,96 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	101.704	106.783	104,99 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts.			USD	USD	%
Societe Generale	Frankreich	Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI	431.728	474.902	110,00 %
			1.171.333	1.251.209	106,82 %
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			JPY	JPY	%
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	181.521.941	207.384.136	114,25 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	165.890.975	174.218.687	105,02 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	42.246.838	45.573.621	107,87 %
J.P. Morgan Securities plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	33.637.878	37.250.970	110,74 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	31.302.769	34.437.681	110,01 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	10.451.626	11.505.071	110,08 %
Macquarie Bank Limited	Australien	Aktienindizes (TriParty)	115.835	135.275	116,78 %
			465.167.861	510.505.441	109,75 %
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund			EUR	EUR	%
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	275.321	289.724	105,23 %
			275.321	289.724	105,23 %
BNY Mellon Mobility Innovation Fund			USD	USD	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	19.180.758	21.101.182	110,01 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	2.518.965	2.877.852	114,25 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.302.408	1.415.359	108,67 %
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.467.260	1.540.915	105,02 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	264.890	291.589	110,08 %
			24.734.281	27.226.897	110,08 %
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			EUR	EUR	%
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Aktienindizes (TriParty)	2.753.008	3.161.291	114,83 %
BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	G10-Schuldtitel (TriParty)	829.319	872.981	105,26 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	G10-Schuldtitel (TriParty)	2.307.353	2.498.570	108,29 %
Goldman Sachs International	Vereinigte Staaten von Amerika	Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (TriParty)	218.051	228.988	105,02 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	1.152.562	1.252.517	108,67 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	29.267	33.437	114,25 %
The Bank of Nova Scotia	Kanada	Aktienindizes (TriParty)	1.157.691	1.274.375	110,08 %
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	1.062.033	1.177.771	110,90 %

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Fonds Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021	Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts.			EUR	EUR	%
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	183.226	192.443	105,03 %
Citigroup Global Markets Limited	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	870.702	957.798	110,00 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	566.851	632.832	111,64 %
Societe Generale	Frankreich	Aktienindizes (TriParty)	513.096	566.078	110,33 %
			11.643.158	12.849.081	110,36 %
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD	USD	%
Citigroup Global Markets Inc	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	5.743.017	5.928.339	103,23 %
UBS AG	Schweiz	G10-Schuldtitel (TriParty)	4.270.627	4.640.997	108,67 %
UBS AG	Schweiz	Aktienindizes (TriParty)	1.345.513	1.537.213	114,25 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	Aktienindizes (TriParty)	3.381.480	3.775.085	111,64 %
HSBC Bank plc	Vereinigtes Königreich	G10-Schuldtitel (TriParty)	466.347	490.743	105,23 %
Barclays Capital Inc	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	527.012	538.313	102,14 %
Credit Suisse Securities (USA) LLC	Vereinigte Staaten von Amerika	US-Staatsanleihen (Bilateral)	101.132	103.405	102,25 %
Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	US-Staatsanleihen (Bilateral)	9.938	10.147	102,10 %
			15.845.066	17.024.242	107,44 %

15. NETTOINVENTARWERT

Der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse einlösbarer, partizipierender Anteile wird errechnet, indem das Nettovermögen der Anteilsklasse durch die Anzahl der einlösbaren, partizipierenden Anteile geteilt wird, die zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf sind.

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Der veröffentlichte Nettoinventarwert jeder Klasse einlösbarer, partizipierender Anteile beträgt wie folgt:

Fonds	Währung der	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	335.180.316	420.833.229	420.597.176
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse C	EUR	100,3728	99,4418	99,9810
	Klasse C (Inc)	EUR	–	–	94,1383
	Klasse R	EUR	97,9307	97,3616	98,2325
	Klasse R (Hedged)	USD	109,5743	107,0876	107,2566
	Klasse R (Inc)	EUR	94,3555	94,0972	95,0959
	Klasse S	EUR	106,0202	104,8799	105,2903
	Klasse T (Hedged)	CHF	94,4316	93,8644	94,4961
	Klasse T (Hedged)	USD	121,2323	118,0047	117,6139
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	115,0831	112,1818	112,0080
	Klasse W (Acc)	EUR	95,5638	94,7722	95,3816
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	–	103,5767	103,4283
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	102,7934	100,4564	100,5486
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	96,0752	96,4175
	Klasse X	EUR	114,1825	112,3488	112,1810
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	123,6103	119,8551	119,0334
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
Summe Nettovermögen		GBP	139.786.504	123.705.871	241.339.578
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse D (Acc) (Hedged)	EUR	0,9452	0,9387	0,9205
	Klasse R (Hedged)	CHF	0,8845	0,8867	0,8758
	Klasse R (Hedged)	EUR	1,0573	1,0555	1,0402
	Klasse R (Hedged)	USD	1,0955	1,0745	1,0506
	Klasse R (Inc) (Hedged)	EUR	0,9216	0,9199	0,9066
	Sterling R (Acc)	GBP	1,1620	1,1419	1,1177
	Sterling S (Acc)	GBP	1,2317	1,2044	1,1730
	Klasse T (Hedged)	EUR	1,1195	1,1119	1,0903
	Klasse T (Hedged)	USD	1,1452	1,1187	1,0907
	Klasse U (Hedged)	EUR	1,0000	0,9916	0,9709
	Klasse U (Hedged)	USD	1,1350	1,1077	1,0786
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	0,9712	0,9601	0,9400
	Sterling U (Acc)	GBP	1,2469	1,2177	1,1842
	Sterling X (Acc)	GBP	1,4340	1,3874	1,3369

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	113.142.193	95.148.164	33.223.020
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse F (Acc)	EUR	0,9895	1,0308	1,0218
	Klasse F (Acc) (Hedged)	CHF	0,9640	1,0102	–
	Klasse F (Acc) (Hedged)	USD	1,0969	1,1225	1,1040
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	1,0790	1,1083	1,0923
	Klasse R (Acc)	EUR	0,9557	1,0071	–
	Klasse U (Acc)	EUR	1,0539	1,1024	1,0925
	Klasse U (Acc) (Hedged)	CHF	0,9589	1,0078	–
	Klasse U (Acc) (Hedged)	USD	1,0782	1,1074	1,0911
	Sterling U (Acc) (Hedged)	GBP	0,9741	1,0046	–
	Klasse X (Acc)	EUR	1,1025	1,1442	1,1231
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9792	1,0019	–
BNY Mellon Asian Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	18.778.990	14.979.746	36.440.997
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,4017	1,5058	1,3413
	Klasse A (Inc)	USD	0,8157	0,9637	–
	Klasse A (Inc)	EUR	1,0684	1,1907	1,0963
	Klasse B (Acc)	USD	1,1371	1,2888	1,2390
	Klasse C (Acc)	USD	1,2389	1,3974	1,3367
	Klasse W (Acc)	EUR	1,0178	1,0801	–
	Klasse W (Inc)	EUR	1,2031	1,3241	1,2041
	Klasse W (Inc)	USD	0,9355	1,0915	1,0761
	Sterling W (Inc)	GBP	1,3120	1,3676	1,3314
BNY Mellon Asian Opportunities Fund					
Summe Nettovermögen		USD	43.544.220	58.824.565	66.360.687
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	4,0234	5,1788	5,7230
	Klasse A	EUR	3,3202	4,0312	4,1082
	Klasse B	USD	4,4163	5,6561	6,2193
	Klasse B	EUR	1,7639	2,1310	2,1609
	Klasse C	USD	5,0859	6,4812	7,0910
	Klasse C	EUR	3,5511	4,2687	4,3069
	Sterling C (Inc)	GBP	3,7615	4,2823	4,6261
	Klasse W	USD	1,4334	1,8220	1,9885

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
Summe Nettovermögen		USD	40.968.820	95.125.353	15.864.824
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,8982	1,7039	1,5763
	Klasse A (Acc)	EUR	0,4648	0,8290	–
	Klasse B (Acc)	USD	0,4975	0,9389	–
	Klasse B (Acc)^	EUR	0,9098	–	–
	Klasse B (Acc)^	SGD	0,8915	–	–
	Klasse B (Inc)^	SGD	–	0,9412	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,5330	1,0015	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,9571	1,7913	1,6349
	Klasse E (Acc)	EUR	1,0143	1,7848	1,5181
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	0,9637	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,7281	1,3680	1,2536
	Klasse G (Acc)	EUR	0,5681	1,0042	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,4542	0,8894	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,8148	1,6116	1,5088
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,5083	0,9957	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)^	SGD	0,9148	–	–
	Klasse K (Acc)	USD	0,9245	1,7460	1,6080
	Klasse K (Acc)	EUR	0,9799	1,7399	1,4933
	Klasse W (Acc)	USD	0,9498	1,7812	1,6289
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,5107	0,9984	–
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
Summe Nettovermögen		USD	39.894.419	42.616.239	70.198.270
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	0,9460	0,9326	1,0597
	Klasse A	EUR	1,2316	1,1441	1,1974
	Klasse B	USD	0,8211	0,8054	0,9107
	Klasse B	EUR	1,0894	1,0070	1,0486
	Sterling B (Acc)	GBP	1,0138	0,8891	0,9966
	Klasse C	USD	1,1017	1,0753	1,2096
	Klasse C	EUR	1,4373	1,3220	1,3697
	Sterling C (Inc)	GBP	1,1197	1,0464	1,1714
	Klasse G (Acc)	EUR	1,0116	0,9304	0,9640
	Klasse G (Acc) (Hedged)^	EUR	0,8510	–	–
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,7820	0,7899	0,9092
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,7681	0,7683	0,8756
	Klasse W (Acc)	USD	0,9627	0,9372	1,0517
	Klasse W (Acc)	EUR	1,1795	1,0821	1,1184
	Sterling W (Acc)	GBP	1,2864	1,1199	1,2458

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund***					
Summe Nettovermögen		USD	23.339.106	24.751.005	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9230	0,9885	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,9317	0,9898	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,9364	0,9904	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,9190	0,9891	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,9325	0,9896	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,9338	0,9900	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9164	0,9888	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9298	0,9893	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,9399	0,9907	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,9224	0,9895	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9359	0,9900	–
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund***					
Summe Nettovermögen		USD	–	–	16.366.070
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	–	–	1,0238
	Klasse C (Acc)	USD	–	–	1,0833
	Klasse E (Acc)	USD	–	–	1,0872
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	0,9305
	Klasse W (Acc)	USD	–	–	1,0977
	Klasse X (Acc)	USD	–	–	1,1489
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
Summe Nettovermögen		USD	555.576.067	645.924.114	536.212.842
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9233	1,1191	1,0962
	Klasse A (Inc)	USD	1,5372	1,9816	1,5338
	Klasse C (Acc)	USD	1,5705	2,0205	1,5572
	Klasse G (Acc)	USD	1,2147	1,5627	1,2045
	Klasse G (Acc)	EUR	1,2618	1,5263	1,0964
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,0771	1,4319	1,1154
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,2483	1,6630	1,2975
	Klasse W (Acc)	USD	1,5856	2,0359	1,5660
	Klasse W (Acc)	EUR	1,4963	1,8063	1,2948
	Klasse W (Inc)	EUR	1,2170	1,4741	1,0623
	Sterling W (Acc)	GBP	0,9379	1,0756	–
	Klasse X (Acc)	USD	1,6234	2,0752	1,5893

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020	
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund						
Summe Nettovermögen			USD	178.903.236	191.298.660	26.335.612
Nettoinventarwert zum:						
	Klasse A (Acc)	USD	0,9527	1,0806	1,0498	
	Klasse A (Inc)	USD	0,8635	1,0315	1,0479	
	Klasse C (Acc)	USD	0,9549	1,0820	1,0501	
	Klasse C (Inc)	USD	0,8655	1,0327	1,0483	
	Klasse E (Acc)^	USD	–	1,0848	1,0507	
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,9273	1,0719	1,0471	
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,9470	1,0804	1,0488	
	Klasse E (Inc)^	USD	–	1,0354	1,0488	
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	EUR	–	1,0225	1,0453	
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,8578	1,0316	1,0470	
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9207	1,0672	1,0462	
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8336	1,0186	1,0444	
	Klasse W (Acc)	USD	0,9579	1,0834	1,0504	
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	DKK	–	10,6971	10,4666	
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9249	1,0700	1,0468	
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	9,4442	10,7907	10,4793	
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	9,3197	10,7387	10,4696	
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9449	1,0790	1,0485	
	Klasse W (Inc)	USD	0,8674	1,0341	1,0485	
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8375	1,0211	1,0450	
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,8559	1,0303	1,0467	
	Klasse X (Acc)	USD	0,9622	1,0867	1,0511	
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund						
Summe Nettovermögen			USD	46.542.724	20.691.305	44.168.089
Nettoinventarwert zum:						
	Klasse A (Acc)	USD	0,8937	1,0507	1,0608	
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,8845	1,0441	1,0526	
	Klasse W (Acc)	USD	0,8985	1,0543	1,0621	
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,8609	1,0315	1,0488	
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0512	
	Klasse X (Acc)	USD	–	–	1,0137	
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0351	–	–	

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	948.814.250	1.921.308.172	1.203.350.910
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9759	1,1395	1,0849
	Klasse C (Acc)	USD	0,9793	1,1417	1,0853
	Klasse C (Inc)	USD	0,8325	1,0187	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,8778	1,0424	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,8725	1,0400	–
	Klasse N (Acc)	USD	0,8592	1,0068	–
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	0,8380	1,0033	–
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,8079	0,9956	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,9826	1,1439	1,0858
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,8752	1,0413	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9606	–	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,8400	1,0264	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8668	1,0830	1,0817
	Klasse X (Acc)	USD	0,9902	1,1488	1,0868
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9762	1,1434	1,0846
	Klasse X (Inc)	USD	0,9040	1,1008	1,0863
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,8259	1,0072	1,0840
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
Summe Nettovermögen		USD	1.417.476.467	726.611.703	770.676.813
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Inc)	USD	0,8010	0,9625	0,9716
	Klasse A (Inc)	EUR	0,8840	0,9988	0,9396
	Klasse C (Acc)	USD	1,0991	1,2401	1,1813
	Klasse C (Inc)	USD	–	–	1,1172
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,9906	1,1418	1,0946
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0401	1,1828	1,1267
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	0,9812
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,9646	1,1134	1,0701
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9457	1,0927	1,0510
	Klasse K (Acc)	USD	1,0729	1,2108	1,1532
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	0,9784	1,1293	1,0851
	Klasse L (Acc)	USD	1,0815	1,2184	1,1584
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	0,9868	1,1360	1,0895
	Klasse L (Inc)^	USD	0,9039	–	–
	Klasse L (Inc) (Hedged)^	EUR	0,8761	–	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,9700	1,1033	1,0517
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,7894	0,9558	0,9643
	Klasse W (Acc)	USD	1,1041	1,2448	1,1843
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0060	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0606
	Klasse W (Inc)	USD	0,8944	1,0726	1,0806
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7207	0,8855	0,9001
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,8804	1,0672	1,0775
	Klasse X (Acc)	USD	0,9038	1,0172	1,1897
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0299	–	1,1673
	Klasse X (Inc)	USD	–	–	1,1420
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,8457	1,0086	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	352.246.309	554.266.191	392.457.935
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	125,1957	148,8118	152,7282
	Klasse A	EUR	148,9755	167,0360	158,0924
	Klasse A (Inc)	USD	–	–	110,4029
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	840,9620	1.032,1792	1.083,0567
	Klasse B	USD	139,1245	164,9561	168,8745
	Klasse C	USD	144,0257	170,0873	173,4325
	Klasse C	EUR	170,4259	189,8492	178,4712
	Klasse G (Inc)	USD	81,4547	99,8756	105,5549
	Klasse H (Hedged)	EUR	109,5809	132,9036	137,5639
	Klasse I (Hedged)	EUR	116,5161	140,4363	144,4120
	Klasse W	USD	147,0669	173,3326	176,3701
	Klasse W	EUR	182,4708	202,8604	190,3746
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	92,9411	112,3116	115,5095
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	90,0071	108,2557	111,0868
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	78,7718	99,0615	105,8527
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	73,6595	92,2053	98,2949
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	131,6412	156,0680	159,1680
	Klasse X	USD	163,4571	191,2988	193,3003
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	118,6679
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	24.246.898	33.134.900	39.274.388
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,0040	2,4303	2,4936
	Klasse A	EUR	1,8721	2,1347	2,0411
	Klasse C	USD	2,1877	2,6399	2,6951
	Klasse C	EUR	2,0394	2,3139	2,2015
	Klasse C (Inc)	USD	0,6354	0,8047	0,8531
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9460	1,1753	1,2169
	Klasse W	USD	1,1114	1,3378	1,3624
	Klasse X (Inc)	USD	0,7910	1,0020	1,0624

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
Summe Nettovermögen		USD	25.263.639	113.559.730	164.668.641
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	0,9281	1,0262	1,1322
	Klasse A	EUR	1,0793	1,1221	1,1537
	Klasse A (Inc)	USD	0,4186	0,4827	0,5573
	Klasse A (Inc)	EUR	0,6358	0,6896	0,7420
	Sterling A (Acc)	GBP	1,0026	0,9902	1,0813
	Sterling B (Acc)	GBP	1,0439	1,0276	1,1199
	Klasse C	USD	1,2499	1,3751	1,5096
	Klasse C	EUR	1,1694	1,2097	1,2376
	Klasse C (Inc)	USD	0,4489	0,5179	0,5980
	Klasse C (Inc)	EUR	0,5976	0,6487	0,6980
	Sterling C (Acc)	GBP	1,5334	1,5068	1,6378
	Sterling C (Inc)	GBP	0,7366	0,7591	0,8675
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,7392	0,8395	0,9363
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,7616	0,8606	0,9552
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,3712	0,4342	0,5036
	Klasse W	USD	0,7568	0,8298	0,9076
	Klasse W	EUR	0,9138	0,9420	0,9603
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,6774	0,7627	0,8433
	Klasse W (Inc)	EUR	0,5238	0,5684	0,6116
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,5539	0,6570	0,7674
	Sterling W (Inc)	GBP	0,5750	0,5926	0,6773
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,4149	0,4854	0,5631
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
Summe Nettovermögen		USD	24.491.950	27.883.288	28.263.991
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,1583	1,2650	1,2572
	Klasse C	USD	0,9637	1,1138	1,1819
	Klasse W (Acc)	USD	0,9211	1,0609	1,1217
	Klasse X (Inc)	USD	0,7671	0,9274	1,0281
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
Summe Nettovermögen		USD	38.253.080	125.677.325	165.595.940
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,8424	1,0075	1,0989
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,6908	0,8887	1,0255
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,7868	0,9663	1,0647
	Klasse W (Acc)	USD	0,8617	1,0262	1,1142
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,7628	0,9327	1,0226
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,7839	0,9451	1,0295
	Klasse X (Acc)	USD	0,8878	1,0508	1,1344

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	176.583.489	275.922.173	442.908.116
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,6515	1,9885	2,0677
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9944	1,2026	1,2534
	Klasse B	EUR	1,1678	1,4026	1,4550
	Klasse B (Inc)	EUR	1,0001	1,2096	1,2606
	Klasse C	EUR	1,8180	2,1781	2,2535
	Klasse C (Inc)	EUR	1,0863	1,3140	1,3693
	Klasse G (Acc)	EUR	0,8848	1,0600	1,0968
	Klasse H (Hedged)	CHF	1,0426	1,2629	1,3170
	Klasse I (Hedged)	CHF	1,1193	1,3490	1,3998
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9214	1,1034	1,1410
	Klasse Z^^^	EUR	1,0183	1,2188	1,2599
BNY Mellon European Credit Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	43.864.621	40.738.209	40.498.739
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	107,5876	125,9258	126,7630
	Klasse C	EUR	113,0068	131,6104	131,8246
	Klasse W (Acc)	EUR	93,9439	109,3006	109,3689
	Klasse X	EUR	119,2295	138,1121	137,5919
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 Food Fund** und ***					
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	-
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	-

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	408.355.513	434.682.361	614.883.298
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,9715	2,3579	2,5588
	Klasse A	EUR	1,6473	1,8584	1,8599
	Klasse B	USD	2,0272	2,4208	2,6233
	Klasse C	USD	2,1691	2,5813	2,7872
	Klasse C	EUR	1,8239	2,0471	2,0384
	Klasse C (Inc)	USD	0,8167	0,9813	1,0657
	Sterling C (Inc)	GBP	1,3575	1,4532	1,5595
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9875	1,2109	1,3274
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0568	1,2892	1,4063
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,7742	0,9330	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,9262	1,1011	1,1878
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9094	1,0196	1,1005
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,8700	–	–
	Klasse X	USD	2,3246	2,7510	2,9542
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,8381	1,0071	1,0891
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,8204	0,9953	1,0852
BNY Mellon Global Credit Fund					
Summe Nettovermögen		USD	384.749.177	442.961.954	803.381.804
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9005	1,0380	1,0487
	Klasse A (Inc) (Q)	USD	–	–	1,0415
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0039	1,1815	1,2044
	Klasse W (Acc)	USD	1,2034	1,3782	1,3844
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0421
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	CHF	1,0375	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1181	1,2914	1,2999
	Klasse X (Acc)	USD	1,2281	1,3996	1,3991
	Klasse X (Acc)	JPY	103,7643	103,6889	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,2006	1,3715	1,3727
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	84,8780	99,1545	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	345.001.062	432.993.493	498.134.113
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,2044	1,2881	1,3073
	Klasse A	EUR	1,3126	1,3242	1,2393
	Klasse A (Inc)	USD	0,9899	1,0732	1,0968
	Klasse C	USD	1,3014	1,3850	1,3984
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1509	1,1554	1,0759
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9414	1,0271	1,0512
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	–	–	10,3633
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,8383	0,9274	0,9560
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,9920	1,0769	1,0968
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	0,9375	1,0000	–
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,8390	0,9283	0,9569
	Klasse W	USD	1,1257	1,1950	1,2035
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,9819	1,0633	1,0800
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	–	–	1,0442
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	–	–	10,4829
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,8724	0,9654	0,9951
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0623	1,1334	1,1441
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0179
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	95,2655	102,8088	103,4345
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	89,3267	99,1286	101,7894
	Klasse Z (Acc)	USD	–	–	1,0017
	Klasse Z (Inc)	USD	–	–	1,0017
	Sterling Z (Acc)	GBP	1,0473	0,9917	0,9849
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,9941	0,9630	0,9718
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,9564	1,0191	1,0270
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9113	0,9940	1,0182

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund<<					
Summe Nettovermögen		USD	35.345.994	53.039.682	54.195.828
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,0786	1,4299	1,5287
	Klasse A	EUR	1,3902	1,7384	1,7136
	Klasse A (Inc)	EUR	1,2312	1,5395	1,5175
	Klasse B (Acc)	USD	–	–	1,8762
	Klasse B (Acc)	EUR	–	–	1,6827
	Klasse B (Inc)	USD	1,0914	1,4397	1,5313
	Klasse B (Inc)	EUR	1,2997	1,6172	1,5861
	Klasse C	USD	1,3121	1,7221	1,8224
	Klasse C (Acc)	USD	1,4471	1,8993	2,0099
	Klasse C (Acc)	EUR	–	–	1,6891
	Klasse C (Inc)	USD	1,1468	1,5052	1,5929
	Sterling C (Inc)	GBP	–	–	1,6859
	Klasse E (Acc)	USD	1,4572	1,9021	2,0024
	Klasse E (Acc)	CHF	1,2875	1,6632	1,6893
	Klasse H (Hedged)	EUR	0,9330	1,2765	1,3794
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,0320	1,3978	1,4956
	Klasse W (Acc)	USD	1,6931	2,2167	2,3400
	Klasse W (Acc)	EUR	1,2336	1,5235	1,4830
	Klasse W (Inc)	USD	1,1653	1,5257	1,6105
	Klasse W (Inc)	EUR	1,3632	1,6836	1,6389
BNY Mellon Global Equity Fund**					
Summe Nettovermögen		USD	393.085.139	505.772.156	439.208.591
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,7714	3,5434	3,0414
	Klasse A	EUR	2,3412	2,8236	2,2352
	Klasse B	USD	3,0304	3,8553	3,2929
	Klasse B	EUR	2,8125	3,3752	2,6586
	Klasse C	USD	3,3420	4,2305	3,5947
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,4601	1,9105	1,6416
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	AUD	–	1,1335	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,5179	1,9167	1,6249
	Klasse W (Acc)	EUR	1,5979	1,9032	1,4886

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	535.733.690	411.101.299	769.230.682
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	2,0594	2,1617	1,9119
	Klasse A	EUR	2,8641	2,8359	2,3131
	Klasse A (Inc)	USD	1,4261	1,5387	1,3964
	Klasse A (Inc)	EUR	1,3660	1,3903	1,1635
	Sterling A (Acc)	GBP	2,0459	1,9185	1,6755
	Klasse B	USD	2,5429	2,6559	2,3373
	Klasse B	EUR	2,8693	2,8269	2,2942
	Klasse B (Inc)	USD	1,7565	1,8857	1,7027
	Klasse B (Inc)	EUR	2,1348	2,1619	1,8002
	Sterling B (Inc)	GBP	2,2825	2,1891	1,9518
	Klasse C	USD	2,4284	2,5238	2,2098
	Klasse C	EUR	3,1500	3,0880	2,4937
	Klasse C (Inc)	USD	1,8586	1,9854	1,7838
	Klasse C (Inc)	EUR	2,1519	2,1683	1,7965
	Sterling C (Inc)	GBP	2,4106	2,3004	2,0408
	Klasse G (Acc)	EUR	1,4359	1,4076	1,1367
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,5220	1,6471	1,4722
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,1404	1,2693	1,1644
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,6821	1,8024	1,5950
	Klasse W	USD	2,1521	2,2310	1,9477
	Klasse W	EUR	2,6346	2,5763	2,0753
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,2043	1,2869	1,1366
	Klasse W (Inc)	USD	1,5895	1,6937	1,5179
	Klasse W (Inc)	EUR	1,9537	1,9637	1,6221
	Sterling W (Acc)	GBP	2,8779	2,6653	2,2988
	Sterling W (Inc)	GBP	2,1275	2,0252	1,7921
	Klasse Z (Acc)	USD	1,8081	1,8725	1,6339
	Klasse Z (Acc)	EUR	2,1116	2,0628	1,6599
	Klasse Z (Inc)	USD	1,2485	1,3290	1,1898
	Klasse Z (Inc)	EUR	1,3335	1,3390	1,1055
	Sterling Z (Acc)	GBP	–	–	1,0379
	Sterling Z (Inc)	GBP	1,3284	1,2632	1,1167
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	109.883.243	166.693.695	153.424.293
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	2,5967	2,7968	2,4840
	Klasse C	USD	1,3313	1,5163	1,4567
	Klasse C	EUR	2,7186	2,9209	2,5877
	Klasse C (Inc)	USD	0,7987	0,9611	0,9706
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,1288	1,3164	1,2787
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,1631	1,3529	1,3109
	Klasse W (Acc)	USD	1,0814	1,2255	1,1715
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9726	1,1107	1,0641
	Klasse X (Inc)	USD	0,8485	1,0103	1,0094
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,7447	0,9069	0,9143

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	122.260.526	227.707.584	146.439.027
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,9737	1,0657	0,9355
	Klasse A (Inc)	USD	0,8026	0,9299	0,8534
	Klasse A (Inc)	EUR	0,8548	0,9311	0,7964
	Klasse B (Acc)	SGD	1,1847	1,2991	1,1133
	Klasse B (Acc)	USD	0,9926	1,0816	0,9451
	Klasse B (Inc)	USD	0,8185	0,9440	0,8625
	Klasse B (Inc)	SGD	1,0458	1,2135	1,0872
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,9480	1,0890	–
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,9795	1,1326	–
	Klasse E (Inc)	USD	0,8551	0,9764	0,8835
	Klasse E (Inc)	EUR	0,9111	0,9781	0,8244
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,7825	0,9130	0,8303
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,8666	0,9807	0,8699
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,7131	0,8551	0,7934
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,2387	1,3614	1,1915
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	1,0925	1,2715	1,1635
	Klasse W (Acc)	USD	1,0246	1,1084	0,9616
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9112	1,0207	0,8949
	Klasse W (Inc)	USD	0,8447	0,9674	0,8775
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7528	0,8919	0,8179
BNY Mellon Global Leaders Fund					
Summe Nettovermögen		USD	46.497.437	65.357.060	39.090.903
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,6583	2,1514	1,8243
	Klasse A (Acc)	EUR	1,4598	1,7810	1,4075
	Klasse A (Inc)	EUR	–	–	1,4075
	Klasse B (Acc)	USD	1,2904	1,6658	1,4055
	Klasse C (Acc)	USD	1,7623	2,2636	1,9003
	Klasse E (Acc)	USD	1,5874	2,0290	1,6949
	Klasse E (Acc)	EUR	1,1995	1,4415	1,1221
	Sterling E (Acc)	GBP	1,8973	2,1659	1,7907
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	DKK	–	15,1216	12,9634
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,4247	1,9141	1,6408
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	11,2520	15,0354	12,8721
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	11,1673	15,0543	12,9082
	Klasse W (Acc)	USD	1,7894	2,2928	1,9199
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	DKK	–	16,4629	13,9381
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	11,7657	15,5284	13,1283
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	11,6699	15,5378	13,1574
	Sterling W (Acc)	GBP	1,8686	2,1385	1,7725

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund***					
Summe Nettovermögen		EUR	–	–	20.744.725
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	–	–	1,0933
	Klasse A (Inc)	EUR	–	–	1,0024
	Klasse A (Inc)	USD	–	–	1,2234
	Klasse C (Acc)	EUR	–	–	1,0870
	Klasse E (Inc)	EUR	–	–	1,0341
	Klasse W (Acc)	EUR	–	–	1,1190
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
Summe Nettovermögen		USD	27.108.214	37.198.450	35.977.689
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	3,2736	4,2183	3,5794
	Klasse A	EUR	2,7450	3,3366	2,6109
	Klasse B	USD	3,5879	4,6003	3,8841
	Klasse C	USD	3,8939	4,9678	4,1735
	Klasse C	EUR	3,2568	3,9193	3,0365
	Klasse H (Hedged)	EUR	1,4867	1,9813	1,6999
	Klasse I (Hedged)	EUR	1,6280	2,1481	1,8247
	Klasse W (Acc)	USD	1,3122	1,6705	1,4002
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
Summe Nettovermögen		EUR	2.105.183.114	3.121.728.759	2.926.880.946
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	1,3680	1,5477	1,4507
	Klasse A (Inc)	EUR	1,1070	1,2551	1,1807
	Klasse C	EUR	1,4586	1,6420	1,5316
	Klasse C (Inc)	EUR	1,1682	1,3244	1,2456
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1202	1,2610	1,1762
	Klasse G (Inc)	EUR	1,0747	1,2184	1,1458
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,0726	1,1938	1,1107
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	1,0698	1,1876	1,1037
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	1,0417	1,1639	1,0858
	Klasse W	EUR	1,3414	1,5063	1,4014
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0757	1,2141	1,1325
	Klasse W (Inc)	EUR	1,0251	1,1620	1,0926
	Klasse X	EUR	1,5162	1,6892	1,5594
	Klasse Z (Acc)	EUR	1,1299	1,2675	1,1781
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
Summe Nettovermögen		GBP	60.348.549	65.897.045	62.762.505
Nettoinventarwert zum:					
	Sterling B (Acc)	GBP	1,2788	1,3974	1,3192
	Sterling B (Inc)	GBP	1,1874	1,2987	1,2283
	Sterling C (Inc)	GBP	1,2122	1,3256	1,2531
	Sterling W (Acc)	GBP	1,3440	1,4577	1,3659
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1917	1,3031	1,2314
	Sterling X (Acc)	GBP	1,3899	1,4953	1,3895

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
Summe Nettovermögen		USD	346.537.616	437.609.335	300.822.877
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	1,5912	1,7533	1,6528
	Klasse C	USD	1,7020	1,8660	1,7503
	Klasse C (Inc)	USD	1,3079	1,4416	1,3639
	Klasse G (Acc)	USD	1,2341	1,3531	1,2691
	Klasse W	USD	1,4013	1,5326	1,4339
	Klasse W (Inc)	USD	1,2233	1,3483	1,2760
	Klasse X	USD	1,9597	2,1261	1,9733
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	535.281.260	792.573.372	701.716.479
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1461	1,1990	1,1502
	Klasse A (Inc)	USD	0,8931	0,9727	0,9685
	Klasse C (Acc)	USD	1,1812	1,2296	1,1736
	Klasse G (Acc)	USD	1,0598	1,1031	1,0529
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0123	1,0804	1,0451
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,7938	0,8824	0,8859
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	1,0431	1,1075	1,0658
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,7940	0,8827	0,8862
	Klasse W (Acc)	USD	1,1992	1,2452	1,1856
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	1,0168	1,0815	1,0402
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0375	1,0989	1,0548
	Klasse W (Inc)	USD	0,8969	0,9770	0,9727
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7951	0,8839	0,8875
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1203	1,1699	1,1164
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,8482	0,9300	0,9276
	Klasse X (Acc)	USD	1,2401	1,2805	1,2125
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,0732	1,1145	1,0574
	Klasse Y (Acc)	USD	1,2411	1,2813	1,2130
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	1,1589	1,2032	1,1414
	Klasse Z (Acc)	USD	1,0042	1,0417	–
	Klasse Z (Inc)	USD	0,9289	1,0118	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1,0361	1,0811	1,0304
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,8712	0,9554	0,9529
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
Summe Nettovermögen		USD	25.829.316	32.551.101	29.990.159
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse W (Acc)	USD	1,2295	1,4588	1,3478
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	1,2257	1,4548	1,3399

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
Summe Nettovermögen		JPY	23.358.895.122	21.102.568.351	15.317.409.324
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	1,1784	1,3006	1,2114
	Klasse C	JPY	268,5283	271,9886	243,5126
	Klasse C	USD	0,8719	1,0105	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,2844	1,3082	1,1775
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,4270	1,4094	1,2554
	Klasse G (Acc)	EUR	–	–	1,1785
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	1,1507	1,1741	1,0599
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	1,9608	1,9785	1,7902
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	14,1451	14,4586	13,1526
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SEK	13,9437	14,3794	13,0993
	Klasse H (Hedged)	EUR	2,2774	2,3468	2,1399
	Klasse H (Hedged)	USD	2,6383	2,6434	2,3889
	Klasse I (Hedged)	EUR	2,5260	2,5782	2,3278
	Klasse I (Hedged)	USD	2,8718	2,8475	2,5489
	Klasse W	JPY	274,8870	277,7341	248,0364
	Klasse W (Acc)	EUR	1,1346	1,2366	1,1378
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,2257	1,2478	1,1236
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	14,5682	14,7049	13,2103
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	14,3852	14,6493	13,1792
	Sterling W (Acc)	GBP	2,8960	2,9885	2,9525
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1290	1,1682	1,1606

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	1.151.824.392	1.600.784.047	1.571.112.825
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	3,2174	3,8035	3,0344
	Klasse A	USD	2,1707	2,7292	2,3363
	Klasse A (Inc)	EUR	2,0650	2,4411	1,9475
	Sterling A (Acc)	GBP	3,3395	3,7502	3,1776
	Klasse B	EUR	3,0577	3,5968	2,8552
	Klasse B	USD	2,3123	2,8927	2,4640
	Klasse B (Acc)	SGD	1,3173	1,6580	1,3851
	Sterling B (Inc)	GBP	2,8982	3,2384	2,7303
	Klasse C	EUR	3,7253	4,3601	3,4438
	Klasse C	USD	2,5155	3,1313	2,6535
	Klasse G (Acc)	EUR	1,3625	1,5947	1,2596
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	–	–	1,1535
	Klasse I (Acc) (Hedged)	USD	–	–	1,1826
	Klasse J (Acc) (Hedged)	JPY	91,0346	107,1911	–
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	1,5110	1,7471	1,3784
	Klasse S	EUR	3,8248	4,4543	3,5007
	Klasse S (Acc) 1	USD	1,2661	1,5682	1,3225
	Klasse W	EUR	2,7563	3,2180	2,5354
	Klasse W	USD	2,2746	2,8244	2,3879
	Klasse W (Hedged)	USD	2,9360	3,3500	2,6227
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	1,3789	1,5824	1,2390
	Klasse W (Inc)	EUR	–	–	1,1300
	Klasse W (Inc)	USD	2,1493	2,6723	2,2681
	Sterling W (Acc)	GBP	3,0206	3,3500	2,8033
	Sterling W (Inc)	GBP	2,8537	3,1691	2,6620
	Klasse X (Acc)^	USD	1,0460	–	1,4517
	Sterling X	GBP	2,7481	3,0239	2,5108

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
Summe Nettovermögen		USD	463.291.956	993.610.089	474.197.314
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,1568	1,7836	1,5100
	Klasse A (Acc)	EUR	1,3686	1,9841	1,5654
	Klasse A (Inc)	USD	1,1565	1,7832	1,5097
	Klasse A (Inc)	EUR	1,2602	1,8270	1,4415
	Klasse B (Acc)	USD	1,1799	1,8111	1,5265
	Klasse B (Acc)	SGD	0,6951	1,0734	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,2222	1,8667	1,5655
	Klasse C (Acc)	EUR	1,2627	1,8133	1,4172
	Klasse C (Inc)	EUR	1,3117	1,8836	1,4722
	Klasse E (Acc)	USD	1,2332	1,8741	1,5638
	Klasse E (Acc)	CHF	1,3245	1,9835	1,6081
	Klasse E (Acc)	EUR	1,3434	1,9195	1,4927
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	1,2913	2,0412	1,7264
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	1,2830	2,0257	1,7105
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,1225	1,7531	1,4732
	Klasse G (Acc)	USD	1,0009	1,5287	1,2819
	Klasse G (Acc)	CHF	1,0192	1,5340	1,2499
	Klasse G (Acc)	EUR	1,1785	1,6923	1,3230
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,9472	1,5026	1,2756
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,6760	1,0839	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	1,0242	1,6405	1,4056
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	1,0233	1,6391	1,4044
	Klasse J (Acc) (Hedged)	EUR	1,2299	1,9610	1,6727
	Klasse K (Acc)	USD	1,3768	2,1133	1,7812
	Klasse K (Acc) (Hedged)	CHF	1,2254	1,9568	1,6716
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	1,2310	1,9629	1,6743
	Klasse K (Acc) (Hedged)	SGD	0,6782	1,0541	–
	Klasse K (Inc)	USD	1,3769	2,1134	1,7813
	Klasse K (Inc) (Hedged)	CHF	1,2242	1,9549	1,6702
	Klasse K (Inc) (Hedged)	EUR	1,2296	1,9606	1,6723
	Klasse K (Inc) (Hedged)	SGD	1,3203	2,0521	1,7361
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	1,2611	1,9893	1,6885
	Klasse W (Acc)	USD	1,2169	1,8548	1,5524
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,8531	1,3528	1,1475
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	1,0776	1,7062	1,4452
	Sterling W (Acc)	GBP	0,7732	1,0527	–
	Klasse W (Inc)	USD	1,2118	1,8471	1,5460
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	1,0699	1,6939	1,4347
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker***					
Summe Nettovermögen		USD	–	–	36.865.576
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	–	–	3,4193
	Klasse A	EUR	–	–	2,7978
	Klasse C	USD	–	–	3,9141
	Klasse C	EUR	–	–	3,0387

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	43.187.140	81.192.875	60.661.744
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	EUR	6,0216	7,0496	5,8158
	Klasse A	USD	1,3772	1,7092	1,5291
	Klasse B	EUR	3,0935	3,6036	2,9581
	Klasse C	EUR	7,2083	8,3551	6,8243
	Klasse C	USD	1,5508	1,9065	1,6886
	Klasse W (Acc)	EUR	1,1813	1,3659	1,1129
	Sterling W (Acc)	GBP	–	–	1,9206
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund					
Summe Nettovermögen		USD	23.206.685	4.976.550	5.003.928
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,7098	0,9887	0,9988
	Klasse B (Acc)	USD	0,7164	0,9934	0,9990
	Klasse B (Acc)	SGD	0,7188	1,0028	0,9892
	Klasse C (Acc)	USD	0,7237	0,9986	0,9993
	Klasse E (Acc)	USD	0,7312	1,0038	0,9995
	Sterling E (Acc)	GBP	0,8061	0,9886	0,9741
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,7097	0,9991	0,9992
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,6771	0,9766	0,9983
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,6904	0,9864	0,9987
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,7060	0,9905	0,9991
	Klasse W (Acc)	USD	0,7268	1,0008	0,9994
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,6932	0,9884	0,9988

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
Summe Nettovermögen		EUR	333.190.402	328.622.843	271.321.884
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9389	1,0203	1,0424
	Klasse A (Acc)	USD	0,8826	1,0168	1,1265
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9136	1,0042	1,0321
	Klasse C (Acc)	EUR	0,9568	1,0347	1,0517
	Klasse E (Acc)	EUR	0,9784	1,0524	1,0643
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,9324	1,0084	1,0226
	Klasse G (Acc)	EUR	0,9569	1,0347	1,0518
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,9016	0,9850	1,0091
	Klasse H (Acc) (Hedged)	NOK	–	–	10,3364
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	USD	0,9928	–	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)^	USD	0,9928	–	–
	Klasse V (Acc)^	EUR	0,9371	–	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9684	1,0445	1,0592
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9215	0,9993	1,0161
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	–	–	10,4554
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,9688	1,0257	1,0322
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9549	1,0161	1,0242
	Klasse W (Inc)	EUR	0,8878	0,9759	1,0008
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9186	0,9961	1,0178
	Klasse X (Acc)	EUR	0,9881	1,0600	1,0692
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,9185	0,9892	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	USD	–	–	1,0016
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,8909	0,9793	–
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,9133	0,9847	1,0016
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*					
Summe Nettovermögen		USD	10.693.015	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	0,9733	–	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	0,9759	–	–
	Klasse C (Acc)^	USD	1,0683	–	–
	Klasse E (Acc)^	USD	1,0699	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0586	–	–
	Sterling E (Acc)^	GBP	0,9804	–	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0630	–	–
	Sterling E (Inc)^	GBP	0,9804	–	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0630	–	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0542	–	–
	Klasse W (Acc)^	USD	1,0690	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0577	–	–
	Sterling W (Acc)^	GBP	0,9796	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0622	–	–
	Sterling W (Inc)^	GBP	0,9796	–	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0622	–	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
Summe Nettovermögen		EUR	87.957.570	78.396.803	34.247.376
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,9719	1,1430	1,0735
	Klasse A (Inc)	EUR	0,9706	1,1421	1,0740
	Klasse E (Acc)	EUR	1,0012	1,1657	1,0841
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	1,0401	1,1875	1,0950
	Klasse E (Inc)	EUR	–	–	1,0837
	Klasse G (Acc)	EUR	1,0523	1,2315	1,1510
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9936	1,1597	1,0812
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,9250	1,0588	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0043	1,1574	1,0736
	Klasse W (Inc)	EUR	0,9787	1,1514	1,0813
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9903	1,1498	1,0736
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
Summe Nettovermögen		USD	80.272.370	91.523.113	92.952.258
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	1,0113	1,0365	1,0503
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0002	1,0230	1,0301
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund***					
Summe Nettovermögen		USD	–	–	3.704.307
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A	USD	–	–	3,3533
	Klasse A	EUR	–	–	2,7020
	Klasse B	USD	–	–	2,4704
	Klasse C	USD	–	–	3,8823
	Klasse C	EUR	–	–	3,3708
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
Summe Nettovermögen		USD	356.717.532	297.752.469	230.267.279
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	USD	1,0969	–	–
	Klasse A (Acc)	EUR	1,5428	1,4158	1,0314
	Klasse B (Inc)	USD	1,3165	1,3070	1,0382
	Klasse C (Acc)	USD	1,0638	1,0280	–
	Klasse C (Inc)	USD	1,4565	1,4388	1,1374
	Klasse E (Acc)	EUR	–	–	1,0743
	Klasse E (Inc)	USD	1,4932	1,4670	1,1531
	Klasse E (Inc)	EUR	1,5264	1,4099	1,0328
	Sterling E (Acc)	GBP	1,7605	1,5112	1,1514
	Sterling E (Inc)	GBP	1,5441	1,3549	1,0541
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1,3451	1,3467	1,0655
	Klasse H (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0779	–	–
	Klasse W (Acc)	USD	1,6857	1,6250	1,2548
	Klasse W (Acc)	EUR	1,5879	1,4391	1,0357
	Sterling W (Acc)^	GBP	0,9878	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0834	–	–
	Klasse W (Inc)	USD	1,4784	1,4568	1,1485
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9993	–	–
	Sterling W (Inc)	GBP	1,5165	1,3347	1,0417

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
Summe Nettovermögen		USD	890.378.161	1.007.082.724	613.916.282
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	USD	0,8656	1,0355	1,0299
	Klasse A (Inc)	USD	0,8209	1,0029	–
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,7932	0,9809	–
	Klasse C (Acc)	USD	1,0680	1,2713	1,2580
	Klasse E (Acc)	USD	1,0294	1,2229	1,2078
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,9021	1,1003	1,0988
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,9568	1,1611	1,1565
	Klasse E (Inc) (Hedged)^	EUR	–	1,0031	1,0285
	Klasse G (Acc)	USD	0,8381	0,9978	–
	Sterling G (Inc) (Hedged)^	GBP	–	1,0205	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,9188	1,1228	1,1261
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,8126	0,9977	–
	Sterling H (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,0075	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,7684	0,9699	1,0015
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	EUR	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	1,0742	1,2773	1,2627
	Klasse W (Acc)	EUR	0,9458	1,0575	0,9743
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9149	1,1170	1,1166
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9518	1,1562	1,1527
	Klasse W (Inc)	USD	0,8810	1,0796	1,0991
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,8164	1,0273	1,0573
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7960	0,9975	1,0238
	Klasse W (Inc) (M)^	HKD	9,7346	–	–
	Klasse W (Inc) (M)^	SGD	0,9559	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,8375	1,0034	–
	Klasse X (Acc)	USD	–	–	1,2249
	Klasse Z (Acc)^	USD	–	1,0097	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	0,8151	0,9942	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,8219	0,9980	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,0035	–
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund***					
Summe Nettovermögen		EUR	1.009.263.725	984.235.804	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)	EUR	0,8515	0,9909	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,8591	0,9947	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,8608	0,9956	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,8568	0,9964	–
	Klasse X (Acc)	EUR	0,8670	0,9991	–
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,8621	0,9961	–

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2020
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*					
Summe Nettovermögen		EUR	25.869.822	–	–
Nettoinventarwert zum:					
	Klasse A (Acc)^	EUR	0,8594	–	–
	Klasse C (Acc)^	EUR	0,8619	–	–
	Klasse E (Acc)^	EUR	0,8629	–	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	USD	0,8797	–	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	0,8732	–	–
	Klasse G (Acc)^	EUR	0,8619	–	–
	Klasse W (Acc)^	EUR	0,8621	–	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	USD	0,8791	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,8726	–	–
	Klasse X (Acc)^	EUR	0,8639	–	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	USD	0,8807	–	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	0,8742	–	–

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

*** Dieser Fonds wurde im vorangegangenen Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

† Der BNY Mellon Asian Equity Fund wurde mit Wirkung vom 7. November 2022 in BNY Mellon Asian Opportunities Fund umbenannt.

‡ Der BNY Mellon Global Emerging Markets Fund wurde mit Wirkung vom 7. November 2022 in BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund umbenannt.

§ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

^^ In dieser Anteilsklasse kam es während des Geschäftsjahres zu neuen Aktivitäten, nachdem diese Anteilsklasse im vorangegangenen Geschäftsjahr vollständig zurückgenommen wurde.

^^^ Mit Wirkung vom 3. Mai 2022 wurde die Anteilsklasse Euro S des BNY Mellon Euroland Bond Fund in Anteilsklasse Euro Z umbenannt.

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

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.

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.

Zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 wird für die in der umseitigen Tabelle aufgeführten Fonds der Anstieg oder Rückgang des den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens für das Geschäftsjahr 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	
			2022	2021	2022	2021
BNY Mellon Asian Income Fund	FTSE Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	865.624	717.912
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	2.139.196	3.081.287
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	2.419.941	4.648.830
BNY Mellon Brazil Equity Fund	MSCI Brazil 10/40 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.785.850	1.956.434
BNY Mellon Future Earth Fund^	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	82.446	104.945
BNY Mellon Future Food Fund^**	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	93.431	134.864
BNY Mellon Future Life Fund^	MSCI AC World NR Index	USD	5,00 %	5,00 %	101.933	114.923
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	MSCI Emerging Markets Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.735.038	2.676.768
BNY Mellon Global Equity Fund**	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	17.126.917	21.636.013
BNY Mellon Global Equity Income Fund	FTSE World Index TR	USD	5,00 %	5,00 %	20.139.891	18.061.838
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	S&P Global Infrastructure Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	6.677.638	12.163.421
BNY Mellon Global Leaders Fund	MSCI World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	2.178.023	2.902.497
BNY Mellon Global Opportunities Fund	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.303.222	1.826.627
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 %	1.222.305	1.718.082
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	Russell Nomura Small Cap Index	JPY	5,00 %	5,00 %	1.329.364.114	1.259.549.792
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	MSCI World Index NR	EUR	5,00 %	5,00 %	51.469.515	69.225.013
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	MSCI All-Country World Mid Cap Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	24.907.523	50.579.822
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	S&P EuroZone Small Cap Index TR	EUR	5,00 %	5,00 %	2.354.524	4.393.165
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund^	MSCI All-Country World Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	1.146.200	248.147
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund**^	MSCI Emerging Markets Index NR	USD	5,00 %	k. A.	516.332	k. A.
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	S&P 500 Index NR	USD	5,00 %	5,00 %	17.055.967	17.374.008

^ 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.

** Siehe Erläuterung 20 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 2022 und 31. Dezember 2021 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 2022 und 31. Dezember 2021, der mit einem 99%-igen Konfidenzniveau über die Haltedauer gemessen wird.

Fonds	Konfidenzniveau	VaR-Typ	Haltedauer 2022	Haltedauer 2021	Regulato- rische Grenze 2022	Regulato- rische Grenze 2021	VaR 2022	VaR 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	5,00 %	5,00 %	0,88 %	1,29 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	10,00 %	10,00 %	0,97 %	1,05 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	99 %	Absolut	Fünf Tage	Fünf Tage	6,00 %	6,00 %	0,47 %	1,15 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	8,40 %	5,70 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00 %	84,88 %	113,36 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	119,25 %	124,25 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	106,31 %	112,61 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	121,67 %	134,40 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	100,14 %	100,66 %
BNY Mellon European Credit Fund	99 %	Relativ	Fünf Tage	Fünf Tage	200,00 %	200,00 %	105,71 %	98,00 %
BNY Mellon Global Credit Fund	99 %	Relativ	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	200,00 %	200,00 %	108,98 %	92,00 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	2,05 %	2,37 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	99 %	Relativ	Ein Tag	Ein Tag	200,00 %	200,00 %	97,03 %	98,23 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	4,15 %	9,41 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,23 %	8,75 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,55 %	8,88 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	1,78 %	2,41 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,77 %	8,98 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	3,62 %	1,63 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	99 %	Absolut	Zwanzig Tage	Zwanzig Tage	20,00 %	20,00 %	4,24 %	3,12 %

Der VaR ist die Risikobewertungsmethode, die verwendet wird, um Leverage und Marktrisikovolatilität der Fonds zu beurteilen. Wird der VaR als Prozentsatz des Nettoinventarwerts der Fonds berechnet (absoluter oder relativer VaR), darf er die im Prospekt angegebenen regulatorischen Höchstgrenzen nicht übersteigen. Der VaR wird täglich auf der Grundlage eines einseitigen Konfidenzniveaus von 99 % und einer im Voraus festgelegten Haltefrist entweder auf einer absoluten Basis (bei der der Wert mit dem Nettoinventarwert des Fonds verglichen wird) oder auf einer relativen Basis (bei der der VaR mit dem Referenzwert oder dem Referenzportfolio verglichen wird) berechnet. Der Beobachtungszeitraum darf nicht weniger als ein Jahr betragen, sofern kein kürzerer Zeitraum gerechtfertigt ist.

Nachfolgend eine Auflistung der Nachteile der VaR-Analyse:

- 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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

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 %

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

Fonds	Mindestausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchstausnutzung
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	7,60 %	14,46 %	25,80 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	7,70 %	11,95 %	26,80 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	9,68 %	14,22 %	21,03 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	20,53 %	27,56 %	31,67 %
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	0,00 %	42,59 %	48,56 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	49,34 %	56,48 %	59,66 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	57,83 %	60,40 %	63,94 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	56,01 %	59,50 %	62,62 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	64,68 %	70,01 %	76,52 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	47,59 %	54,19 %	61,56 %
BNY Mellon European Credit Fund	44,50 %	52,65 %	58,00 %
BNY Mellon Global Credit Fund	39,50 %	46,34 %	50,00 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	9,21 %	11,13 %	13,38 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	49,12 %	58,52 %	71,15 %
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	10,35 %	54,31 %	67,18 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	33,45 %	47,35 %	66,28 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	26,40 %	44,46 %	62,40 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	18,44 %	44,40 %	61,61 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	8,08 %	10,33 %	12,46 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	29,70 %	46,69 %	67,40 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	5,18 %	7,13 %	9,76 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	31,23 %	35,28 %	40,76 %

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.)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

Das durchschnittliche Leverage-Niveau, das im Verlauf des Geschäftsjahres bis zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 angewendet wurde, gestaltet sich wie folgt:

Fonds	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2022	Durchschnittliches Leverage-Niveau 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	511,18 %	382,97 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	152,11 %	167,00 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	189,49 %	221,00 %
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	563,71 %	566,25 %
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund*	k. A.	558,22 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	24,29 %	39,10 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	28,74 %	24,62 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	185,89 %	91,87 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	74,09 %	50,42 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund	105,62 %	106,52 %
BNY Mellon European Credit Fund	22,99 %	23,50 %
BNY Mellon Global Credit Fund	280,12 %	188,60 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	101,02 %	108,46 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	25,60 %	89,01 %
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*	k. A.	51,83 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	150,34 %	122,91 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	146,53 %	108,10 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	125,87 %	67,99 %
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	101,02 %	131,87 %
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	140,21 %	116,85 %
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	285,80 %	145,39 %
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	k. A.	k. A.

* Dieser Teilfonds wurde im vorangegangenen Geschäftsjahr geschlossen.

ZINSRISIKO

Das Zinsrisiko wird definiert als Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwanken könnte. Dieses Risiko betrifft Finanzinstrumente, bei denen sich Zinsänderungen negativ auf den beizulegenden Zeitwert auswirken.

Die Mehrzahl der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft, d. h. jene Fonds, die vorwiegend Aktien oder Aktienderivate halten, sind nicht zinstragend. Demzufolge unterliegen diese Vermögenswerte keinem hohen Risiko von Schwankungen der jeweils vorherrschenden Marktzinsen. Alle überschüssigen Barmittel und 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 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		Über	Unver-	Gesamt
	1 Jahr	1-6 Jahre	6 Jahre		
	EUR	EUR	EUR	zinslich	2022
				EUR	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		Über	Unver-	Gesamt
	1	1-3 Monate	3 Monate		
	GBP	GBP	GBP	zinslich	2022
				GBP	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 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 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	3.798.611	35.507.358
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	4.511.128	39.237.667
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	47.614	–	–	844.025	891.639
Margen auf Derivatkontrakte	30.884	–	–	–	30.884
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	62.064	62.064
Verbindlichkeiten insgesamt	78.498	–	–	906.089	984.587
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)					
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	–	–	610.865	1.104.910
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	503.801	503.801
Verbindlichkeiten insgesamt	494.045	–	–	1.114.666	1.608.711
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	222.932.529	332.164.516
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	–	–	18.335.941	21.200.062
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.860.528	2.860.528
Verbindlichkeiten insgesamt	2.864.121	–	–	21.196.469	24.060.590
Zinssensitivitätslücke insgesamt	77.059.155	30.992.619	35.895.589		
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Unter	1-6 Jahre	Über	Unver-	Gesamt
	1 Jahr	USD	6 Jahre	zinslich	2022
	USD	USD	USD	USD	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		

* 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 2021 zusammen. Sie enthält die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert, kategorisiert nach vertraglicher Zinsanpassung oder Fälligkeitsterminen, und zwar dem jeweils früheren von beiden:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Unter		Über		Unver- zinslich	Gesamt 2021
	1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	6 Jahre EUR	EUR		
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle						
Vermögenswerte	132.792.315	62.118.942	154.072.756	44.908.829	393.892.842	
Barmittel und Bargegenwerte	28.685.756	–	–	–	28.685.756	
Margen auf Derivatkontrakte	24.088.305	–	–	–	24.088.305	
Forderungen	–	–	–	1.949.114	1.949.114	
Gesamtvermögen	185.566.376	62.118.942	154.072.756	46.857.943	448.616.017	
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle						
Verbindlichkeiten	6.593.995	8.925.041	364.491	5.703.547	21.587.074	
Banküberziehung	247.049	–	–	–	247.049	
Margen auf Derivatkontrakte	3.329.865	–	–	–	3.329.865	
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.618.800	2.618.800	
Verbindlichkeiten insgesamt	10.170.909	8.925.041	364.491	8.322.347	27.782.788	
Zinssensitivitätslücke insgesamt	175.395.467	53.193.901	153.708.265			
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
	Unter		Über		Unver- zinslich	Gesamt 2021
	1 GBP	1-3 Monate GBP	3 Monate GBP	GBP		
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle						
Vermögenswerte	4.999.686	40.497.957	49.600.212	32.836.849	127.934.704	
Barmittel und Bargegenwerte	735.906	–	–	–	735.906	
Margen auf Derivatkontrakte	1.714.385	–	–	–	1.714.385	
Forderungen	–	–	–	2.669.531	2.669.531	
Gesamtvermögen	7.449.977	40.497.957	49.600.212	35.506.380	133.054.526	
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle						
Verbindlichkeiten	37.152	254.653	–	5.938.454	6.230.259	
Margen auf Derivatkontrakte	26.275	–	–	–	26.275	
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.092.121	3.092.121	
Verbindlichkeiten insgesamt	63.427	254.653	–	9.030.575	9.348.655	
Zinssensitivitätslücke insgesamt	7.386.550	40.243.304	49.600.212			

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	Unter 1 EUR	1-3 Monate EUR	Über 3 Monate EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	27.417.037	33.036.115	34.002.396	11.234.811	105.690.359
Barmittel und Bargegenwerte	1.156.742	–	–	–	1.156.742
Margen auf Derivatkontrakte	1.060.741	–	–	–	1.060.741
Forderungen	–	–	–	1.534.714	1.534.714
Gesamtvermögen	29.634.520	33.036.115	34.002.396	12.769.525	109.442.556

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	15.465	3.468.239	8.684.879	12.168.583
Margen auf Derivatkontrakte	705.341	–	–	–	705.341
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.420.468	1.420.468
Verbindlichkeiten insgesamt	705.341	15.465	3.468.239	10.105.347	14.294.392

Zinssensitivitätslücke insgesamt

28.929.179	33.020.650	30.534.157
-------------------	-------------------	-------------------

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	Unter 1 USD	1-3 Monate USD	Über 3 Monate USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.211.247	5.321.204	11.889.154	249.542	22.671.147
Barmittel und Bargegenwerte	2.368.625	–	–	–	2.368.625
Margen auf Derivatkontrakte	924.226	–	–	–	924.226
Forderungen	–	–	–	17.900	17.900
Gesamtvermögen	8.504.098	5.321.204	11.889.154	267.442	25.981.898

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.263	100.030	16.831	188.337	308.461
Banküberziehung	189	–	–	–	189
Margen auf Derivatkontrakte	903.094	–	–	–	903.094
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	19.149	19.149
Verbindlichkeiten insgesamt	906.546	100.030	16.831	207.486	1.230.893

Zinssensitivitätslücke insgesamt

7.597.552	5.221.174	11.872.323
------------------	------------------	-------------------

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	57.308.675	–	–	553.007.664	610.316.339
Barmittel und Bargegenwerte	40.040.201	–	–	–	40.040.201
Margen auf Derivatkontrakte	4.903.000	–	–	–	4.903.000
Forderungen	–	–	–	245.269	245.269
Gesamtvermögen	102.251.876	–	–	553.252.933	655.504.899
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	37	37
Margen auf Derivatkontrakte	3.087.954	–	–	–	3.087.954
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	6.492.704	6.492.704
Verbindlichkeiten insgesamt	3.087.954	–	–	6.492.741	9.580.695
Zinssensitivitätslücke insgesamt	99.163.922	–	–		
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	340.778	99.824.631	84.254.309	3.415.514	187.835.232
Barmittel und Bargegenwerte	511.757	–	–	–	511.757
Margen auf Derivatkontrakte	536.577	–	–	–	536.577
Forderungen	–	–	–	3.010.979	3.010.979
Gesamtvermögen	1.389.112	99.824.631	84.254.309	6.426.493	191.894.545
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	363.707	363.707
Margen auf Derivatkontrakte	102.127	–	–	–	102.127
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	130.051	130.051
Verbindlichkeiten insgesamt	102.127	–	–	493.758	595.885
Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.286.985	99.824.631	84.254.309		

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	237.804	9.684.097	9.746.274	496.198	20.164.373
Barmittel und Bargegenwerte	218.419	–	–	–	218.419
Margen auf Derivatkontrakte	208.819	–	–	–	208.819
Forderungen	–	–	–	188.279	188.279
Gesamtvermögen	665.042	9.684.097	9.746.274	684.477	20.779.890

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	7.074	–	–	53.875	60.949
Margen auf Derivatkontrakte	4.801	–	–	–	4.801
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	22.835	22.835
Verbindlichkeiten insgesamt	11.875	–	–	76.710	88.585

Zinssensitivitätslücke insgesamt

653.167 9.684.097 9.746.274

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	9.808.281	844.981.241	1.016.554.823	14.611.501	1.885.955.846
Barmittel und Bargegenwerte	11.424.672	–	–	–	11.424.672
Margen auf Derivatkontrakte	2.872.146	–	–	–	2.872.146
Forderungen	–	–	–	25.040.073	25.040.073
Gesamtvermögen	24.105.099	844.981.241	1.016.554.823	39.651.574	1.925.292.737

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.062.188	–	–	2.130.766	3.192.954
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	791.611	791.611
Verbindlichkeiten insgesamt	1.062.188	–	–	2.922.377	3.984.565

Zinssensitivitätslücke insgesamt

23.042.911 844.981.241 1.016.554.823

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.564.975	336.764.736	364.123.455	10.502.720	713.955.886
Barmittel und Bargegenwerte	4.125.462	–	–	–	4.125.462
Margen auf Derivatkontrakte	3.485.548	–	–	–	3.485.548
Forderungen	–	–	–	12.806.102	12.806.102
Gesamtvermögen	10.175.985	336.764.736	364.123.455	23.308.822	734.372.998

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	4.088.433	4.088.433
Margen auf Derivatkontrakte	3.376.774	–	–	–	3.376.774
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	296.088	296.088
Verbindlichkeiten insgesamt	3.376.774	–	–	4.384.521	7.761.295

Zinssensitivitätslücke insgesamt

6.799.211	336.764.736	364.123.455
------------------	--------------------	--------------------

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	76.471	195.710.810	306.535.340	29.950.785	532.273.406
Barmittel und Bargegenwerte	11.409.759	–	–	–	11.409.759
Margen auf Derivatkontrakte	1.059.157	–	–	–	1.059.157
Forderungen	–	–	–	10.359.242	10.359.242
Gesamtvermögen	12.545.387	195.710.810	306.535.340	40.310.027	555.101.564

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	247.063	82.256	–	10.371	339.690
Banküberziehung	4	–	–	–	4
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	495.679	495.679
Verbindlichkeiten insgesamt	247.067	82.256	–	506.050	835.373

Zinssensitivitätslücke insgesamt

12.298.320	195.628.554	306.535.340
-------------------	--------------------	--------------------

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	27.476	7.160.065	24.751.740	9.510	31.948.791
Barmittel und Bargegenwerte	1.097.087	–	–	–	1.097.087
Margen auf Derivatkontrakte	182.622	–	–	–	182.622
Forderungen	–	–	–	427.361	427.361
Gesamtvermögen	1.307.185	7.160.065	24.751.740	436.871	33.655.861
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	40.411	–	–	5.140	45.551
Margen auf Derivatkontrakte	31.067	–	–	–	31.067
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	444.343	444.343
Verbindlichkeiten insgesamt	71.478	–	–	449.483	520.961
Zinssensitivitätslücke insgesamt	1.235.707	7.160.065	24.751.740		
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	34.596.758	68.598.981	910.828	104.106.567
Barmittel und Bargegenwerte	9.004.966	–	–	–	9.004.966
Margen auf Derivatkontrakte	258.000	–	–	–	258.000
Forderungen	–	–	–	1.915.398	1.915.398
Gesamtvermögen	9.262.966	34.596.758	68.598.981	2.826.226	115.284.931
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	481.453	481.453
Banküberziehung	118.027	–	–	–	118.027
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.125.721	1.125.721
Verbindlichkeiten insgesamt	118.027	–	–	1.607.174	1.725.201
Zinssensitivitätslücke insgesamt	9.144.939	34.596.758	68.598.981		

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.494	4.821.133	21.710.670	96.068	26.631.365
Barmittel und Bargegenwerte	1.028.474	–	–	–	1.028.474
Margen auf Derivatkontrakte	30.257	–	–	–	30.257
Forderungen	–	–	–	403.532	403.532
Gesamtvermögen	1.062.225	4.821.133	21.710.670	499.600	28.093.628

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.441	–	–	81.789	83.230
Margen auf Derivatkontrakte	5.427	–	–	–	5.427
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	121.683	121.683
Verbindlichkeiten insgesamt	6.868	–	–	203.472	210.340

Zinssensitivitätslücke insgesamt

1.055.357	4.821.133	21.710.670
------------------	------------------	-------------------

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.466.989	45.120.401	64.514.767	6.108.578	121.210.735
Barmittel und Bargegenwerte	2.766.010	–	–	–	2.766.010
Margen auf Derivatkontrakte	275.214	–	–	–	275.214
Forderungen	–	–	–	2.116.865	2.116.865
Gesamtvermögen	8.508.213	45.120.401	64.514.767	8.225.443	126.368.824

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	70.322	35.277	–	388.669	494.268
Banküberziehung	191	–	–	–	191
Margen auf Derivatkontrakte	28.331	–	–	–	28.331
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	168.709	168.709
Verbindlichkeiten insgesamt	98.844	35.277	–	557.378	691.499

Zinssensitivitätslücke insgesamt

8.409.369	45.085.124	64.514.767
------------------	-------------------	-------------------

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Euroland Bond Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.217.220	109.096.315	156.948.646	2.838.033	270.100.214
Barmittel und Bargegenwerte	4.325.469	–	–	–	4.325.469
Margen auf Derivatkontrakte	4.982.507	–	–	–	4.982.507
Forderungen	–	–	–	1.689.892	1.689.892
Gesamtvermögen	10.525.196	109.096.315	156.948.646	4.527.925	281.098.082

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	261.581	–	–	267.752	529.333
Margen auf Derivatkontrakte	4.016.798	–	–	–	4.016.798
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	629.778	629.778
Verbindlichkeiten insgesamt	4.278.379	–	–	897.530	5.175.909

Zinssensitivitätslücke insgesamt

6.246.817 109.096.315 156.948.646

BNY Mellon European Credit Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	267.022	19.796.146	18.057.439	1.476.635	39.597.242
Barmittel und Bargegenwerte	1.036.134	–	–	–	1.036.134
Margen auf Derivatkontrakte	630.660	–	–	–	630.660
Forderungen	–	–	–	251.041	251.041
Gesamtvermögen	1.933.816	19.796.146	18.057.439	1.727.676	41.515.077

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.997	111.371	–	29.711	148.079
Margen auf Derivatkontrakte	614.360	–	–	–	614.360
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	14.429	14.429
Verbindlichkeiten insgesamt	621.357	111.371	–	44.140	776.868

Zinssensitivitätslücke insgesamt

1.312.459 19.684.775 18.057.439

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Bond Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.225.979	158.672.376	235.130.383	26.149.679	428.178.417
Barmittel und Bargegenwerte	6.370.439	–	–	–	6.370.439
Margen auf Derivatkontrakte	503.154	–	–	–	503.154
Forderungen	–	–	–	4.237.696	4.237.696
Gesamtvermögen	15.099.572	158.672.376	235.130.383	30.387.375	439.289.706

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	1.982.261	1.982.261
Banküberziehung	754	–	–	–	754
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.624.330	2.624.330
Verbindlichkeiten insgesamt	754	–	–	4.606.591	4.607.345

Zinssensitivitätslücke insgesamt

15.098.818	158.672.376	235.130.383
-------------------	--------------------	--------------------

BNY Mellon Global Credit Fund	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.728.464	175.844.189	260.606.312	2.417.174	440.596.139
Barmittel und Bargegenwerte	3.640.662	–	–	–	3.640.662
Margen auf Derivatkontrakte	12.238.567	–	–	–	12.238.567
Forderungen	–	–	–	2.916.640	2.916.640
Gesamtvermögen	17.607.693	175.844.189	260.606.312	5.333.814	459.392.008

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.806.506	4.948.648	–	4.259.137	13.014.291
Margen auf Derivatkontrakte	3.281.263	–	–	–	3.281.263
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	134.500	134.500
Verbindlichkeiten insgesamt	7.087.769	4.948.648	–	4.393.637	16.430.054

Zinssensitivitätslücke insgesamt

10.519.924	170.895.541	260.606.312
-------------------	--------------------	--------------------

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	17.924.037	260.065.100	96.409.600	25.199.905	399.598.642
Barmittel und Bargegenwerte	19.333.211	–	–	–	19.333.211
Margen auf Derivatkontrakte	150.834	–	–	–	150.834
Forderungen	–	–	–	19.672.505	19.672.505
Gesamtvermögen	37.408.082	260.065.100	96.409.600	44.872.410	438.755.192
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	1.874.889	1.874.889
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	14.610	–	–	–	14.610
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	3.872.199	3.872.199
Verbindlichkeiten insgesamt	14.611	–	–	5.747.088	5.761.699
Zinssensitivitätslücke insgesamt	37.393.471	260.065.100	96.409.600		
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	62.780.828	96.286.036	172.172	159.239.036
Barmittel und Bargegenwerte	5.521.790	–	–	–	5.521.790
Forderungen	–	–	–	3.472.987	3.472.987
Gesamtvermögen	5.521.790	62.780.828	96.286.036	3.645.159	168.233.813
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	163.678	163.678
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	1.376.440	1.376.440
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	1.540.118	1.540.118
Zinssensitivitätslücke insgesamt	5.521.790	62.780.828	96.286.036		

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 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	32.669.415	128.570.880	49.544.114	2.520.352.431	2.731.136.840
Barmittel und Bargegenwerte	397.401.682	–	–	–	397.401.682
Margen auf Derivatkontrakte	50.734.594	–	–	–	50.734.594
Forderungen	–	–	–	12.902.491	12.902.491
Gesamtvermögen	480.805.691	128.570.880	49.544.114	2.533.254.922	3.192.175.607

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	20.968.937	–	–	44.019.460	64.988.397
Banküberziehung	10	–	–	–	10
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.458.441	5.458.441
Verbindlichkeiten insgesamt	20.968.947	–	–	49.477.901	70.446.848

Zinssensitivitätslücke insgesamt

459.836.744	128.570.880	49.544.114
--------------------	--------------------	-------------------

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	Unter 1 Jahr GBP	1-6 Jahre GBP	Über 6 Jahre GBP	Unver- zinslich GBP	Gesamt 2021 GBP
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.268.513	2.472.414	877.186	51.297.194	58.915.307
Barmittel und Bargegenwerte	6.793.574	–	–	–	6.793.574
Margen auf Derivatkontrakte	591.125	–	–	–	591.125
Forderungen	–	–	–	258.543	258.543
Gesamtvermögen	11.653.212	2.472.414	877.186	51.555.737	66.558.549

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	423.460	–	–	180.785	604.245
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	57.258	57.258
Verbindlichkeiten insgesamt	423.461	–	–	238.043	661.504

Zinssensitivitätslücke insgesamt

11.229.751	2.472.414	877.186
-------------------	------------------	----------------

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	32.392.855	10.979.940	4.325.195	340.765.144	388.463.134
Barmittel und Bargegenwerte	50.536.285	–	–	–	50.536.285
Margen auf Derivatkontrakte	1.513.097	–	–	–	1.513.097
Forderungen	–	–	–	3.316.294	3.316.294
Gesamtvermögen	84.442.237	10.979.940	4.325.195	344.081.438	443.828.810
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.860.573	–	–	362.098	3.222.671
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.996.804	2.996.804
Verbindlichkeiten insgesamt	2.860.573	–	–	3.358.902	6.219.475
Zinssensitivitätslücke insgesamt	81.581.664	10.979.940	4.325.195		
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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	116.058	650.718.926	49.851.123	85.495.748	786.181.855
Barmittel und Bargegenwerte	4.463.781	–	–	–	4.463.781
Forderungen	–	–	–	16.500.236	16.500.236
Gesamtvermögen	4.579.839	650.718.926	49.851.123	101.995.984	807.145.872
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	1.769.339	1.769.339
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	12.803.161	12.803.161
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	14.572.500	14.572.500
Zinssensitivitätslücke insgesamt	4.579.839	650.718.926	49.851.123		

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	1.568.110	3.866.625	24.323.376	29.758.111
Barmittel und Bargegenwerte	2.876.300	–	–	–	2.876.300
Forderungen	–	–	–	57.974	57.974
Gesamtvermögen	2.876.300	1.568.110	3.866.625	24.381.350	32.692.385
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	136.007	136.007
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	5.277	5.277
Verbindlichkeiten insgesamt	–	–	–	141.284	141.284
Zinssensitivitätslücke insgesamt	2.876.300	1.568.110	3.866.625		

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	15.913.323	197.953.131	89.640.187	1.546.746	305.053.387
Barmittel und Bargegenwerte	22.038.050	–	–	–	22.038.050
Margen auf Derivatkontrakte	3.234.182	–	–	–	3.234.182
Forderungen	–	–	–	3.130.232	3.130.232
Gesamtvermögen	41.185.555	197.953.131	89.640.187	4.676.978	333.455.851
Verbindlichkeiten					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	4.219.461	4.219.461
Margen auf Derivatkontrakte	12.011	–	–	–	12.011
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	601.536	601.536
Verbindlichkeiten insgesamt	12.011	–	–	4.820.997	4.833.008
Zinssensitivitätslücke insgesamt	41.173.544	197.953.131	89.640.187		

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 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	644.689	1.811.439	516.289	62.669.734	65.642.151
Barmittel und Bargegenwerte	13.218.317	–	–	–	13.218.317
Margen auf Derivatkontrakte	660.451	–	–	–	660.451
Forderungen	–	–	–	437.381	437.381
Gesamtvermögen	14.523.457	1.811.439	516.289	63.107.115	79.958.300

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	484.867	–	–	993.467	1.478.334
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	83.163	83.163
Verbindlichkeiten insgesamt	484.867	–	–	1.076.630	1.561.497

Zinssensitivitätslücke insgesamt **14.038.590** **1.811.439** **516.289**

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	Unter 1 Jahr USD	1-6 Jahre USD	Über 6 Jahre USD	Unver- zinslich USD	Gesamt 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	7.131.983	32.232.714	52.023.217	1.951.732	93.339.646
Barmittel und Bargegenwerte	4.603.483	–	–	–	4.603.483
Margen auf Derivatkontrakte	1.129.078	–	–	–	1.129.078
Forderungen	–	–	–	529.962	529.962
Gesamtvermögen	12.864.544	32.232.714	52.023.217	2.481.694	99.602.169

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	122.825	–	–	162.053	284.878
Margen auf Derivatkontrakte	501.225	–	–	–	501.225
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	7.292.953	7.292.953
Verbindlichkeiten insgesamt	624.050	–	–	7.455.006	8.079.056

Zinssensitivitätslücke insgesamt **12.240.494** **32.232.714** **52.023.217**

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 2021 USD
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.519.202	96.288.463	891.859.486	3.695.769	993.362.920
Barmittel und Bargegenwerte	5.645.506	–	–	–	5.645.506
Forderungen	–	–	–	10.248.486	10.248.486
Gesamtvermögen	7.164.708	96.288.463	891.859.486	13.944.255	1.009.256.912

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	29.655	29.655
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	2.144.533	2.144.533

Verbindlichkeiten insgesamt

–	–	–	2.174.188	2.174.188
---	---	---	-----------	-----------

Zinssensitivitätslücke insgesamt

7.164.708	96.288.463	891.859.486
-----------	------------	-------------

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	Unter 1 Jahr EUR	1-6 Jahre EUR	Über 6 Jahre EUR	Unver- zinslich EUR	Gesamt 2021 EUR
Vermögenswerte					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	36.675.038	456.281.108	457.677.641	34.951	950.668.738
Barmittel und Bargegenwerte	27.180.236	–	–	–	27.180.236
Margen auf Derivatkontrakte	2.078.380	–	–	–	2.078.380
Forderungen	–	–	–	7.427.155	7.427.155
Gesamtvermögen	65.933.654	456.281.108	457.677.641	7.462.106	987.354.509

Verbindlichkeiten

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	206.623	1.295.007	–	605.016	2.106.646
Margen auf Derivatkontrakte	128.275	–	–	–	128.275
Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge)	–	–	–	883.784	883.784

Verbindlichkeiten insgesamt

334.898	1.295.007	–	1.488.800	3.118.705
---------	-----------	---	-----------	-----------

Zinssensitivitätslücke insgesamt

65.598.756	454.986.101	457.677.641
------------	-------------	-------------

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

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 2021: 25 Bp.).

Bei einem angenommenen Anstieg der Zinsen um 31. Dezember 2022 um 75 Bp. (31. Dezember 2021: 25 Bp.) bei ansonsten konstanten Variablen hätte sich der Gesamtertrag der Fonds umgehend wie nachfolgend aufgeführt verändert. Ein Rückgang um 75 Bp. (31. Dezember 2021: 25 Bp.) hätte analoge, aber entgegengesetzte Auswirkungen auf die Gesamterträge der Fonds).

Fonds	Funktionale Währung	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2022	Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2021
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	2,730	0,928
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	4,598	1,588
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	USD	3,893	1,508
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	2,918	0,973
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	3,525	1,300
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	4,425	1,200
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	4,540	1,933
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	1,598	0,265
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	0,364	0,052
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	3,203	1,148
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	EUR	3,293	k. A.

* 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.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2022 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlichkeiten	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)
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)	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
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	–
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	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts.						
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)
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)	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
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	–	–	–
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

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
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)
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	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.						
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)

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 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 Food 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 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	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Future Life Fund Forts.						
	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)
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)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
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)
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 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	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Global Equity Income Fund						
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	–	–	–
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)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
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)
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)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
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)
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	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
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	–
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)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*						
		USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real		664.490	1.933	–	662.557	–
Chinesischer Yuan		2.517.275	–	–	2.517.275	–
Dänische Krone		194.240	–	–	194.240	–
Euro		705.637	–	–	705.637	–
Hongkong-Dollar		1.130.311	–	–	1.130.311	–
Indische Rupie		2.893.237	–	(4)	2.893.241	–
Indonesische Rupiah		346.456	–	–	346.456	–
Koreanischer Won		190.237	–	–	190.237	–
Mexikanischer Peso		144.450	–	–	144.450	–
Südafrikanischer Rand		490.958	–	–	490.958	–
Taiwan-Dollar		779.937	–	–	779.937	–
		10.057.228	1.933	(4)	10.055.299	–

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	–	–	–
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)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2022	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
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)

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.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2021 ausgesetzt war:

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Ver- bindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar		(1.099.512)	12.655.841	–	–	(13.755.353)
Brasilianischer Real		(163.687)	3.122.537	–	–	(3.286.224)
Kanadischer Dollar		1.712.586	566	–	–	1.712.020
Chilenischer Peso		48.530	1.582.968	–	–	(1.534.438)
Chinesischer Yuan		86.000	16.397.058	–	–	(16.311.058)
Kolumbianischer Peso		44.626	1.286.778	–	–	(1.242.152)
Tschechische Krone		(1.423.430)	24	–	–	(1.423.454)
Ägyptisches Pfund		2.741.605	2.741.605	–	–	–
Hongkong-Dollar		39	39	–	–	–
Ungarischer Forint		883.859	1	–	–	883.858
Indische Rupie		1.180.737	–	–	–	1.180.737
Indonesische Rupiah		(1.204.428)	–	–	–	(1.204.428)
Japanischer Yen		(294.515)	24.510.932	–	–	(24.805.447)
Kasachischer Tenge		607.118	607.118	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Koreanischer Won		(18.561)	–	–	–	(18.561)
Mexikanischer Peso		(279.310)	3.856.323	–	–	(4.135.633)
Neuseeländischer Dollar		148.788	22.332	–	–	126.456
Norwegische Krone		(3.579)	14.138	–	–	(17.717)
Polnischer Zloty		(131.637)	–	–	–	(131.637)
Rumänischer Leu		(53.493)	528.932	–	–	(582.425)
Russischer Rubel		1.268.185	2.719.569	–	–	(1.451.384)
Südafrikanischer Rand		80.306	1.372.979	–	–	(1.292.673)
Pfund Sterling		2.383.940	48.162.168	(247.049)	–	(45.531.179)
Schwedische Krone		504.453	462	–	–	503.991
Schweizer Franken		(191.749)	–	–	–	(191.749)
Thailändischer Baht		911.624	125	–	–	911.499
US-Dollar		(2.527.078)	92.989.192	(6.328.817)	38.545.235	(127.732.688)
		5.211.417	212.571.687	(6.575.866)	38.545.235	(239.329.639)

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Kanadischer Dollar	61.307	61.307	–	–	–
Dänische Krone	136.493	154.893	(18.400)	–	–
Euro	(3.518.927)	3.987.911	(1.960.105)	1.275.598	(6.822.331)
Norwegische Krone	170.879	170.879	–	–	–
Schwedische Krone	17.549	218.250	(200.701)	–	–
Schweizer Franken	2.363.751	249.077	(145.535)	2.260.209	–
US-Dollar	3.287.932	180.212	(76.933)	3.184.653	–
	2.518.984	5.022.529	(2.401.674)	6.720.460	(6.822.331)

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	5.017	5.017	–	–	–
Dänische Krone	40.351	40.351	–	–	–
Hongkong-Dollar	205.477	299.350	(93.873)	–	–
Japanischer Yen	117.802	242.232	(124.430)	–	–
Pfund Sterling	54.386	111.916	(57.530)	–	–
Schwedische Krone	4.860	4.860	–	–	–
Schweizer Franken	159.552	1.790.306	(1.630.754)	–	–
US-Dollar	1.884.955	12.343.169	(9.581.011)	–	(877.203)
	2.472.400	14.837.201	(11.487.598)	–	(877.203)

BNY Mellon Asian Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	1.273.553	–	–	1.273.553	–
Chinesischer Yuan	209.001	–	–	209.001	–
Euro	6.700	17.268	–	–	(10.568)
Hongkong-Dollar	2.584.477	14.468	–	2.570.009	–
Indonesische Rupiah	762.735	–	–	762.735	–
Koreanischer Won	1.631.246	–	–	1.631.246	–
Neuseeländischer Dollar	705.032	–	–	705.032	–
Singapur-Dollar	2.587.372	–	–	2.587.372	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Asian Income Fund Forts.						
Pfund Sterling		612.953	–	(327)	612.953	327
Taiwan-Dollar		2.633.758	5.926	–	2.627.832	–
Thailändischer Baht		519.217	–	–	519.217	–
		13.526.044	37.662	(327)	13.498.950	(10.241)

BNY Mellon Asian Opportunities Fund*

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.209.365	–	–	3.209.365	–
Chinesischer Yuan	9.460.697	–	–	9.460.697	–
Euro	1.700.678	–	(47.055)	1.703.630	44.103
Hongkong-Dollar	12.405.687	–	–	12.405.687	–
Indische Rupie	16.928.641	7.075	(311.766)	17.233.332	–
Indonesische Rupiah	903.771	–	–	903.771	–
Koreanischer Won	4.117.514	–	–	4.117.514	–
Philippinischer Peso	11	–	–	11	–
Taiwan-Dollar	6.511.683	539.902	–	5.971.781	–
	55.238.047	546.977	(358.821)	55.005.788	44.103

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.216.244	41.623	–	3.174.621	–
Kanadischer Dollar	7.254.272	912	–	7.253.360	–
Dänische Krone	2.714.423	11.441	–	2.702.982	–
Euro	7.016.558	3.088	–	7.013.470	–
Hongkong-Dollar	510	510	–	–	–
Japanischer Yen	3.143.068	8.416	–	3.134.652	–
Koreanischer Won	4.572.724	62.657	–	4.510.067	–
Singapur-Dollar	1.018.489	28.971	–	989.518	–
Pfund Sterling	65	65	–	–	–
Schweizer Franken	1.066.885	13.169	–	1.053.716	–
	30.003.238	170.852	–	29.832.386	–

BNY Mellon Brazil Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	33.209.721	2.216.232	–	30.993.489	–
Euro	538.777	538.777	–	–	–
Pfund Sterling	5.873	5.873	–	–	–
	33.754.371	2.760.882	–	30.993.489	–

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	(1.030.659)	15.516	(27.422)	–	(1.018.753)
Brasilianischer Real	94.338	6.117	–	–	88.221
Kanadischer Dollar	(1.381.004)	41.780	(8)	–	(1.422.776)
Tschechische Krone	522.770	–	–	–	522.770
Euro	(1.255.536)	593.518	(24.805)	–	(1.824.249)
Hongkong-Dollar	(2.451)	15	(2.466)	–	–
Ungarischer Forint	(192.477)	–	–	–	(192.477)
Indische Rupie	2.246.714	–	–	–	2.246.714
Indonesische Rupiah	1.654.374	–	–	–	1.654.374
Israelischer Schekel	257.473	–	–	–	257.473
Japanischer Yen	(1.472.418)	1.565	(24.808)	–	(1.449.175)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Koreanischer Won		(423.739)	462	(15.779)	–	(408.422)
Malaysischer Ringgit		671.383	–	–	–	671.383
Mexikanischer Peso		791.020	–	–	–	791.020
Neuseeländischer Dollar		(136.825)	–	–	–	(136.825)
Norwegische Krone		(623.715)	–	–	–	(623.715)
Philippinischer Peso		864.780	–	–	–	864.780
Polnischer Zloty		(222.190)	–	–	–	(222.190)
Russischer Rubel		720.060	–	–	–	720.060
Singapur-Dollar		(189)	–	(189)	–	–
Südafrikanischer Rand		219.292	8.052	–	–	211.240
Pfund Sterling		(1.187.592)	34.796	(4.573)	–	(1.217.815)
Schwedische Krone		(1.188.126)	18.845	(13)	–	(1.206.958)
Schweizer Franken		(219.895)	–	–	–	(219.895)
		(1.294.612)	720.666	(100.063)	–	(1.915.215)

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	6.004.334	141.054	–	–	5.863.280
Pfund Sterling	29.901	29.901	–	–	–
	6.034.235	170.955	–	–	5.863.280

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	(295.788)	38.847.142	–	–	(39.142.930)
Pfund Sterling	(50.925)	4.435.986	–	–	(4.486.911)
	(346.713)	43.283.128	–	–	(43.629.841)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar	(7.856)	827.467	(2.888)	–	(832.435)
Euro	(39.486)	4.743.663	(3.872)	–	(4.779.277)
Japanischer Yen	(314)	–	(314)	–	–
Pfund Sterling	(532)	866.261	–	–	(866.793)
	(48.188)	6.437.391	(7.074)	–	(6.478.505)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	130.943	130.943	–	–	–
Pfund Sterling	337	337	–	–	–
	131.280	131.280	–	–	–

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	770.561	31.380.619	–	–	(30.610.058)
Hongkong-Dollar	1.396	1.396	–	–	–
Kasachischer Tenge	809.477	809.477	–	–	–
Russischer Rubel	3.119.307	3.318.311	–	–	(199.004)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		1.090	1.090	–	–	–
Schweizer Franken		(4)	–	(4)	–	–
		4.701.827	35.510.893	(4)	–	(30.809.062)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	24.078	470.305	–	–	(446.227)
Pfund Sterling	400	400	–	–	–
	24.478	470.705	–	–	(446.227)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso	525	525	–	–	–
Brasilianischer Real	9.776.406	5.990.963	–	–	3.785.443
Chilenischer Peso	4.404.385	6.559.098	–	–	(2.154.713)
Chinesischer Yuan	11.081.077	18.025.181	–	–	(6.944.104)
Kolumbianischer Peso	6.742.758	9.692.356	–	–	(2.949.598)
Tschechische Krone	3.590.553	2.825.036	–	–	765.517
Euro	29.978	–	(118.027)	–	148.005
Hongkong-Dollar	(3.393.412)	–	–	–	(3.393.412)
Ungarischer Forint	5.697.077	1.892.062	–	–	3.805.015
Indische Rupie	1.702.738	–	–	–	1.702.738
Indonesische Rupiah	8.477.078	8.091.698	–	–	385.380
Malaysischer Ringgit	9.724.083	4.230.735	–	–	5.493.348
Mexikanischer Peso	11.239.291	14.109.632	–	–	(2.870.341)
Peruanischer neuer Sol	1.238.469	1.640.324	–	–	(401.855)
Philippinischer Peso	154.384	–	–	–	154.384
Polnischer Zloty	10.045.445	–	–	–	10.045.445
Rumänischer Leu	1.159.424	560.719	–	–	598.705
Russischer Rubel	10.987.052	13.666.414	–	–	(2.679.362)
Südafrikanischer Rand	9.555.564	13.561.669	–	–	(4.006.105)
Pfund Sterling	22.713	22.713	–	–	–
Schweizer Franken	37	37	–	–	–
Taiwan-Dollar	(2.263.646)	–	–	–	(2.263.646)
Thailändischer Baht	11.589.862	4.153.250	–	–	7.436.612
Türkische Lira	746.836	–	–	–	746.836
Uruguayischer Peso	118.994	118.994	–	–	–
	112.427.671	105.141.406	(118.027)	–	7.404.292

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Argentinischer Peso	818	818	–	–	–
Brasilianischer Real	1.191.310	863.681	–	–	327.629
Chilenischer Peso	835.323	1.332.556	–	–	(497.233)
Chinesischer Yuan	1.366.146	1.967.394	–	–	(601.248)
Kolumbianischer Peso	1.097.552	831.394	–	–	266.158
Tschechische Krone	232.963	287.058	–	–	(54.095)
Euro	(4.350)	356.867	–	–	(361.217)
Hongkong-Dollar	(982.371)	–	–	–	(982.371)
Ungarischer Forint	873.475	268.721	–	–	604.754
Indische Rupie	421.525	–	–	–	421.525
Indonesische Rupiah	636.645	845.550	–	–	(208.905)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Malaysischer Ringgit		1.185.376	391.706	–	–	793.670
Mexikanischer Peso		1.367.220	1.716.426	–	–	(349.206)
Peruanischer neuer Sol		8.874	245.994	–	–	(237.120)
Philippinischer Peso		20.023	–	–	–	20.023
Polnischer Zloty		1.424.483	–	–	–	1.424.483
Rumänischer Leu		(129.018)	24.086	–	–	(153.104)
Russischer Rubel		1.660.374	2.298.424	–	–	(638.050)
Südafrikanischer Rand		1.125.840	1.878.849	–	–	(753.009)
Pfund Sterling		421	421	–	–	–
Taiwan-Dollar		(553.352)	–	–	–	(553.352)
Thailändischer Baht		1.521.496	748.775	–	–	772.721
Türkische Lira		23.472	–	–	–	23.472
Uruguayischer Peso		39.755	39.755	–	–	–
		13.364.000	14.098.475	–	–	(734.475)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	3.327.012	6.195.099	–	–	(2.868.087)
Chilenischer Peso	865.371	3.964.811	–	–	(3.099.440)
Chinesischer Yuan	4.147.044	2.201.959	–	–	1.945.085
Kolumbianischer Peso	1.647.822	3.886.934	–	–	(2.239.112)
Tschechische Krone	(4.107)	431.425	–	–	(435.532)
Ägyptisches Pfund	4.787.229	4.787.229	–	–	–
Euro	1.135.672	13.131.720	–	–	(11.996.048)
Ungarischer Forint	2.939.216	623.456	–	–	2.315.760
Indische Rupie	1.891.944	–	–	–	1.891.944
Indonesische Rupiah	1.621.101	743.339	–	–	877.762
Israelischer Sheckel	250	250	–	–	–
Kasachischer Tenge	485.905	485.905	–	–	–
Malaysischer Ringgit	3.546.826	1.638.184	(191)	–	1.908.833
Mexikanischer Peso	4.264.529	7.361.110	–	–	(3.096.581)
Peruanischer neuer Sol	914.353	914.353	–	–	–
Polnischer Zloty	3.073.612	34	–	–	3.073.578
Rumänischer Leu	1.429.540	167	–	–	1.429.373
Russischer Rubel	4.935.063	5.994.493	–	–	(1.059.430)
Südafrikanischer Rand	3.510.235	7.379.268	–	–	(3.869.033)
Pfund Sterling	488	488	–	–	–
Thailändischer Baht	5.693.585	1.349.687	–	–	4.343.898
Türkische Lira	739	739	–	–	–
	50.213.429	61.090.650	(191)	–	(10.877.030)

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Chinesischer Yuan	20.246	4.107.121	–	–	(4.086.875)
Indische Rupie	(431.615)	–	–	–	(431.615)
Japanischer Yen	1.959	1.959	–	–	–
Mexikanischer Peso	(104.236)	5.033.984	–	–	(5.138.220)
Norwegische Krone	(366.294)	17.395.709	–	–	(17.762.003)
Russischer Rubel	(77.876)	1.480.784	–	–	(1.558.660)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		(94.668)	47.854	–	–	(142.522)
Schwedische Krone		(697.549)	–	–	–	(697.549)
Schweizer Franken		3.588	3.588	–	–	–
Taiwan-Dollar		(1.137.134)	–	–	–	(1.137.134)
US-Dollar		215.125	33.412.096	(95.931)	2.426.564	(35.527.604)
		(2.668.454)	61.483.095	(95.931)	2.426.564	(66.482.182)

BNY Mellon European Credit Fund

		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling		193.181	394	–	–	192.787
US-Dollar		434.825	303.450	(6.052)	1.473.494	(1.336.067)
		628.006	303.844	(6.052)	1.473.494	(1.143.280)

BNY Mellon Future Earth Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone		125.442	–	–	125.442	–
Euro		210.723	–	–	210.723	–
Hongkong-Dollar		14.230	–	–	14.230	–
Japanischer Yen		431.601	–	–	431.601	–
Koreanischer Won		65.619	–	–	65.619	–
Norwegische Krone		111.332	–	–	111.332	–
Pfund Sterling		351.075	–	–	351.075	–
		1.310.022	–	–	1.310.022	–

BNY Mellon Future Food Fund**

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		18.572	–	–	18.572	–
Kanadischer Dollar		92.634	–	–	92.634	–
Dänische Krone		133.246	–	–	133.246	–
Euro		527.859	–	–	527.859	–
Hongkong-Dollar		67.173	–	–	67.173	–
Japanischer Yen		166.995	–	–	166.995	–
Mexikanischer Peso		75.356	722	–	74.634	–
Norwegische Krone		146.573	–	–	146.573	–
Pfund Sterling		122.466	–	–	122.466	–
Schweizer Franken		246.629	–	–	246.629	–
		1.597.503	722	–	1.596.781	–

BNY Mellon Future Life Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		33.081	–	–	33.081	–
Dänische Krone		113.744	–	–	113.744	–
Euro		181.349	–	–	181.349	–
Hongkong-Dollar		101.406	–	–	101.406	–
Japanischer Yen		85.303	–	–	85.303	–
Südafrikanischer Rand		22.032	–	–	22.032	–
Pfund Sterling		231.347	–	–	231.347	–
Schweizer Franken		327.017	–	–	327.017	–
		1.095.279	–	–	1.095.279	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
		USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Global Bond Fund						
Australischer Dollar		7.857.473	15.249.838	–	–	(7.392.365)
Kanadischer Dollar		9.019.659	19.880.257	–	–	(10.860.598)
Kolumbianischer Peso		6.038.346	6.038.346	–	–	–
Tschechische Krone		(189.065)	9.951.584	(754)	–	(10.139.895)
Dänische Krone		1.793.647	5.760.251	–	–	(3.966.604)
Euro		85.578.388	101.752.074	–	–	(16.173.686)
Ungarischer Forint		6.641.449	–	–	–	6.641.449
Indische Rupie		(50.900)	2.219.627	–	–	(2.270.527)
Indonesische Rupiah		(293.244)	6.287.192	–	–	(6.580.436)
Japanischer Yen		86.559.107	32.179.621	–	–	54.379.486
Koreanischer Won		3	–	–	–	3
Malaysischer Ringgit		(53.528)	4.323.281	–	–	(4.376.809)
Mexikanischer Peso		5.774.323	6.876.991	–	–	(1.102.668)
Neuseeländischer Dollar		6.614.435	15.460.797	–	–	(8.846.362)
Philippinischer Peso		(6.414.759)	–	–	–	(6.414.759)
Polnischer Zloty		4.427.926	–	–	–	4.427.926
Südafrikanischer Rand		(6.524.614)	–	–	–	(6.524.614)
Pfund Sterling		24.585.475	15.237.801	–	–	9.347.674
Schwedische Krone		1.028.815	4.140.511	–	–	(3.111.696)
		232.392.936	245.358.171	(754)	–	(12.964.481)

BNY Mellon Global Credit Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(195.724)	11.271.197	–	–	(11.466.921)
Brasilianischer Real		60.186	611.483	–	–	(551.297)
Kanadischer Dollar		605.010	268.669	–	–	336.341
Chilenischer Peso		5.916	–	–	–	5.916
Chinesischer Yuan		270.956	–	–	–	270.956
Kolumbianischer Peso		60.988	–	–	–	60.988
Tschechische Krone		(73.135)	–	–	–	(73.135)
Euro		(6.793.877)	161.266.539	(8.335.500)	–	(159.724.916)
Ungarischer Forint		7.971	3	–	–	7.968
Indische Rupie		50.407	–	–	–	50.407
Indonesische Rupiah		16.625	–	–	–	16.625
Japanischer Yen		120.484	584.021	–	–	(463.537)
Mexikanischer Peso		(107.912)	7	–	–	(107.919)
Neuseeländischer Dollar		(157.321)	19.710	–	–	(177.031)
Norwegische Krone		260.371	12.761	–	–	247.610
Polnischer Zloty		(63.991)	92	–	–	(64.083)
Russischer Rubel		(474)	–	–	–	(474)
Südafrikanischer Rand		(12.418)	59	–	–	(12.477)
Pfund Sterling		639.788	63.741.131	–	–	(63.101.343)
Schwedische Krone		177.728	–	–	–	177.728
Schweizer Franken		(274.446)	136	–	–	(274.582)
		(5.402.868)	237.775.808	(8.335.500)	–	(234.843.176)

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(301.050)	11.245.072	–	–	(11.546.122)
Kanadischer Dollar		(175.901)	28.569.286	–	–	(28.745.187)
Kolumbianischer Peso		5.579.121	5.579.121	–	–	–
Tschechische Krone		(423.788)	8.637.981	–	–	(9.061.769)
Euro		(16.415.959)	87.717.181	–	–	(104.133.140)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
	Ungarischer Forint	6.600.250	–	–	–	6.600.250
	Indische Rupie	(88.382)	3.117.922	–	–	(3.206.304)
	Indonesische Rupiah	(294.629)	5.573.776	–	–	(5.868.405)
	Japanischer Yen	6.384.640	6.696.264	–	–	(311.624)
	Koreanischer Won	(3)	–	–	–	(3)
	Malaysischer Ringgit	(39.815)	3.260.921	–	–	(3.300.736)
	Mexikanischer Peso	5.742.551	7.140.918	–	–	(1.398.367)
	Neuseeländischer Dollar	6.644.275	11.459.580	–	–	(4.815.305)
	Philippinischer Peso	(6.433.636)	–	–	–	(6.433.636)
	Polnischer Zloty	4.445.117	–	–	–	4.445.117
	Südafrikanischer Rand	(6.600.153)	–	–	–	(6.600.153)
	Pfund Sterling	(6.670.303)	42.564.131	–	6.620.068	(55.854.502)
	Schwedische Krone	219.454	1.703.660	–	–	(1.484.206)
	Schweizer Franken	(1)	–	(1)	–	–
		(1.828.212)	223.265.813	(1)	6.620.068	(231.714.092)

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*

	USD	USD	USD	USD	USD
Brasilianischer Real	590.098	7.917	–	590.098	(7.917)
Chinesischer Yuan	7.588.545	–	–	7.588.545	–
Euro	1.430.921	–	(3.576)	1.430.921	3.576
Hongkong-Dollar	10.140.030	–	–	10.140.030	–
Ungarischer Forint	509.439	–	(3)	509.442	–
Indische Rupie	13.846.778	69.516	(185.048)	13.962.310	–
Japanischer Yen	1.240.358	–	–	1.240.358	–
Koreanischer Won	2.966.899	–	–	2.966.899	–
Malaysischer Ringgit	409	409	–	–	–
Mexikanischer Peso	884.631	8.476	–	876.155	–
Südafrikanischer Rand	595.960	–	–	595.960	–
Taiwan-Dollar	3.832.177	292.743	–	3.539.434	–
	43.626.245	379.061	(188.627)	43.440.152	(4.341)

BNY Mellon Global Equity Fund**

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	6.457.303	–	–	6.457.303	–
Euro	73.000.437	173.036	–	72.827.401	–
Hongkong-Dollar	18.941.621	–	–	18.941.621	–
Indische Rupie	4.858.344	225	–	4.858.119	–
Japanischer Yen	30.805.605	–	–	30.805.605	–
Koreanischer Won	10.067.267	–	–	10.067.267	–
Pfund Sterling	35.898.836	–	–	35.898.836	–
Schwedische Krone	8.247.163	–	–	8.247.163	–
Schweizer Franken	22.483.145	–	–	22.483.145	–
	210.759.721	173.261	–	210.586.460	–

BNY Mellon Global Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	3.827.877	53.555	–	3.774.322	–
Euro	59.914.527	–	(544.528)	59.968.762	490.293
Hongkong-Dollar	9.907.815	164.197	–	9.743.618	–
Japanischer Yen	4.127.328	–	–	4.127.328	–
Koreanischer Won	9.268.104	–	–	9.268.104	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
	Pfund Sterling	76.345.244	27.074	–	76.318.170	–
	Schwedische Krone	7.709.802	–	–	7.709.802	–
	Schweizer Franken	48.023.798	–	–	48.023.798	–
	Taiwan-Dollar	1.813	1.813	–	–	–
		219.126.308	246.639	(544.528)	218.933.904	490.293

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	608.812	34.673.733	–	–	(34.064.921)
Pfund Sterling	(111.077)	9.301.315	–	–	(9.412.392)
	497.735	43.975.048	–	–	(43.477.313)

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Kanadischer Dollar	17.708.884	22.544	–	17.686.340	–
Euro	99.769.037	15.312	–	99.753.725	–
Hongkong-Dollar	5.627.429	27.980	–	5.599.449	–
Israelischer Schekel	1.595	1.595	–	–	–
Norwegische Krone	863	863	–	–	–
Singapur-Dollar	376.631	376.631	–	–	–
Pfund Sterling	10.922.392	559	–	10.921.833	–
	134.406.831	445.484	–	133.961.347	–

BNY Mellon Global Leaders Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2.430.773	–	–	2.430.773	–
Dänische Krone	3.086.481	–	–	3.086.481	–
Euro	9.836.452	–	–	9.836.452	–
Hongkong-Dollar	4.335.799	–	–	4.335.799	–
Japanischer Yen	3.893.123	–	–	3.893.123	–
Pfund Sterling	369.186	369.186	–	–	–
Schweizer Franken	2.788.052	–	–	2.788.052	–
	26.739.866	369.186	–	26.370.680	–

BNY Mellon Global Opportunities Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Dänische Krone	531.933	–	–	531.933	–
Euro	5.218.877	79.412	–	5.139.465	–
Hongkong-Dollar	1.053.958	–	–	1.053.958	–
Indische Rupie	645.133	–	–	645.133	–
Japanischer Yen	2.700.131	–	–	2.700.131	–
Koreanischer Won	773.642	–	–	773.642	–
Malaysischer Ringgit	1	1	–	–	–
Pfund Sterling	3.199.519	–	–	3.199.519	–
Schwedische Krone	689.990	–	–	689.990	–
Schweizer Franken	1.829.076	–	–	1.829.076	–
	16.642.260	79.413	–	16.562.847	–

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	51.519.309	–	–	16.182.426	35.336.883

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Chinesischer Yuan		16.810.648	–	–	16.810.648	–
Dänische Krone		33.236.724	–	–	33.236.724	–
Hongkong-Dollar		17.550.005	391.627	–	76.119.019	(58.960.641)
Ungarischer Forint		60.835.708	–	–	–	60.835.708
Indische Rupie		26.946.783	4.330.873	–	22.615.910	–
Japanischer Yen		(7.125.210)	5.557.554	–	81.860.777	(94.543.541)
Koreanischer Won		23.691.757	–	–	23.691.757	–
Norwegische Krone		11.209.716	–	–	11.209.716	–
Russischer Rubel		23.206.326	–	–	–	23.206.326
Pfund Sterling		50.528.000	16.627.532	–	509.063.663	(475.163.195)
Schwedische Krone		41.857.260	–	(11)	–	41.857.271
Schweizer Franken		6.637.857	–	–	66.802.975	(60.165.118)
US-Dollar		287.473.151	193.309.664	(18.441.377)	1.258.922.413	(1.146.317.549)
		644.378.034	220.217.250	(18.441.388)	2.116.516.028	(1.673.913.856)

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

		GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Australischer Dollar		832.711	–	–	–	832.711
Chinesischer Yuan		326.267	–	–	326.267	–
Dänische Krone		23.121	–	–	722.169	(699.048)
Euro		1.642.871	2.031.228	(53.116)	8.261.993	(8.597.234)
Hongkong-Dollar		(58.491)	6.682	–	1.422.311	(1.487.484)
Ungarischer Forint		544.344	–	–	–	544.344
Indische Rupie		594.097	101.169	–	492.928	–
Japanischer Yen		(46.640)	98.819	–	1.682.065	(1.827.524)
Koreanischer Won		(59.685)	–	–	491.842	(551.527)
Neuseeländischer Dollar		(1)	–	(1)	–	–
Norwegische Krone		224.899	–	–	224.899	–
Russischer Rubel		470.319	–	–	–	470.319
Schweizer Franken		382.131	–	–	1.422.599	(1.040.468)
US-Dollar		4.514.394	2.793.535	(370.344)	25.717.995	(23.626.792)
		9.390.337	5.031.433	(423.461)	40.765.068	(35.982.703)

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		1.236.276	–	–	1.236.276	–
Chinesischer Yuan		(27.499)	–	–	2.082.938	(2.110.437)
Dänische Krone		710.890	–	–	5.344.629	(4.633.739)
Euro		(19.506.674)	11.758.408	(354.812)	53.872.419	(84.782.689)
Hongkong-Dollar		659.260	40.213	–	9.111.945	(8.492.898)
Indische Rupie		(277.756)	405.237	–	3.019.964	(3.702.957)
Japanischer Yen		(4.985.130)	640.422	–	10.885.248	(16.510.800)
Koreanischer Won		3.316.789	–	–	3.316.789	–
Norwegische Krone		1.508.650	–	–	1.508.650	–
Russischer Rubel		2.975.399	–	–	–	2.975.399
Pfund Sterling		(2.084.971)	2.075.217	–	62.446.156	(66.606.344)
Schweizer Franken		237.958	–	–	10.019.374	(9.781.416)
		(16.236.808)	14.919.497	(354.812)	162.844.388	(193.645.881)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

		USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar		(98.446)	9.795.718	–	–	(9.894.164)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Euro		2.787.146	358.532.589	–	–	(355.745.443)
Pfund Sterling		(472.335)	79.817.510	–	–	(80.289.845)
Schwedische Krone		96	96	–	–	–
Schweizer Franken		482	482	–	–	–
		2.216.943	448.146.395	–	–	(445.929.452)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	202.980	535.292	–	177.681	(509.993)
Kolumbianischer Peso	148.726	148.726	–	–	–
Dänische Krone	199.331	–	–	199.331	–
Euro	2.377.779	778.539	–	2.116.747	(517.507)
Hongkong-Dollar	924.368	–	–	924.368	–
Japanischer Yen	1.805.065	103.912	–	1.909.503	(208.350)
Koreanischer Won	431.210	–	–	431.210	–
Mexikanischer Peso	298.010	298.010	–	–	–
Neuseeländischer Dollar	171.060	307.814	–	142.631	(279.385)
Pfund Sterling	4.159.932	2.102	–	5.183.330	(1.025.500)
Schweizer Franken	1.081.751	–	–	1.081.751	–
Thailändischer Baht	121.785	–	–	121.785	–
	11.921.997	2.174.395	–	12.288.337	(2.540.735)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Euro	11.944.583	11.944.583	–	–	–
Pfund Sterling	141.445.557	141.445.557	–	–	–
US-Dollar	70.904.524	70.904.524	–	–	–
	224.294.664	224.294.664	–	–	–

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	31.626.987	1	–	31.626.986	–
Kanadischer Dollar	55.090.830	57.181	–	55.033.649	–
Dänische Krone	48.942.572	–	–	48.942.572	–
Hongkong-Dollar	27.386.509	–	–	27.386.509	–
Japanischer Yen	126.833.204	–	–	126.833.204	–
Singapur-Dollar	561.191	561.191	–	–	–
Pfund Sterling	91.567.066	355.629	–	91.211.437	–
Schweizer Franken	92.625.484	–	–	92.625.484	–
US-Dollar	989.332.928	26.507.158	–	962.944.588	(118.818)
	1.463.966.771	27.481.160	–	1.436.604.429	(118.818)

BNY Mellon Mobility Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	2	2	–	–	–
Chinesischer Yuan	12.592.324	125.790	–	12.466.534	–
Euro	152.092.851	3.376.563	–	148.716.288	–
Hongkong-Dollar	17.315.867	137.728	–	17.178.139	–
Japanischer Yen	62.467.791	808.063	–	61.659.728	–
Koreanischer Won	30.379.111	177.215	–	30.201.896	–
Singapur-Dollar	189.232	189.232	–	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Forts.						
		USD	USD	USD	USD	USD
Pfund Sterling		287.128	287.128	–	–	–
Schweizer Franken		19.541.016	119.406	–	19.421.610	–
Taiwan-Dollar		29.512.812	884.392	–	28.628.420	–
		324.378.134	6.105.519	–	318.272.615	–

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	473.596	10.278	–	463.318	–
Norwegische Krone	34.429	34.429	–	–	–
Pfund Sterling	445.728	445.728	–	–	–
Schwedische Krone	2.132.167	31.432	–	2.100.735	–
Schweizer Franken	3.921	3.921	–	–	–
US-Dollar	1.241.222	84.496	–	1.156.726	–
	4.331.063	610.284	–	3.720.779	–

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	390.568	1.491	–	389.077	–
Pfund Sterling	225.123	2	–	225.121	–
Schweizer Franken	292.720	2.879	–	289.841	–
	908.411	4.372	–	904.039	–

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	(36.909)	14.155.896	–	–	(14.192.805)
Kanadischer Dollar	(125.992)	21.638.651	–	–	(21.764.643)
Kolumbianischer Peso	4.254.731	5.782.363	–	–	(1.527.632)
Tschechische Krone	(322.900)	7.971.697	–	–	(8.294.597)
Ungarischer Forint	4.929.853	–	–	–	4.929.853
Indische Rupie	(80.373)	3.086.932	–	–	(3.167.305)
Indonesische Rupiah	(190.758)	4.819.858	–	–	(5.010.616)
Japanischer Yen	4.885.770	6.402.803	–	–	(1.517.033)
Koreanischer Won	1	–	–	–	1
Malaysischer Ringgit	(27.836)	3.276.698	(1)	–	(3.304.533)
Mexikanischer Peso	3.979.898	5.322.497	–	–	(1.342.599)
Neuseeländischer Dollar	4.967.049	8.512.490	–	–	(3.545.441)
Norwegische Krone	(9.883)	4.182.119	–	–	(4.192.002)
Philippinischer Peso	(4.822.752)	–	–	–	(4.822.752)
Polnischer Zloty	3.373.143	–	–	–	3.373.143
Südafrikanischer Rand	(4.978.293)	–	–	–	(4.978.293)
Pfund Sterling	(5.090.128)	41.236.786	–	–	(46.326.914)
Schwedische Krone	(34.892)	2.207.625	–	–	(2.242.517)
US-Dollar	28.304	97.018.065	–	–	(96.989.761)
	10.698.033	225.614.480	(1)	–	(214.916.446)

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Australischer Dollar	821.413	–	–	–	821.413
Chinesischer Yuan	1.082.114	–	–	1.082.114	–
Dänische Krone	869.999	–	–	869.999	–
Hongkong-Dollar	77.693	8.986	–	2.090.397	(2.021.690)
Ungarischer Forint	1.465.344	–	–	99.207	1.366.137

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

Fonds	Währung	Nettoengagement 31. Dezember 2021	Monetäre Vermögenswerte	Monetäre Verbindlichkeiten	Nicht-monetäre Vermögenswerte	Hedging (Absicherung)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Indonesische Rupiah		125.927	–	–	125.927	–
Japanischer Yen		(201.326)	127.546	–	2.262.105	(2.590.977)
Koreanischer Won		532.005	–	–	532.005	–
Norwegische Krone		286.471	–	–	286.471	–
Südafrikanischer Rand		69.404	–	–	69.404	–
Pfund Sterling		867.760	1.160.842	–	16.248.952	(16.542.034)
Schwedische Krone		967.631	–	–	–	967.631
Schweizer Franken		193.888	–	–	1.927.041	(1.733.153)
Taiwan-Dollar		684.387	46.512	–	637.875	–
US-Dollar		6.618.073	2.369.422	(421.967)	27.323.739	(22.653.121)
		14.460.783	3.713.308	(421.967)	53.555.236	(42.385.794)

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Australischer Dollar	73.035	34.911	(5.381)	–	43.505
Kanadischer Dollar	222.038	114.801	(2.671)	–	109.908
Euro	(1.137.535)	32.796.268	(5.673)	–	(33.928.130)
Indische Rupie	(140.442)	–	–	–	(140.442)
Japanischer Yen	(5.064)	1.372.309	–	–	(1.377.373)
Koreanischer Won	(42.744)	1.031.512	–	–	(1.074.256)
Mexikanischer Peso	(60.273)	2.845.846	–	–	(2.906.119)
Russischer Rubel	(19.515)	1.451.277	–	–	(1.470.792)
Pfund Sterling	57.739	3.109.590	–	–	(3.051.851)
Schwedische Krone	(218.591)	–	–	–	(218.591)
Taiwan-Dollar	(381.549)	–	–	–	(381.549)
	(1.652.901)	42.756.514	(13.725)	–	(44.395.690)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	595.145	595.145	–	–	–
Pfund Sterling	1.156.931	1.156.931	–	–	–
	1.752.076	1.752.076	–	–	–

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

	USD	USD	USD	USD	USD
Euro	1.259.374	1.259.374	–	–	–
Pfund Sterling	9.491	9.491	–	–	–
	1.268.865	1.268.865	–	–	–

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Pfund Sterling	(173.922)	13.061.767	–	–	(13.235.689)
US-Dollar	303.383	11.446.771	(96.334)	–	(11.047.054)
	129.461	24.508.538	(96.334)	–	(24.282.743)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Die folgende Tabelle veranschaulicht die Auswirkung einer Veränderung der Landeswährungen gegenüber der funktionalen Währung der Fonds auf das den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibende Nettovermögen. Im Interesse konsistenter Vergleiche zwischen den Fonds geht die Tabelle von einem Anstieg des Werts der Landeswährungen um 5 % aus (ein Rückgang um 5 % hätte ähnliche negative Folgen).

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft darüber, wie sich per 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 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 2022	Anstieg/(Rückgang) des Nettoinventarwerts 2021
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	856.906	676.302
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	USD	2.011.893	2.761.902
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	USD	924.839	1.500.162
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	1.612.694	1.687.719
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	(21.314)	(17.336)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	(8.413)	(2.409)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	6.365	6.564
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	(3.822)	235.091
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	657.593	2.510.671
BNY Mellon Future Earth Fund	USD	45.929	65.501
BNY Mellon Future Food Fund**	USD	43.790	79.875
BNY Mellon Future Life Fund	USD	33.576	54.764
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	10.461.532	11.619.647
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	1.539.511	2.181.312
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	9.165.130	10.537.986
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	12.072.927	10.956.315
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	3.407.973	6.720.342
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	897.879	1.336.993
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	603.270	832.113
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	(306.170)	110.847
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	416.548	596.100
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	12.639.525	11.214.733
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	52.441.738	73.198.339
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	9.171	16.218.907
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	72.954	216.553
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	USD	88.979	45.421
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	USD	502.861	k. A.
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	321.389	87.604
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	EUR	(45.861)	6.473
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	EUR	(6.071)	k. A.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Der BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund war zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

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 2021: 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 2022 Geschäfte abgeschlossen haben, ist in nachstehender Tabelle aufgeführt (Bewertung für 31. Dezember 2021 ist identisch, sofern nicht anders angegeben):

Kontrahent	Rating	Kontrahent	Rating
Bank of America Merrill Lynch	A-	J.P. Morgan AG	A+
Bank of Montreal	A+	Lloyds Bank Plc	A+
Bank of New York Mellon Corporation	A	Morgan Stanley & Co. LLC	A+
Barclays Bank Plc	A	Nomura Holdings Inc	BBB+
BNP Paribas	A+	RBC Capital Markets LLC	AA-
Canadian Imperial Bank of Commerce	A+	Royal Bank of Canada	AA-
Citibank N.A.	A+	Royal Bank of Scotland Plc	A
Commonwealth Bank of Australia.	AA-	Skandinaviska Enskilda Banken AB	A+
Credit Suisse AG	BBB- (31. Dezember 2021: BBB+)	Societe Generale	A
Deutsche Bank AG	A-	Standard Chartered Bank	A+
Goldman Sachs & Co.	BBB+	State Street Corp	A
HSBC Bank plc	A+	Toronto Dominion Bank	AA-
ING Bank NV	A+	UBS AG	A+
		Westpac Banking Corp	AA-

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

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 2022 und 31. Dezember 2021 auf.

Fonds	Basiswährung	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Asian Income Fund	USD	298.325	284.859
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	USD	1.252.552	597.574
BNY Mellon Brazil Equity Fund	USD	418.358	995.795
BNY Mellon Future Earth Fund	USD	25.669	70.255
BNY Mellon Future Food Fund**	USD	48.413	77.480
BNY Mellon Future Life Fund	USD	60.144	60.233
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	2.812.843	5.851.615
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	11.508.948	18.035.656
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	942.702	398.423
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	10.944.816	8.333.721
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	10.480.956	4.351.444
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	2.000.000	2.000.000
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	821.696	672.122
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	43.948.526	262.947.898
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	752.177	2.945.355
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	8.572.389	36.943.574
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.019.773	1.624.422
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	USD	366.327	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	EUR	2.380.282	3.507.852
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	8.172.917	10.968.835

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

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 2022 und 31. Dezember 2021 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	AAA	8,70	2,66
	AA	6,44	8,78
	A	7,63	5,11
	BBB	5,70	1,66
	BB	5,29	4,37
	B	1,16	4,65
	CCC	0,13	0,57
	Ohne Rating	64,95	52,35
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	AAA	3,54	4,21
	AA	6,35	5,28
	AA-	6,29	8,42
	A+	21,74	11,63

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Forts.	A	4,52	24,17
	BBB-	2,72	k. A.
	Ohne Rating	54,84	46,29
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fonds	AAA	19,17	k. A.
	AA+	k. A.	7,92
	AA	3,74	k. A.
	AA-	7,00	k. A.
	A+	3,74	k. A.
	A-	k. A.	1,32
	BBB+	1,20	k. A.
	BBB	k. A.	2,49
	BBB-	3,74	k. A.
	BB-	0,72	k. A.
	Ohne Rating	60,69	88,27
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	AA+	89,84	85,47
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	AA+	8,91	5,42
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	AA	0,64	k. A.
	A	4,89	k. A.
	BBB	10,49	2,48
	BB	36,87	53,25
	B	29,90	29,95
	CCC	9,54	7,70
	CC	0,19	k. A.
	D	0,09	k. A.
	Ohne Rating	7,39	6,62
BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund	AAA	1,31	0,57
	AA	13,09	4,42
	A	40,82	27,90
	BBB	38,00	61,36
	BB und niedriger	3,58	2,28
	Ohne Rating	3,20	3,47
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	AA	1,75	k. A.
	A	10,24	k. A.
	BBB	29,19	0,48
	BB	37,27	88,09
	B	16,82	9,03
	CCC	3,14	1,32
	Ohne Rating	1,59	1,08

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	AA	0,32	k. A.
	A	3,01	k. A.
	BBB	8,46	2,15
	BB	39,02	55,32
	B	34,23	31,82
	CCC	11,94	8,87
	C und niedriger	0,17	k. A.
	Ohne Rating	2,85	1,84
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	AA	1,23	1,03
	A	6,80	3,65
	BBB	32,57	27,63
	BB	14,53	15,71
	B	16,56	13,27
	CCC und niedriger	4,02	6,20
	Ohne Rating	24,29	32,51
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fonds	A	4,91	4,45
	BBB	35,07	29,07
	BB	13,23	20,37
	B	14,32	26,47
	CCC und niedriger	4,51	2,33
	Ohne Rating	27,96	17,31
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	AA	k. A.	2,73
	A+	k. A.	23,82
	A	5,68	4,08
	A-	k. A.	5,54
	BBB+	k. A.	12,38
	BBB	18,61	23,00
	BBB-	k. A.	4,17
	BB	31,35	13,05
	BB-	k. A.	5,45
Ohne Rating	44,36	5,78	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	AA	k. A.	2,21
	A	4,38	17,61
	BBB	26,05	30,49
	BB	28,62	22,17
	B	7,26	13,37
	CCC und niedriger	2,60	0,76
	Ohne Rating	31,09	13,39

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	AA-	k. A.	3,44
	A+	2,75	k. A.
	A	k. A.	1,26
	A-	0,71	0,80
	BBB+	9,00	6,40
	BBB	8,69	4,49
	BBB-	8,30	11,82
	BB+	3,80	3,74
	BB	10,11	9,39
	BB-	15,05	9,79
	B+	3,37	4,45
	B	2,92	12,57
	B-	6,41	7,76
	CCC+	4,69	3,52
	CC	0,96	k. A.
	Ohne Rating	23,24	20,57
BNY Mellon Euroland Bond Fund	AAA	8,37	20,70
	AA	25,38	27,73
	A	15,48	10,32
	BBB	8,71	25,82
	BB	1,03	6,51
	B	0,11	1,33
	Ohne Rating	40,92	7,59
BNY Mellon European Credit Fund	AAA	0,28	0,28
	AA	10,51	13,06
	A	34,56	29,05
	BBB	29,50	33,08
	BB und niedriger	3,00	3,53
	Ohne Rating	19,28	14,48
	BNY EM Corporate Fund	0,92	1,06
	BNY Short Dated HY Fund	1,95	2,56
BNY Mellon Global Bond Fund	AAA	64,66	29,09
	AA	15,78	42,22
	A	8,83	15,35
	BBB	10,73	11,94
	BB	k. A.	1,40
BNY Mellon Global Credit Fund	AAA	3,53	3,39
	AA	9,01	9,25

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Global Credit Fund Forts.	A	24,00	27,61
	BBB	20,04	23,76
	unter BBB	3,12	7,82
	Ohne Rating	40,30	25,67
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	AAA	51,80	20,40
	AA	7,98	17,01
	A	5,58	5,68
	BBB	18,87	6,36
	BB	11,58	19,08
	B	2,76	19,26
	CC	1,14	k. A.
	Ohne Rating	0,29	12,21
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BBB	3,74	k. A.
	BB	38,36	29,51
	B	45,67	46,30
	CCC und niedriger	8,07	17,35
	Ohne Rating	4,16	6,84
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	AAA	29,34	k. A.
	AA	12,10	k. A.
	BBB	22,52	k. A.
	BB	14,87	36,30
	B und niedriger	10,17	22,77
	Ohne Rating	11,00	40,93
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	AAA	11,80	k. A.
	AA	53,90	k. A.
	BBB	7,15	k. A.
	BB	12,00	14,55
	B und niedriger	8,03	12,69
	Ohne Rating	7,12	72,76
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	AAA	11,19	k. A.
	AA	58,32	k. A.
	BBB	9,66	0,20
	BB	8,38	10,78
	B und niedriger	6,04	6,98
	Ohne Rating	6,41	82,04
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	A	3,06	k. A.
	BB	25,05	10,31

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.	B	48,90	46,59
	CCC	7,89	16,31
	Ohne Rating	15,10	15,18
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	AAA	81,69	15,45
	AA+	k. A.	56,41
	AA	2,65	k. A.
	A+	k. A.	1,92
	A	2,00	3,65
	BBB+	k. A.	5,51
	BBB	9,68	k. A.
	BBB-	k. A.	7,13
	BB+	k. A.	2,81
	BB	2,58	4,43
	B	1,40	k. A.
	Ohne Rating	k. A.	2,69
	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	AAA	53,34
AA		5,66	11,65
A		7,52	6,78
BBB		21,24	9,06
BB		8,78	19,32
B		3,22	16,23
CC		0,24	
Ohne Rating		k. A.	12,62
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	AAA	29,16	k. A.
	AA	11,02	k. A.
	A	2,56	k. A.
	BBB	35,40	k. A.
	BB	10,52	14,48
	B	5,57	47,47
	Ohne Rating	5,77	38,05
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	AAA	3,89	15,02
	AA	8,46	26,21
	A	11,46	7,88
	BBB	21,41	29,59
	BB	11,19	12,04
	B und niedriger	16,60	2,74
	Ohne Rating	26,99	6,52
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure	AAA	6,11	6,68

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Fonds	Rating	31. Dezember 2022 %	31. Dezember 2021 %
Debt Fund			
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Forts.	AA	51,23	50,50
	A	21,92	26,25
	BBB	3,92	3,55
	BB	0,55	0,96
	Ohne Rating	16,27	12,06
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fonds			
	AAA	1,66	0,91
	AA	14,64	14,77
	A	41,52	39,40
	BBB	23,11	25,47
	BB	4,00	4,17
	B	0,25	0,29
	Ohne Rating	14,82	11,46
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*			
	AAA	3,49	k. A.
	AA	10,86	k. A.
	A	43,36	k. A.
	BBB	19,01	k. A.
	BB	4,00	k. A.
	Ohne Rating	19,28	k. A.

* 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 2022 Maximales Engagement	31. Dezember 2021 Maximales Engagement
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	169.014.628	288.191.277
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	1.963.406	18.663.407
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	4.000.000	4.796.951
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	4.605.000	1.800.000
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	26.301.000	47.300.000
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	229.413.793	235.301.515
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	k. A.	5.464.805
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	USD	41.809.162	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 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

Zum 31. Dezember 2021 wurden die folgenden Sachsicherheiten für Derivatgeschäfte entgegengenommen:

Fonds	Kontrahent	Währung	Beizulegender Zeitwert
BNY Mellon Euroland Bond Fund	Goldman Sachs International	EUR	318.743
BNY Mellon Global Credit Fund	Citigroup Global Markets Limited	USD	19.526

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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Einige Fonds besitzen Anlagen in fremdfinanzierten Darlehen, die bei den kreditabwickelnden Banken nicht separat gehalten werden. Diese Darlehen werden nicht von der Verwahrstelle gehalten. Entsprechend sind die Fonds dem Kreditrisiko des Schuldners ausgesetzt. Zudem gehen die Fonds das Kreditrisiko der kreditabwickelnden Banken ein.

LIQUIDITÄTSRISIKO

Das Liquiditätsrisiko bezeichnet das Risiko, dass die Gesellschaft nicht ausreichende Barmittel aufbringen kann, um ihre Verpflichtungen bei Fälligkeit in vollem Umfang zu begleichen oder dies nur zu äußerst ungünstigen Bedingungen tun kann.

Die Gesellschaft muss täglich Einschussforderungen auf Derivate und Barrücknahmen einlösbarer, partizipierender Anteile abwickeln. Daher investiert jeder Fonds den Großteil seines Vermögens in Anlagen, die an einem aktiven Markt gehandelt werden und schnell verkauft werden können. Nur ein geringer Teil seines Vermögens wird in Anlagen investiert, die nicht aktiv an einer Börse gehandelt werden. Die börsennotierten Wertpapiere jedes Fonds gelten als rasch verwertbar, da sie an einer regulierten Börse gehandelt werden.

Die Anlageverwalter verwenden gegebenenfalls derivative Instrumente und Schuldtitel wie börsengehandelte Index-Futures, um ein Engagement an Märkten zu ermöglichen und zugleich eine ausreichende Liquidität 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 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	Gesamt 31. Dezember 2022
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
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

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 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
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

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 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
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

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 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
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

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 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
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

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 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
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

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 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
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 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

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
	USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Future Food Fund**					
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
<small>BNY Mellon Future Life Fund</small>					
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
BNY Mellon Global Bond Fund					
Verbindlichkeiten					
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					
Verbindlichkeiten					
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

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 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
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 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	Gesamt 31. Dezember 2022
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
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

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 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
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

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 (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
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

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 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
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

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 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 Emerging Markets Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	55.879	–	–	–	55.879
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	55.879	–	–	–	55.879
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	30.407	–	–	–	30.407
Sonstige Verbindlichkeiten	4	–	–	–	4
Einlösbare, partizipierende Anteile	10.693.015	–	–	–	10.693.015
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	10.779.305	–	–	–	10.779.305
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

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 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
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

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
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.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

In der nachfolgenden Tabelle sind die finanziellen Verbindlichkeiten der Fonds, die in Derivate investieren, bezüglich der relevanten Fälligkeitsgruppen auf der Basis der zum 31. Dezember 2021 verbleibenden Zeit bis zur vertraglichen Fälligkeit zusammengefasst. Die Tabellen wurden auf der Basis der nicht diskontierten Brutto-Mittelabflüsse in Bezug auf ihre finanziellen Verbindlichkeiten erstellt:

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	1.976.470	–	–	1.976.470
Optionen	19.519	4.546.691	98.098	–	4.664.308
Swaps	–	–	12.209	9.289.532	9.301.741
Terminkontrakte (Forwards)	257.814.349	123.606.806	–	–	381.421.155
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	257.833.868	130.129.967	110.307	9.289.532	397.363.674
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	247.049	–	–	–	247.049
Margen auf Derivatkontrakte	3.329.865	–	–	–	3.329.865
Antizipative Passiva	184.320	–	–	–	184.320
Sonstige Verbindlichkeiten	2.434.480	–	–	–	2.434.480
Einlösbare, partizipierende Anteile	420.833.229	–	–	–	420.833.229
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	684.862.811	130.129.967	110.307	9.289.532	824.392.617
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Futures	37.152	254.653	–	–	291.805
Swaps	912.697	–	2.764.140	–	3.676.837
Terminkontrakte (Forwards)	117.649.619	–	–	–	117.649.619
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	118.599.468	254.653	2.764.140	–	121.618.261
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	26.275	–	–	–	26.275
Antizipative Passiva	216.901	–	–	–	216.901
Sonstige Verbindlichkeiten	2.875.220	–	–	–	2.875.220
Einlösbare, partizipierende Anteile	123.705.871	–	–	–	123.705.871
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	245.423.735	254.653	2.764.140	–	248.442.528

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	15.470	–	–	15.470
Swaps	–	–	12.021.563	93.873	12.115.436
Terminkontrakte (Forwards)	5.915.525	–	–	–	5.915.525
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	5.915.525	15.470	12.021.563	93.873	18.046.431
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	705.341	–	–	–	705.341
Antizipative Passiva	60.658	–	–	–	60.658
Sonstige Verbindlichkeiten	1.359.810	–	–	–	1.359.810
Einlösbare, partizipierende Anteile	95.148.164	–	–	–	95.148.164
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	103.189.498	15.470	12.021.563	93.873	115.320.404
BNY Mellon Asian Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	328	–	–	–	328
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	328	–	–	–	328
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	327	–	–	–	327
Antizipative Passiva	26.794	–	–	–	26.794
Einlösbare, partizipierende Anteile	14.979.746	–	–	–	14.979.746
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	15.007.195	–	–	–	15.007.195
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	44.164	–	–	–	44.164
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	44.164	–	–	–	44.164
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	47.055	–	–	–	47.055
Antizipative Passiva	124.766	–	–	–	124.766
Sonstige Verbindlichkeiten	328.967	–	–	–	328.967
Einlösbare, partizipierende Anteile	58.824.565	–	–	–	58.824.565
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	59.369.517	–	–	–	59.369.517

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	7.296.857	–	–	–	7.296.857
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	7.296.857	–	–	–	7.296.857
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	129.474	–	–	–	129.474
Sonstige Verbindlichkeiten	281.236	–	–	–	281.236
Einlösbare, partizipierende Anteile	95.125.353	–	–	–	95.125.353
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	102.832.920	–	–	–	102.832.920
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	792.305	–	–	–	792.305
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	792.305	–	–	–	792.305
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	89.296	–	–	–	89.296
Sonstige Verbindlichkeiten	3.296.885	–	–	–	3.296.885
Einlösbare, partizipierende Anteile	42.616.239	–	–	–	42.616.239
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	46.794.725	–	–	–	46.794.725
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	3.263	109.102	7.759	–	120.124
Swaps	–	–	–	6.255	6.255
Terminkontrakte (Forwards)	452	13.780.919	–	–	13.781.371
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.715	13.890.021	7.759	6.255	13.907.750
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	189	–	–	–	189
Margen auf Derivatkontrakte	903.094	–	–	–	903.094
Antizipative Passiva	19.149	–	–	–	19.149
Einlösbare, partizipierende Anteile	24.751.005	–	–	–	24.751.005
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	25.677.152	13.890.021	7.759	6.255	39.581.187
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	2.533	–	–	–	2.533
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.533	–	–	–	2.533

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	4.656	–	–	–	4.656
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.656	–	–	–	4.656
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	3.087.954	–	–	–	3.087.954
Antizipative Passiva	307.090	–	–	–	307.090
Sonstige Verbindlichkeiten	6.185.614	–	–	–	6.185.614
Einlösbare, partizipierende Anteile	645.924.114	–	–	–	645.924.114
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	655.509.428	–	–	–	655.509.428
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	45.403.602	–	–	–	45.403.602
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	45.403.602	–	–	–	45.403.602
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	102.127	–	–	–	102.127
Antizipative Passiva	80.450	–	–	–	80.450
Sonstige Verbindlichkeiten	49.601	–	–	–	49.601
Einlösbare, partizipierende Anteile	191.298.660	–	–	–	191.298.660
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	236.934.440	–	–	–	236.934.440
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	7.074	–	–	7.074
Terminkontrakte (Forwards)	6.645.974	–	–	–	6.645.974
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.645.974	7.074	–	–	6.653.048
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	4.801	–	–	–	4.801
Antizipative Passiva	22.835	–	–	–	22.835
Einlösbare, partizipierende Anteile	20.691.305	–	–	–	20.691.305
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	27.364.915	7.074	–	–	27.371.989

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.062.188	–	–	1.062.188
Terminkontrakte (Forwards)	92.010.564	–	–	–	92.010.564
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	92.010.564	1.062.188	–	–	93.072.752
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	376.531	–	–	–	376.531
Sonstige Verbindlichkeiten	415.080	–	–	–	415.080
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.921.308.172	–	–	–	1.921.308.172
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.014.110.347	1.062.188	–	–	2.015.172.535
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	181.299.551	–	–	–	181.299.551
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	181.299.551	–	–	–	181.299.551
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	3.376.774	–	–	–	3.376.774
Antizipative Passiva	287.830	–	–	–	287.830
Sonstige Verbindlichkeiten	8.258	–	–	–	8.258
Einlösbare, partizipierende Anteile	726.611.703	–	–	–	726.611.703
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	911.584.116	–	–	–	911.584.116
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	247.063	–	–	247.063
Swaps	–	–	–	82.256	82.256
Terminkontrakte (Forwards)	4.460.334	2.506.198	–	–	6.966.532
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.460.334	2.753.261	–	82.256	7.295.851
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	4	–	–	–	4
Antizipative Passiva	382.252	–	–	–	382.252
Sonstige Verbindlichkeiten	113.427	–	–	–	113.427
Einlösbare, partizipierende Anteile	554.266.191	–	–	–	554.266.191
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	559.222.208	2.753.261	–	82.256	562.057.725

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	40.411	–	–	40.411
Terminkontrakte (Forwards)	404.008	446.227	–	–	850.235
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	404.008	486.638	–	–	890.646
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	31.067	–	–	–	31.067
Antizipative Passiva	47.433	–	–	–	47.433
Sonstige Verbindlichkeiten	396.910	–	–	–	396.910
Einlösbare, partizipierende Anteile	33.134.900	–	–	–	33.134.900
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	34.014.318	486.638	–	–	34.500.956
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	16.751.750	11.705.908	–	–	28.457.658
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.751.750	11.705.908	–	–	28.457.658
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	118.027	–	–	–	118.027
Antizipative Passiva	158.613	–	–	–	158.613
Sonstige Verbindlichkeiten	967.108	–	–	–	967.108
Einlösbare, partizipierende Anteile	113.559.730	–	–	–	113.559.730
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	131.555.228	11.705.908	–	–	143.261.136
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	1.441	–	–	1.441
Terminkontrakte (Forwards)	800.718	3.235.598	–	–	4.036.316
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	800.718	3.237.039	–	–	4.037.757
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	5.427	–	–	–	5.427
Antizipative Passiva	7.271	–	–	–	7.271
Sonstige Verbindlichkeiten	114.412	–	–	–	114.412
Einlösbare, partizipierende Anteile	27.883.288	–	–	–	27.883.288
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	28.811.116	3.237.039	–	–	32.048.155

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	70.322	–	–	70.322
Swaps	–	–	–	35.277	35.277
Terminkontrakte (Forwards)	871.124	36.068.564	–	–	36.939.688
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	871.124	36.138.886	–	35.277	37.045.287

Verbindlichkeiten

Banküberziehung	191	–	–	–	191
Margen auf Derivatkontrakte	28.331	–	–	–	28.331
Antizipative Passiva	118.276	–	–	–	118.276
Sonstige Verbindlichkeiten	50.433	–	–	–	50.433
Einlösbare, partizipierende Anteile	125.677.325	–	–	–	125.677.325
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	126.745.680	36.138.886	–	35.277	162.919.843

BNY Mellon Euroland Bond Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	261.581	–	–	261.581
Terminkontrakte (Forwards)	108.207	26.095.674	–	–	26.203.881
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	108.207	26.357.255	–	–	26.465.462

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	4.016.798	–	–	–	4.016.798
Antizipative Passiva	292.647	–	–	–	292.647
Sonstige Verbindlichkeiten	337.131	–	–	–	337.131
Einlösbare, partizipierende Anteile	275.922.173	–	–	–	275.922.173
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	280.676.956	26.357.255	–	–	307.034.211

BNY Mellon European Credit Fund

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	6.997	–	–	6.997
Swaps	–	–	–	111.371	111.371
Terminkontrakte (Forwards)	899.910	505.930	–	–	1.405.840
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	899.910	512.927	–	111.371	1.524.208

Verbindlichkeiten

Margen auf Derivatkontrakte	614.360	–	–	–	614.360
Antizipative Passiva	12.996	–	–	–	12.996
Sonstige Verbindlichkeiten	1.433	–	–	–	1.433
Einlösbare, partizipierende Anteile	40.738.209	–	–	–	40.738.209
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	42.266.908	512.927	–	111.371	42.891.206

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Future Earth Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	33.206	–	–	–	33.206
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	33.206	–	–	–	33.206
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	13.073	–	–	–	13.073
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.164.937	–	–	–	2.164.937
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.211.216	–	–	–	2.211.216
BNY Mellon Future Food Fund**					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	15.811	–	–	–	15.811
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.766.825	–	–	–	2.766.825
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.782.636	–	–	–	2.782.636
BNY Mellon Future Life Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	13.677	–	–	–	13.677
Einlösbare, partizipierende Anteile	2.351.576	–	–	–	2.351.576
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	2.365.253	–	–	–	2.365.253
BNY Mellon Global Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	344.785	147.523.024	–	–	147.867.809
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	344.785	147.523.024	–	–	147.867.809
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	754	–	–	–	754
Antizipative Passiva	367.929	–	–	–	367.929
Sonstige Verbindlichkeiten	2.256.401	–	–	–	2.256.401
Einlösbare, partizipierende Anteile	434.682.361	–	–	–	434.682.361
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	437.652.230	147.523.024	–	–	585.175.254

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Credit Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	160.987	–	–	160.987
Optionen	10.492	3.657.272	–	–	3.667.764
Swaps	–	–	–	4.948.648	4.948.648
Terminkontrakte (Forwards)	337.211.217	741.239	–	–	337.952.456
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	337.221.709	4.559.498	–	4.948.648	346.729.855
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	3.281.263	–	–	–	3.281.263
Antizipative Passiva	68.864	–	–	–	68.864
Sonstige Verbindlichkeiten	65.636	–	–	–	65.636
Einlösbare, partizipierende Anteile	442.961.954	–	–	–	442.961.954
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	783.599.426	4.559.498	–	4.948.648	793.107.572
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	39.999.802	153.971.798	–	–	193.971.600
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	39.999.802	153.971.798	–	–	193.971.600
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Margen auf Derivatkontrakte	14.610	–	–	–	14.610
Antizipative Passiva	349.032	–	–	–	349.032
Sonstige Verbindlichkeiten	3.523.167	–	–	–	3.523.167
Einlösbare, partizipierende Anteile	432.993.493	–	–	–	432.993.493
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	476.880.105	153.971.798	–	–	630.851.903
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	118.191	–	–	–	118.191
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	118.191	–	–	–	118.191
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	3.579	–	–	–	3.579
Antizipative Passiva	71.389	–	–	–	71.389
Sonstige Verbindlichkeiten	185.813	–	–	–	185.813
Einlösbare, partizipierende Anteile	53.039.682	–	–	–	53.039.682
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	53.418.654	–	–	–	53.418.654

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
BNY Mellon Global Equity Fund**					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	47.625	-	-	-	47.625
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	47.625	-	-	-	47.625
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	546.300	-	-	-	546.300
Sonstige Verbindlichkeiten	59.982	-	-	-	59.982
Einlösbare, partizipierende Anteile	505.772.156	-	-	-	505.772.156
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	506.426.063	-	-	-	506.426.063
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	1.886.645	-	-	-	1.886.645
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.886.645	-	-	-	1.886.645
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	544.528	-	-	-	544.528
Antizipative Passiva	657.547	-	-	-	657.547
Sonstige Verbindlichkeiten	686	-	-	-	686
Einlösbare, partizipierende Anteile	411.101.299	-	-	-	411.101.299
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	414.190.705	-	-	-	414.190.705
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	48.913.325	-	-	-	48.913.325
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	48.913.325	-	-	-	48.913.325
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	154.717	-	-	-	154.717
Sonstige Verbindlichkeiten	1.221.723	-	-	-	1.221.723
Einlösbare, partizipierende Anteile	166.693.695	-	-	-	166.693.695
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	216.983.460	-	-	-	216.983.460
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	2.567.171	-	-	-	2.567.171
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.567.171	-	-	-	2.567.171
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	194.921	-	-	-	194.921
Sonstige Verbindlichkeiten	1.120.125	-	-	-	1.120.125
Einlösbare, partizipierende Anteile	227.707.584	-	-	-	227.707.584
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	231.589.801	-	-	-	231.589.801

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Leaders Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	40.156	–	–	–	40.156
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	40.156	–	–	–	40.156
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	65.289	–	–	–	65.289
Sonstige Verbindlichkeiten	913	–	–	–	913
Einlösbare, partizipierende Anteile	65.357.060	–	–	–	65.357.060
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	65.463.418	–	–	–	65.463.418
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	13.372	–	–	–	13.372
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	13.372	–	–	–	13.372
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	29.490	–	–	–	29.490
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	29.490	–	–	–	29.490
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	80.824	–	–	–	80.824
Sonstige Verbindlichkeiten	34.743	–	–	–	34.743
Einlösbare, partizipierende Anteile	37.198.450	–	–	–	37.198.450
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	37.343.507	–	–	–	37.343.507
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	2.277.516	–	–	2.277.516
Optionen	–	5.061.446	13.629.975	–	18.691.421
Terminkontrakte (Forwards)	632.247.393	1.488.345.232	–	–	2.120.592.625
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	632.247.393	1.495.684.194	13.629.975	–	2.141.561.562
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	10	–	–	–	10
Antizipative Passiva	2.757.756	–	–	–	2.757.756
Sonstige Verbindlichkeiten	2.700.685	–	–	–	2.700.685
Einlösbare, partizipierende Anteile	3.121.728.759	–	–	–	3.121.728.759
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	3.759.434.603	1.495.684.194	13.629.975	–	5.268.748.772

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Futures	–	46.560	–	–	46.560
Optionen	–	104.674	272.226	–	376.900
Terminkontrakte (Forwards)	2.776.394	26.773.180	–	–	29.549.574
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.776.394	26.924.414	272.226	–	29.973.034
Verbindlichkeiten					
Banküberziehung	1	–	–	–	1
Antizipative Passiva	53.087	–	–	–	53.087
Sonstige Verbindlichkeiten	4.171	–	–	–	4.171
Einlösbare, partizipierende Anteile	65.897.045	–	–	–	65.897.045
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	68.730.698	26.924.414	272.226	–	95.927.338
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	316.381	–	–	316.381
Optionen	–	709.932	1.834.260	–	2.544.192
Terminkontrakte (Forwards)	16.528.942	21.347.911	–	–	37.876.853
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	16.528.942	22.374.224	1.834.260	–	40.737.426
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	454.537	–	–	–	454.537
Sonstige Verbindlichkeiten	2.542.267	–	–	–	2.542.267
Einlösbare, partizipierende Anteile	437.609.335	–	–	–	437.609.335
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	457.135.081	22.374.224	1.834.260	–	481.343.565
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	43.343.937	179.784.149	–	–	223.128.086
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	43.343.937	179.784.149	–	–	223.128.086
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	436.175	–	–	–	436.175
Sonstige Verbindlichkeiten	12.366.986	–	–	–	12.366.986
Einlösbare, partizipierende Anteile	792.573.372	–	–	–	792.573.372
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	848.720.470	179.784.149	–	–	1.028.504.619

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	33.190.081	509.993	–	–	33.700.074
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	33.190.081	509.993	–	–	33.700.074
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	5.277	–	–	–	5.277
Einlösbare, partizipierende Anteile	32.551.101	–	–	–	32.551.101
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	65.746.459	509.993	–	–	66.256.452
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Terminkontrakte (Forwards)	658.244.344	–	–	–	658.244.344
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	658.244.344	–	–	–	658.244.344
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	20.287.178	–	–	–	20.287.178
Sonstige Verbindlichkeiten	31.716.481	–	–	–	31.716.481
Einlösbare, partizipierende Anteile	21.102.568.351	–	–	–	21.102.568.351
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	21.812.816.354	–	–	–	21.812.816.354
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	12.430.585	–	–	–	12.430.585
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	12.430.585	–	–	–	12.430.585
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	1.798.898	–	–	–	1.798.898
Sonstige Verbindlichkeiten	1.061.725	–	–	–	1.061.725
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.600.784.047	–	–	–	1.600.784.047
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.616.075.255	–	–	–	1.616.075.255
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	31.585.817	–	–	–	31.585.817
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	31.585.817	–	–	–	31.585.817
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	1.020.690	–	–	–	1.020.690
Sonstige Verbindlichkeiten	1.782.085	–	–	–	1.782.085
Einlösbare, partizipierende Anteile	993.610.089	–	–	–	993.610.089
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.027.998.681	–	–	–	1.027.998.681

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr 31. Dezember 2021	Gesamt
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	13.159	–	–	–	13.159
Sonstige Verbindlichkeiten	36.082	–	–	–	36.082
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	49.241	–	–	–	49.241
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	106.255	–	–	–	106.255
Sonstige Verbindlichkeiten	123.828	–	–	–	123.828
Einlösbare, partizipierende Anteile	81.192.875	–	–	–	81.192.875
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	81.422.958	–	–	–	81.422.958
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	62.483	–	–	–	62.483
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	62.483	–	–	–	62.483
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	14.295	–	–	–	14.295
Einlösbare, partizipierende Anteile	4.976.550	–	–	–	4.976.550
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	5.053.328	–	–	–	5.053.328
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Terminkontrakte (Forwards)	6.365.898	233.751.446	–	–	240.117.344
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.365.898	233.751.446	–	–	240.117.344
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	12.011	–	–	–	12.011
Antizipative Passiva	161.814	–	–	–	161.814
Sonstige Verbindlichkeiten	439.722	–	–	–	439.722
Einlösbare, partizipierende Anteile	328.622.843	–	–	–	328.622.843
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	335.602.288	233.751.446	–	–	569.353.734

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	53.523	–	–	53.523
Optionen	–	124.286	307.058	–	431.344
Terminkontrakte (Forwards)	20.250.327	31.740.617	–	–	51.990.944
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	20.250.327	31.918.426	307.058	–	52.475.811
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	83.163	–	–	–	83.163
Einlösbare, partizipierende Anteile	78.396.803	–	–	–	78.396.803
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	98.730.293	31.918.426	307.058	–	130.955.777
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Futures	–	122.825	–	–	122.825
Terminkontrakte (Forwards)	–	40.921.736	–	–	40.921.736
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	41.044.561	–	–	41.044.561
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	501.225	–	–	–	501.225
Antizipative Passiva	83.654	–	–	–	83.654
Sonstige Verbindlichkeiten	7.209.299	–	–	–	7.209.299
Einlösbare, partizipierende Anteile	91.523.113	–	–	–	91.523.113
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	99.317.291	41.044.561	–	–	140.361.852
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	10.286	–	–	–	10.286
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	10.286	–	–	–	10.286
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	60.955	–	–	–	60.955
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	60.955	–	–	–	60.955
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	248.565	–	–	–	248.565
Sonstige Verbindlichkeiten	619	–	–	–	619
Einlösbare, partizipierende Anteile	297.752.469	–	–	–	297.752.469
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	298.062.608	–	–	–	298.062.608

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
	USD	USD	USD	USD	USD
Terminkontrakte (Forwards)	4.625.185	–	–	–	4.625.185
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	4.625.185	–	–	–	4.625.185
Verbindlichkeiten					
Antizipative Passiva	619.176	–	–	–	619.176
Sonstige Verbindlichkeiten	1.525.357	–	–	–	1.525.357
Einlösbare, partizipierende Anteile	1.007.082.724	–	–	–	1.007.082.724
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.013.852.442	–	–	–	1.013.852.442
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Futures	–	206.623	–	–	206.623
Swaps	–	–	–	1.295.007	1.295.007
Terminkontrakte (Forwards)	29.042.368	–	–	–	29.042.368
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	29.042.368	206.623	–	1.295.007	30.543.998
Verbindlichkeiten					
Margen auf Derivatkontrakte	128.275	–	–	–	128.275
Antizipative Passiva	489.448	–	–	–	489.448
Sonstige Verbindlichkeiten	394.336	–	–	–	394.336
Einlösbare, partizipierende Anteile	984.235.804	–	–	–	984.235.804
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	1.014.290.231	206.623	–	1.295.007	1.015.791.861

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 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.

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 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	3	3
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	1	1
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	4	4
BNY Mellon Asian Income Fund	2	2
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*	1	2
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund	1	1
BNY Mellon Brazil Equity Fund	1	2

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Fonds	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	1	1
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	3	4
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	4	4
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	3	1
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	2	2
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	2	3
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	4	3
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	2	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	3	1
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	2	2
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	1	2
BNY Mellon Euroland Bond Fund	2	1
BNY Mellon European Credit Fund	1	2
BNY Mellon Future Earth Fund	1	1
BNY Mellon Future Food Fund**	1	2
BNY Mellon Future Life Fund	1	1
BNY Mellon Global Bond Fund	3	3
BNY Mellon Global Credit Fund	2	2
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	3	2
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	3	4
BNY Mellon Global Equity Fund**	1	1
BNY Mellon Global Equity Income Fund	1	-
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	3	3
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	2	3
BNY Mellon Global Leaders Fund	4	4
BNY Mellon Global Opportunities Fund	2	1
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	1	3
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	2	2
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	3	3
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	1	2
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	1	1
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	3	3
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	1	-
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	1	1
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	1	3
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund	1	1
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	4	3
BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund*	1	k. A.
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)	3	5
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	1	1
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	4	5
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	4	2
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund	2	1
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*	1	k. A.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

ANZAHL DER ANTEILSINHABER

Die Gesellschaft hatte am Ende des aktuellen Geschäftsjahres und des vorangegangenen Geschäftsjahres mindestens zehn Inhaber von einlösbaren, partizipierenden Anteilen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

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.

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 2022 bewertet wurden:

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 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
	Einlagezertifikate	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	16.474.986	1.942.536	–	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 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)
BNY Mellon Future Food Fund**					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	1.868.610	–	–	1.868.610
	Finanzielle Vermögenswerte	1.868.610	–	–	1.868.610

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 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 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

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 Infrastructure Income Fund Forts.

	USD	USD	USD	USD
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)

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)

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 (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)
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

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 Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.					
		USD	USD	USD	USD
	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	–	375.844	–	375.844
	Aktien	15.115.818	–	–	15.115.818
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.057.639	–	1.057.639
	Börsengehandelte Rohstoffe	529.735	–	–	529.735
	Terminkontrakte (Forwards)	–	142.246	–	142.246
	Finanzielle Vermögenswerte	21.191.047	3.634.957	–	24.826.004
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(132.984)	–	(132.984)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(132.984)	–	(132.984)
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)

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 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)
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 Emerging Markets Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	10.327.492	–	–	10.327.492
	Terminkontrakte (Forwards)	–	381	–	381
	Finanzielle Vermögenswerte	10.327.492	381	–	10.327.873
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.240)	–	(1.240)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.240)	–	(1.240)

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 Real Return Fund (EUR)					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	11.795.482	14.716.368	–	26.511.850
	Organismen für gemeinsame Anlagen	47.828	2.753.740	–	2.801.568
	Aktien	34.447.599	–	–	34.447.599
	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	51.928.622	31.314.731	–	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)
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)

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 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)
	Optionen	–	(302.166)	–	(302.166)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.446.524)	(370.922)	–	(2.817.446)
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund*					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	649.157	23.300.994	–	23.950.151
	Terminkontrakte (Forwards)	–	54.623	–	54.623
	Futures	98.735	–	–	98.735
	Finanzielle Vermögenswerte	747.892	23.355.617	–	24.103.509
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.276)	–	(1.276)
	Futures	(37.543)	–	–	(37.543)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(37.543)	(1.276)	–	(38.819)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 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 2021 bewertet wurden:

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	138.437.871	178.868.048	372.797	317.678.716
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	38.545.235	–	38.545.235
	Credit Default Swaps	–	6.851.302	–	6.851.302
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.248.056	–	6.248.056
	Futures	3.776.347	–	–	3.776.347
	Zinsswaps	–	896.802	–	896.802
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	17.454.923	2.182.910	19.637.833
	Optionen	–	258.551	–	258.551
	Finanzielle Vermögenswerte	142.214.218	249.122.917	2.555.707	393.892.842
	Credit Default Swaps	–	(9.301.741)	–	(9.301.741)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.644.555)	–	(5.644.555)
	Futures	(1.976.470)	–	–	(1.976.470)
	Optionen	–	(4.664.308)	–	(4.664.308)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.976.470)	(19.610.604)	–	(21.587.074)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	4.997.275	4.005.140	–	9.002.415
	Einlagenzertifikate	30.485.245	–	–	30.485.245
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	15.244.057	–	15.244.057
	Commercial Paper	–	41.977.848	–	41.977.848
	Aktien	11.635.106	–	23.683	11.658.789
	Aktienindex-Swaps	–	237.927	–	237.927
	Aktien-Swaps	–	5.566.346	–	5.566.346
	Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN)	–	13.632.347	–	13.632.347
	Terminkontrakte (Forwards)	–	129.730	–	129.730
	Finanzielle Vermögenswerte	47.117.626	80.793.395	23.683	127.934.704
	Aktienindex-Swaps	–	(1.162.066)	–	(1.162.066)
	Aktien-Swaps	–	(2.514.771)	–	(2.514.771)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.261.617)	–	(2.261.617)
	Futures	(291.805)	–	–	(291.805)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(291.805)	(5.938.454)	–	(6.230.259)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	55.728.794	29.031.083	–	84.759.877
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	6.876.198	–	6.876.198
	Aktien-Swaps	–	3.413.559	–	3.413.559
	Terminkontrakte (Forwards)	–	945.054	–	945.054
	Futures	3.315	–	–	3.315
	Total Return Swaps	–	9.692.356	–	9.692.356
	Finanzielle Vermögenswerte	55.732.109	49.958.250	–	105.690.359
	Aktien-Swaps	–	(8.647.202)	–	(8.647.202)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(37.677)	–	(37.677)
	Futures	(15.470)	–	–	(15.470)
	Total Return Swaps	–	(3.468.234)	–	(3.468.234)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(15.470)	(12.153.113)	–	(12.168.583)
BNY Mellon Asian Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	194.610	–	194.610
	Aktien	12.724.072	1.732.579	–	14.456.651
	Terminkontrakte (Forwards)	–	15	–	15
	Finanzielle Vermögenswerte	12.724.072	1.927.204	–	14.651.276
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1)	–	(1)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1)	–	(1)
BNY Mellon Asian Opportunities Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	58.137.558	–	–	58.137.558
	Finanzielle Vermögenswerte	58.137.558	–	–	58.137.558
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(61)	–	(61)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(61)	–	(61)
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	92.751.964	–	–	92.751.964
	Terminkontrakte (Forwards)	–	275.976	–	275.976
	Finanzielle Vermögenswerte	92.751.964	275.976	–	93.027.940
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(51.332)	–	(51.332)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(51.332)	–	(51.332)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	36.554.442	5.517.210	–	42.071.652
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.996	–	3.996
	Finanzielle Vermögenswerte	36.554.442	5.521.206	–	42.075.648
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.787)	–	(1.787)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.787)	–	(1.787)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	21.154.917	–	–	21.154.917
	Credit Default Swaps	–	921.017	–	921.017
	Aktien-Swaps	–	18	–	18
	Terminkontrakte (Forwards)	–	249.524	–	249.524
	Futures	345.671	–	–	345.671
	Finanzielle Vermögenswerte	21.500.588	1.170.559	–	22.671.147
	Aktien-Swaps	–	(6.255)	–	(6.255)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(182.082)	–	(182.082)
	Futures	(120.124)	–	–	(120.124)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(120.124)	(188.337)	–	(308.461)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	34.994.461	–	–	34.994.461
	Aktien	552.967.187	–	–	552.967.187
	Terminkontrakte (Forwards)	–	40.477	–	40.477
	Futures	2.927.226	–	–	2.927.226
	Optionen	19.386.988	–	–	19.386.988
	Finanzielle Vermögenswerte	610.275.862	40.477	–	610.316.339
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(37)	–	(37)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(37)	–	(37)
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	183.957.110	–	183.957.110
	Credit Default Swaps	–	462.608	–	462.608
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.415.514	–	3.415.514
	Finanzielle Vermögenswerte	–	187.835.232	–	187.835.232
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(363.707)	–	(363.707)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(363.707)	–	(363.707)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	19.611.588	–	19.611.588
	Credit Default Swaps	–	43.971	–	43.971
	Terminkontrakte (Forwards)	–	496.198	–	496.198
	Futures	12.616	–	–	12.616
	Finanzielle Vermögenswerte	12.616	20.151.757	–	20.164.373
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(53.875)	–	(53.875)
	Futures	(7.074)	–	–	(7.074)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(7.074)	(53.875)	–	(60.949)
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	1.870.934.871	–	1.870.934.871
	Terminkontrakte (Forwards)	–	14.611.501	–	14.611.501
	Futures	409.474	–	–	409.474
	Finanzielle Vermögenswerte	409.474	1.885.546.372	–	1.885.955.846
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.130.766)	–	(2.130.766)
	Futures	(1.062.188)	–	–	(1.062.188)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.062.188)	(2.130.766)	–	(3.192.954)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	699.088.728	11.281	699.100.009
	Credit Default Swaps	–	4.353.157	–	4.353.157
	Aktien	3.934	–	–	3.934
	Terminkontrakte (Forwards)	–	10.495.044	–	10.495.044
	Optionsscheine	–	3.742	–	3.742
	Finanzielle Vermögenswerte	3.934	713.940.671	11.281	713.955.886
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.088.433)	–	(4.088.433)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(4.088.433)	–	(4.088.433)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	502.246.150	–	502.246.150
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	28.749.161	–	28.749.161
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.201.624	–	1.201.624
	Futures	76.471	–	–	76.471
	Finanzielle Vermögenswerte	76.471	532.196.935	–	532.273.406
	Credit Default Swaps	–	(82.256)	–	(82.256)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.371)	–	(10.371)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
-------	-----------------	---------	---------	---------	-----------------------------

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.

	USD	USD	USD	USD
Futures	(247.063)	–	–	(247.063)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(247.063)	(92.627)	–	(339.690)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	31.911.805	–	31.911.805
Terminkontrakte (Forwards)	–	9.510	–	9.510
Futures	27.476	–	–	27.476
Finanzielle Vermögenswerte	27.476	31.921.315	–	31.948.791
Terminkontrakte (Forwards)	–	(5.140)	–	(5.140)
Futures	(40.411)	–	–	(40.411)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(40.411)	(5.140)	–	(45.551)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	103.195.739	–	103.195.739
Terminkontrakte (Forwards)	–	910.828	–	910.828
Finanzielle Vermögenswerte	–	104.106.567	–	104.106.567
Terminkontrakte (Forwards)	–	(481.453)	–	(481.453)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(481.453)	–	(481.453)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	26.531.803	–	26.531.803
Terminkontrakte (Forwards)	–	96.068	–	96.068
Futures	3.494	–	–	3.494
Finanzielle Vermögenswerte	3.494	26.627.871	–	26.631.365
Terminkontrakte (Forwards)	–	(81.789)	–	(81.789)
Futures	(1.441)	–	–	(1.441)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.441)	(81.789)	–	(83.230)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	114.981.928	–	114.981.928
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	4.014.000	–	4.014.000
Terminkontrakte (Forwards)	–	2.094.578	–	2.094.578
Futures	120.229	–	–	120.229
Finanzielle Vermögenswerte	120.229	121.090.506	–	121.210.735
Credit Default Swaps	–	(35.277)	–	(35.277)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.					
		USD	USD	USD	USD
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(388.669)	–	(388.669)
	Futures	(70.322)	–	–	(70.322)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(70.322)	(423.946)	–	(494.268)
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	67.333.866	199.928.315	–	267.262.181
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.426.564	–	2.426.564
	Terminkontrakte (Forwards)	–	411.469	–	411.469
	Finanzielle Vermögenswerte	67.333.866	202.766.348	–	270.100.214
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(267.752)	–	(267.752)
	Futures	(261.581)	–	–	(261.581)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(261.581)	(267.752)	–	(529.333)
BNY Mellon European Credit Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	38.083.369	–	38.083.369
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.473.494	–	1.473.494
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.141	–	3.141
	Futures	37.238	–	–	37.238
	Finanzielle Vermögenswerte	37.238	39.560.004	–	39.597.242
	Credit Default Swaps	–	(111.371)	–	(111.371)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(29.711)	–	(29.711)
	Futures	(6.997)	–	–	(6.997)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(6.997)	(141.082)	–	(148.079)
BNY Mellon Future Earth Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.052.857	–	–	2.052.857
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	45.419	–	45.419
	Terminkontrakte (Forwards)	–	687	–	687
	Finanzielle Vermögenswerte	2.052.857	46.106	–	2.098.963
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(58)	–	(58)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(58)	–	(58)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Future Food Fund**					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.697.272	–	–	2.697.272
	Finanzielle Vermögenswerte	2.697.272	–	–	2.697.272
BNY Mellon Future Life Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	2.298.463	–	–	2.298.463
	Finanzielle Vermögenswerte	2.298.463	–	–	2.298.463
BNY Mellon Global Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	175.103.919	226.496.743	–	401.600.662
	Organismen für gemeinsame Anlagen	22.509.231	–	–	22.509.231
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.640.448	–	3.640.448
	Futures	231.888	–	–	231.888
	Optionen	196.188	–	–	196.188
	Finanzielle Vermögenswerte	198.041.226	230.137.191	–	428.178.417
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.982.261)	–	(1.982.261)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.982.261)	–	(1.982.261)
BNY Mellon Global Credit Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	55.052.378	376.828.674	–	431.881.052
	Organismen für gemeinsame Anlagen	–	850.000	–	850.000
	Credit Default Swaps	–	5.740.006	–	5.740.006
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.515.790	–	1.515.790
	Futures	554.831	–	–	554.831
	Optionen	–	54.460	–	54.460
	Finanzielle Vermögenswerte	55.607.209	384.988.930	–	440.596.139
	Credit Default Swaps	–	(4.948.648)	–	(4.948.648)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.236.892)	–	(4.236.892)
	Futures	(160.987)	–	–	(160.987)
	Optionen	–	(3.667.764)	–	(3.667.764)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(160.987)	(12.853.304)	–	(13.014.291)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	47.739.829	326.031.282	–	373.771.111
	Organismen für gemeinsame Anlagen	13.148.875	6.620.068	–	19.768.943
	Terminkontrakte (Forwards)	–	5.430.962	–	5.430.962
	Futures	410.313	–	–	410.313
	Optionen	217.313	–	–	217.313
	Finanzielle Vermögenswerte	61.516.330	338.082.312	–	399.598.642
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.874.889)	–	(1.874.889)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.874.889)	–	(1.874.889)
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	52.483.572	–	–	52.483.572
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.329	–	2.329
	Finanzielle Vermögenswerte	52.483.572	2.329	–	52.485.901
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(255)	–	(255)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(255)	–	(255)
BNY Mellon Global Equity Fund**					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	491.911.402	5.467.145	–	497.378.547
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.152	–	1.152
	Finanzielle Vermögenswerte	491.911.402	5.468.297	–	497.379.699
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(92)	–	(92)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(92)	–	(92)
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	390.269.867	15.017.423	–	405.287.290
	Terminkontrakte (Forwards)	–	33.009	–	33.009
	Optionsscheine	–	566.286	–	566.286
	Finanzielle Vermögenswerte	390.269.867	15.616.718	–	405.886.585
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(2.591)	–	(2.591)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(2.591)	–	(2.591)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	-	151.929.942	-	151.929.942
	Aktien	69.741	-	-	69.741
	Terminkontrakte (Forwards)	-	102.431	-	102.431
	Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	-	5.848.443	1.288.479	7.136.922
	Finanzielle Vermögenswerte	69.741	157.880.816	1.288.479	159.239.036
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(163.678)	-	(163.678)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	-	(163.678)	-	(163.678)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	223.483.722	-	-	223.483.722
	Terminkontrakte (Forwards)	-	1.813.323	-	1.813.323
	Finanzielle Vermögenswerte	223.483.722	1.813.323	-	225.297.045
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(48.500)	-	(48.500)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	-	(48.500)	-	(48.500)
BNY Mellon Global Leaders Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	64.493.318	-	-	64.493.318
	Terminkontrakte (Forwards)	-	7.178	-	7.178
	Finanzielle Vermögenswerte	64.493.318	7.178	-	64.500.496
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(562)	-	(562)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	-	(562)	-	(562)
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	36.531.985	-	-	36.531.985
	Terminkontrakte (Forwards)	-	608	-	608
	Finanzielle Vermögenswerte	36.531.985	608	-	36.532.593
	Terminkontrakte (Forwards)	-	(51)	-	(51)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	-	(51)	-	(51)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	182.410.297	–	182.410.297
	Organismen für gemeinsame Anlagen	117.419.475	33.340.073	–	150.759.548
	Aktien	1.929.659.458	43.237.692	–	1.972.897.150
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	209.989.824	–	209.989.824
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.678.463	–	2.678.463
	Futures	1.619.234	–	–	1.619.234
	Optionen	26.754.878	–	–	26.754.878
	Optionsscheine	–	184.027.446	–	184.027.446
	Finanzielle Vermögenswerte	2.075.453.045	655.683.795	–	2.731.136.840
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(44.019.460)	–	(44.019.460)
	Futures	(2.277.516)	–	–	(2.277.516)
	Optionen	(18.691.421)	–	–	(18.691.421)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(20.968.937)	(44.019.460)	–	(64.988.397)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
		GBP	GBP	GBP	GBP
	Anleihen	3.598.596	3.449.812	–	7.048.408
	Organismen für gemeinsame Anlagen	2.288.129	803.879	–	3.092.008
	Aktien	39.261.420	809.393	–	40.070.813
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	4.239.503	–	4.239.503
	Terminkontrakte (Forwards)	–	208.957	–	208.957
	Futures	29.700	–	–	29.700
	Optionen	540.005	–	–	540.005
	Optionsscheine	–	3.685.913	–	3.685.913
	Finanzielle Vermögenswerte	45.717.850	13.197.457	–	58.915.307
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(180.785)	–	(180.785)
	Futures	(46.560)	–	–	(46.560)
	Optionen	(376.900)	–	–	(376.900)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(423.460)	(180.785)	–	(604.245)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	28.068.125	15.794.468	–	43.862.593
	Organismen für gemeinsame Anlagen	13.835.809	3.523.686	–	17.359.495
	Aktien	266.230.258	5.208.870	–	271.439.128
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	26.792.544	–	26.792.544
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.191.163	–	3.191.163
	Futures	189.596	–	–	189.596
	Optionen	3.645.801	–	–	3.645.801
	Optionsscheine	–	21.982.814	–	21.982.814
	Finanzielle Vermögenswerte	311.969.589	76.493.545	–	388.463.134
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(362.098)	–	(362.098)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
-------	-----------------	---------	---------	---------	-----------------------------

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.

	USD	USD	USD	USD
Futures	(316.381)	–	–	(316.381)
Optionen	(2.544.192)	–	–	(2.544.192)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.860.573)	(362.098)	–	(3.222.671)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	666.003.090	–	666.003.090
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	73.536.026	–	73.536.026
Credit Default Swaps	–	116.058	–	116.058
Terminkontrakte (Forwards)	–	11.959.722	–	11.959.722
Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	–	25.637.859	8.929.100	34.566.959
Finanzielle Vermögenswerte	–	777.252.755	8.929.100	786.181.855
Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.769.339)	–	(1.769.339)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.769.339)	–	(1.769.339)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

	USD	USD	USD	USD
Anleihen	2.833.378	2.601.357	–	5.434.735
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	203.942	–	203.942
Aktien	21.044.566	121.785	–	21.166.351
Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	1.408.020	–	1.408.020
Börsengehandelte Rohstoffe	1.499.596	–	–	1.499.596
Terminkontrakte (Forwards)	–	45.467	–	45.467
Finanzielle Vermögenswerte	25.377.540	4.380.571	–	29.758.111
Terminkontrakte (Forwards)	–	(136.007)	–	(136.007)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(136.007)	–	(136.007)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

	JPY	JPY	JPY	JPY
Aktien	20.509.402.150	–	–	20.509.402.150
Terminkontrakte (Forwards)	–	149.024.725	–	149.024.725
Finanzielle Vermögenswerte	20.509.402.150	149.024.725	–	20.658.426.875
Terminkontrakte (Forwards)	–	(10.069.632)	–	(10.069.632)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(10.069.632)	–	(10.069.632)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	1.573.332.184	–	–	1.573.332.184
	Terminkontrakte (Forwards)	–	40.171	–	40.171
	Finanzielle Vermögenswerte	1.573.332.184	40.171	–	1.573.372.355
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(76.616)	–	(76.616)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(76.616)	–	(76.616)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	970.198.399	–	–	970.198.399
	Terminkontrakte (Forwards)	–	2.775.355	–	2.775.355
	Finanzielle Vermögenswerte	970.198.399	2.775.355	–	972.973.754
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(284.872)	–	(284.872)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(284.872)	–	(284.872)
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Aktien	78.056.236	1.819.497	–	79.875.733
	Finanzielle Vermögenswerte	78.056.236	1.819.497	–	79.875.733
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	4.826.796	129.994	–	4.956.790
	Terminkontrakte (Forwards)	–	6.800	–	6.800
	Finanzielle Vermögenswerte	4.826.796	136.794	–	4.963.590
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(656)	–	(656)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(656)	–	(656)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	29.545.900	273.481.165	–	303.027.065
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.546.746	–	1.546.746
	Futures	311.972	–	–	311.972
	Optionen	167.604	–	–	167.604
	Finanzielle Vermögenswerte	30.025.476	275.027.911	–	305.053.387
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(4.219.461)	–	(4.219.461)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(4.219.461)	–	(4.219.461)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	2.327.728	–	2.327.728
	Organismen für gemeinsame Anlagen	771.336	2.309.475	–	3.080.811
	Aktien	49.486.377	862.181	–	50.348.558
	Kapitalbeteiligungsinstrumente	–	5.418.755	–	5.418.755
	Terminkontrakte (Forwards)	–	53.265	–	53.265
	Futures	25.814	–	–	25.814
	Optionen	618.875	–	–	618.875
	Optionsscheine	–	3.768.345	–	3.768.345
	Finanzielle Vermögenswerte	50.902.402	14.739.749	–	65.642.151
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(993.467)	–	(993.467)
	Futures	(53.523)	–	–	(53.523)
	Optionen	(431.344)	–	–	(431.344)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(484.867)	(993.467)	–	(1.478.334)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	27.899.871	62.667.966	349.685	90.917.522
	Terminkontrakte (Forwards)	–	1.951.732	–	1.951.732
	Futures	470.392	–	–	470.392
	Finanzielle Vermögenswerte	28.370.263	64.619.698	349.685	93.339.646
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(162.053)	–	(162.053)
	Futures	(122.825)	–	–	(122.825)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(122.825)	(162.053)	–	(284.878)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Aktien	280.774.258	–	–	280.774.258
	Terminkontrakte (Forwards)	–	53.880	–	53.880
	Vorzugsanleihen	–	3.992.998	–	3.992.998
	Finanzielle Vermögenswerte	280.774.258	4.046.878	–	284.821.136
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(1.338)	–	(1.338)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.338)	–	(1.338)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
		USD	USD	USD	USD
	Anleihen	–	986.507.151	3.160.000	989.667.151
	Terminkontrakte (Forwards)	–	3.695.769	–	3.695.769
	Finanzielle Vermögenswerte	–	990.202.920	3.160.000	993.362.920
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(29.655)	–	(29.655)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(29.655)	–	(29.655)

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds	Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt 31. Dezember 2021
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund					
		EUR	EUR	EUR	EUR
	Anleihen	–	949.471.549	–	949.471.549
	Terminkontrakte (Forwards)	–	34.951	–	34.951
	Futures	1.162.238	–	–	1.162.238
	Finanzielle Vermögenswerte	1.162.238	949.506.500	–	950.668.738
	Credit Default Swaps	–	(1.295.007)	–	(1.295.007)
	Terminkontrakte (Forwards)	–	(605.016)	–	(605.016)
	Futures	(206.623)	–	–	(206.623)
	Finanzielle Verbindlichkeiten	(206.623)	(1.900.023)	–	(2.106.646)

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen 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 Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte (Verluste)/Gewinne	(366.426)	17.045	(349.381)
Nicht realisierte Verluste	(301.888)	(114.463)	(416.351)
Schlusssaldo	189.783	1.313.810	1.503.593

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen 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 Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	115	115
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlusssaldo	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)
Schlussaldo	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
Schlussaldo	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
Schlussaldo	233.654	233.654

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

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)
Schlussaldo	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)
Schlussaldo	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)
Schlussaldo	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

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)
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	21.039	21.039
Verkäufe	(67.001)	(67.001)
Übertragungen in Stufe 3	870.050	870.050
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	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	Gesamt USD
		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	Organismen für gemeinsame Anlagen	Gesamt EUR
	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)
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen	Gesamt USD
	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
Schlussaldo	489.564	489.564

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
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	–	–
Schlussaldo	–	–

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen EUR	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR	Gesamt EUR
Anfangssaldo	596.439	7.122.782	7.719.221
Käufe	375.992	–	375.992
Verkäufe	–	(3.228.587)	(3.228.587)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(596.439)	(2.075.488)	(2.671.927)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden			
Realisierte Verluste	–	(98.037)	(98.037)
Nicht realisierte (Verluste)/Gewinne	(3.195)	462.240	459.045
Schlussaldo	372.797	2.182.910	2.555.707

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen GBP	Gesamt GBP
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(23.686)	(23.686)
Übertragungen in Stufe 3	1.057.288	1.057.288
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	23.686	23.686
Nicht realisierte Verluste	(1.033.605)	(1.033.605)
Schlussaldo	23.683	23.683

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Asian Income Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame Anlagen	Gesamt
	USD	USD
Anfangssaldo	660	660
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(660)	(660)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

Einzelheiten	Anleihen	Gesamt
	USD	USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	17.371	17.371
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 Verluste	(6.090)	(6.090)
Schlussaldo	11.281	11.281

BNY Mellon Global Credit Fund

Einzelheiten	Anleihen	Gesamt
	USD	USD
Anfangssaldo	1.343.135	1.343.135
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(1.343.135)	(1.343.135)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlussaldo	–	–

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Equity Income Fund

Einzelheiten	Organismen für gemeinsame	
	Anlagen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	5.902	5.902
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(5.902)	(5.902)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlussaldo	–	–

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	
	USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	791.689	791.689
Verkäufe	(7.011)	(7.011)
Übertragungen in Stufe 3	476.533	476.533
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	10	10
Nicht realisierte Gewinne	27.258	27.258
Schlussaldo	1.288.479	1.288.479

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Einzelheiten	Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans)	
	USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	7.824.673	7.824.673
Käufe	3.382.940	3.382.940
Verkäufe	(1.612.643)	(1.612.643)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	25.438	25.438
Nicht realisierte Verluste	(691.308)	(691.308)
Schlussaldo	8.929.100	8.929.100

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	1.550.000	1.550.000
Käufe	350.000	350.000
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(1.550.000)	(1.550.000)
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Verluste	(315)	(315)
Schlussaldo	349.685	349.685

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Einzelheiten	Anleihen USD	Gesamt USD
Anfangssaldo	–	–
Käufe	–	–
Verkäufe	(3.000.000)	(3.000.000)
Übertragungen in Stufe 3	6.160.000	6.160.000
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden		
Realisierte Gewinne	–	–
Nicht realisierte Gewinne	–	–
Schlussaldo	3.160.000	3.160.000

Übertragungen gelten als zu Beginn des Geschäftsjahres vollzogen.

Die Übertragung von Stufe 2 in Stufe 3 bezieht sich auf Anleihepositionen, deren Emittenten eine Verringerung der Handelsaktivität verzeichneten, wobei diese zum Geschäftsjahresende inaktiv (d. h. abgelaufen) war. Die Kurse dieser Wertpapiere wurden zu den Kosten oder dem beizulegenden Zeitwert unter Verwendung der Kursnotierung eines Maklers berechnet und führten zur Neuordnung in Stufe 3.

Die Übertragungen aus Stufe 3 beziehen sich auf Wertpapiere, die zu Anschaffungskosten bewertet wurden und in der Folge einem aktiven Handel und einer normalen Preisgestaltung unterlagen.

17. VERPFLICHTUNGEN UND EVENTUALVERBINDLICHKEITEN

Es bestanden keine Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten zum 31. Dezember 2022 oder zum 31. Dezember 2021.

18. HAFTUNGSTRENNUNG

Die Gesellschaft macht von den Bestimmungen zur Haftungstrennung in Abschnitt 1405 (1) des Companies Act 2014 Gebrauch. Nach irischem Recht ist die Gesellschaft als Ganzes demnach generell nicht haftbar gegenüber Dritten, und generell besteht kein Potenzial für eine wechselseitige Haftung zwischen den Fonds.

19. WICHTIGE EREIGNISSE

Der Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund wurde am 10. Januar 2022 aufgelegt.

19. WICHTIGE EREIGNISSE Forts.

Die Auswirkungen des russischen Einmarschs in die Ukraine im Februar 2022 waren wichtige Schwerpunktbereiche für die Verwaltungsgesellschaft und die Anlageverwalter im Geschäftsjahr und werden dies auch weiterhin sein. Engagements in Russland und in der Ukraine sowie liquiditäts- und bewertungsbezogene Probleme für alle diesbezüglichen Bestände wurden genau beobachtet und alle geltenden Sanktionen wurden befolgt. Weitere Informationen über die Auswirkungen auf die Teilfonds finden Sie in den Berichten der Anlageverwalter auf den Seiten 11 bis 46 des Berichts und Abschlusses.

Der BNY Mellon Global High Yield Bond Fund wurde am 11. März 2022 in Hongkong registriert. Außerdem wurden im Rahmen dieser Aktualisierung die US-Geschäftstage für den Fonds hinzugefügt.

Am 4. April 2022 wurde Newton Investment Management North America LLC zum Untieranlageverwalter für die folgenden Teilfonds ernannt:

- BNY Mellon Asian Income Fund
- BNY Mellon Future Earth Fund
- BNY Mellon Future Food Fund**
- BNY Mellon Future Life Fund
- BNY Mellon Global Dynamic Bond 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 Unconstrained Fund
- BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund
- BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

Darüber hinaus wurde Newton Investment Management Limited zum Untieranlageverwalter für die folgenden Teilfonds ernannt:

- BNY Mellon Blockchain Innovation Fund
- BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund
- BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund
- BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

Die jährliche Aktualisierung des Prospekts für die Gesellschaft erfolgte am 3. Mai 2022, und die wesentlichen Aktualisierungen sind nachstehend aufgeführt:

- Hinzufügung von US-amerikanischen Geschäftstagen für die folgenden Fonds: BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund, BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund, BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Future Food Fund**, BNY Mellon Future Life Fund, BNY Mellon Global Equity Fund**, BNY Mellon Global Equity Income Fund, BNY Mellon Global Leaders Fund, BNY Mellon Global Opportunities Fund, BNY Mellon Global Unconstrained Fund, BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund und BNY Mellon Targeted Return Bond Fund.
- Hinzufügung einer Weiterdelegierung der Anlageverwaltung von Insight Investment Management (Global) Limited an Insight North America LLC für die folgenden Fonds: BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund, BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund und BNY Mellon Global Credit Fund.
- Aktualisierung der folgenden Fonds, um Anlagen in Varianzswaps zu ermöglichen: BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) und BNY Mellon Global Real Return Fund (USD).
- Aktualisierung des Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund, um Anlagen in Proceed Bonds zu ermöglichen.
- Aktualisierung der folgenden Fonds dahingehend, dass bei gespaltenen Ratings von Schuldtiteln und schuldtitelbezogenen Wertpapieren (d. h. zwei oder mehr Ratingagenturen vergeben unterschiedliche Ratings) das niedrigere der beiden höchsten Ratings und nicht das höchste Rating herangezogen wird. Diese Fonds wurden zudem aktualisiert, um ihre Politik zur Verwaltung von Barmitteln und Sicherheitsleistungen klarzustellen: BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund, Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund und Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund.

19. WICHTIGE EREIGNISSE Forts.

Die jährliche Aktualisierung des Prospekts für die Gesellschaft erfolgte am 3. Mai 2022, und die unwesentlichen Aktualisierungen sind nachstehend aufgeführt:

- Die Anlagepolitik der folgenden Fonds wurde aktualisiert, um den deutschen VAG-Anforderungen Rechnung zu tragen: BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund, Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund und Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund.
- Die Anlagepolitik des BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund wurde aktualisiert, um den Prozentsatz der US-Aktien im Fonds zu präzisieren.
- Die Definition von nachrangigen Schuldtiteln wurde in der Anlagepolitik des BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund näher erläutert.
- Die Strategien der folgenden Fonds wurden aktualisiert, um widerzuspiegeln, dass der Anlageverwalter nicht mehr innerhalb von drei Monaten solche Wertpapiere verkaufen muss, die nicht mit dem Anlageziel vereinbar sind: BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund und BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund.
- Aufhebung der Möglichkeit für die folgenden Fonds, an Wertpapierleihgeschäften teilzunehmen: BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund, BNY Mellon Future Earth Fund, Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund und Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund.
- Streichung der Formulierung „Long- und Short-Positionen“ aus dem Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund. Damit soll verdeutlicht werden, dass der Fonds zur Erreichung seines Anlageziels nicht mehr in jeder Anlageklasse synthetische Long- und Short-Positionen eingehen wird.

Am 31. Mai 2022 wurde der BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-9 zu ermöglichen. Der BNY Mellon Future Earth Fund wurde modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-8 in SFDR-Artikel-9 zu ermöglichen.

Am 24. Juni 2022 wurde der erste Nachtrag zum Prospekt der Gesellschaft hinzugefügt, um darzulegen, dass die Verwaltungsgesellschaft ihre derzeitige Position beibehält und das PAI-Regime nicht berücksichtigt.

Die folgenden Fonds wurden aktualisiert, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass die nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren aus der Perspektive des Schadens betrachtet werden, den Anlagepositionen extern für Nachhaltigkeitsfaktoren verursachen könnten, und dass Schritte unternommen werden, um diesen Schaden zu mindern: Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR), Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund, BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund und BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund.

Am 3. Mai 2022 wurde der Nachtrag zum BNY Mellon Global Bond Fund aktualisiert, um eine Anlagegrenze von 20 % für chinesische Wertpapiermärkte zu berücksichtigen.

Caylie Stallard wurde mit Wirkung vom 8. Juni 2022 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft bestellt.

Am 20. Juli 2022 wurde der BNY Mellon Mobility Innovation Fund modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu berücksichtigen.

Mark Flaherty wurde mit Wirkung vom 22. Juli 2022 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft bestellt.

Der BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund wurde am 23. September 2022 aufgelegt.

Am 30. September 2022 wurde der BNY Mellon Blockchain Innovation Fund modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu berücksichtigen.

Am 30. September 2022 wurden in den Nachträgen des BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), des BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), des BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) und des BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Grenzen für alternative Risikoprämien aufgenommen.

Mit Wirkung vom 7. November 2022 wurden der BNY Mellon Asian Equity Fund in BNY Mellon Asian Opportunities Fund und der BNY Mellon Global Emerging Markets Fund in BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund umbenannt.

19. WICHTIGE EREIGNISSE Forts.

Am 7. November 2022 wurde der BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund modifiziert, um eine Umstufung von SFDR-Artikel-6 in SFDR-Artikel-8 zu berücksichtigen.

Am 7. November 2022 wurde dem Prospekt ein Nachtrag hinzugefügt, der die Änderungen der Gründungsurkunde und der Satzung in Bezug auf nicht auffindbare Anteilsinhaber, unbeanspruchte Vermögenswerte und geringfügiges Vermögen widerspiegelt. Diese Aktualisierung umfasste auch den Verkauf von Alcentra und die Ernennung von Caylie Stallard und Mark Flaherty zu Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft.

Am 30. November 2022 wurde der Prospekt aktualisiert, um die Änderungen der SFDR-Stufe 2 im Haupttext und in den entsprechenden Nachträgen zu berücksichtigen und SFDR-Anhänge für die Teilfonds gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der SFDR hinzuzufügen.

Außer den vorgenannten Ereignissen sind im Geschäftsjahr keine weiteren wichtigen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft eingetreten.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Die Gesellschaft gab am 3. Januar 2023 und am 3. April 2023 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Währung der	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	Klasse R (Inc)	EUR	0,1783	0,2777
	Klasse T (Hedged)	CHF	0,2980	0,3989
	Klasse T (Hedged)	USD	0,2315	0,4749
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	0,3629	0,4816
	Klasse W (Acc)	EUR	0,2391	0,3417
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,2600	0,3667
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,5575	0,6894
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				
	Klasse U (Inc) (Hedged)	EUR	0,0042	–
	Sterling U (Acc)	GBP	0,0002	–
	Sterling X (Acc)	GBP	0,0100	–
BNY Mellon Asian Income Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0113	0,0108
	Klasse A (Inc)	USD	0,0065	0,0064
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0086	0,0082
	Klasse B (Acc)	USD	0,0100	0,0090
	Klasse C (Acc)	USD	0,0099	0,0098
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0082	0,0079
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0097	0,0093
	Klasse W (Inc)	USD	0,0074	0,0073
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0105	0,0100

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Blockchain Innovation Fund				
	Klasse B (Acc)	USD	0,0005	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0036	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0111	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0118	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0049	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0033	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0037	–
	Klasse K (Acc)	USD	0,0006	–
	Klasse K (Acc)	EUR	0,0007	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0084	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0050	–
BNY Mellon Brazil Equity Fund				
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0659	–
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0782	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0707	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0588	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0531	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0930	–
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0173	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0169	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0170	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0165	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0171	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0169	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0165	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0171	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0170	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,0166	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0172	–
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0025	–
	Klasse A (Inc)	USD	0,0041	–
	Klasse C (Acc)	USD	0,0075	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0058	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0062	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0052	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0033	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0110	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0105	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0086	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0065	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0189	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0149	0,0163
	Klasse A (Inc)	USD	0,0136	0,0145
	Klasse C (Acc)	USD	0,0150	0,0163
	Klasse C (Inc)	USD	0,0136	0,0146
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0142	0,0156
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0146	0,0158
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0133	0,0141
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0141	0,0154
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0127	0,0138
	Klasse W (Acc)	USD	0,0154	0,0166
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0141	0,0155
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,1476	0,1625
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,1452	0,1579
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0146	0,0158
	Klasse W (Inc)	USD	0,0136	0,0146
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0128	0,0139
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0132	0,0141
	Klasse X (Acc)	USD	0,0151	0,0164
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0078	0,0089
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0085	0,0095
	Klasse W (Acc)	USD	0,0083	0,0095
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0077	0,0089
	Klasse X (Acc) (Hedged)	EUR	0,0086	0,0113
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0151	0,0165
	Klasse C (Acc)	USD	0,0151	0,0165
	Klasse C (Inc)	USD	0,0129	0,0138
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0132	0,0145
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0131	0,0144
	Klasse N (Acc)	USD	0,0133	0,0145
	Klasse N (Acc) (Hedged)	EUR	0,0126	0,0138
	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0043	0,0045
	Klasse W (Acc)	USD	0,0152	0,0166
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0131	0,0145
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0146	0,0158
	Klasse W (Inc)	USD	0,0130	0,0140
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0130	0,0141
	Klasse X (Acc)^	JPY	–	0,9115
	Klasse X (Acc)	USD	0,0153	0,0167
	Klasse X (Acc) (Hedged)^	JPY	–	0,8924
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0148	0,0161
	Klasse X (Inc)	USD	0,0140	0,0150
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0125	0,0134

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0152	0,0158
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0170	0,0172
	Klasse C (Acc)	USD	0,0208	0,0221
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0182	0,0196
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0194	0,0205
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0178	0,0190
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0174	0,0187
	Klasse K (Acc)	USD	0,0204	0,0216
	Klasse K (Acc) (Hedged)	EUR	0,0180	0,0193
	Klasse L (Acc)	USD	0,0205	0,0218
	Klasse L (Acc) (Hedged)	EUR	0,0182	0,0195
	Klasse L (Inc)	USD	0,0172	0,0179
	Klasse L (Inc) (Hedged)	EUR	0,0161	0,0170
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0181	0,0191
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,0147	0,0153
	Klasse W (Acc)	USD	0,0209	0,0223
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0185	0,0199
	Klasse W (Inc)	USD	0,0170	0,0177
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0133	0,0140
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0164	0,0170
	Klasse X (Acc)	USD	0,0171	0,0182
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0192	0,0203
	Sterling X (Inc) (Hedged)	GBP	0,0157	0,0163
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				
	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,5658	2,8259
	Klasse G (Inc)	USD	0,8430	0,9064
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,9855	1,0757
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,9462	1,0393
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,8356	0,9023
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,7747	0,8419
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,4010	1,5155
	Klasse X	USD	2,0469	2,2191
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund				
	Klasse C (Inc)	USD	0,0084	0,0078
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0110	0,0103
	Klasse X (Inc)	USD	0,0124	0,0118

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0051	0,0048
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0078	0,0072
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0122	0,0114
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0135	0,0124
	Klasse C (Inc)	USD	0,0060	0,0058
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0081	0,0076
	Sterling C (Acc)	GBP	0,0204	0,0193
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0099	0,0092
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,0046	0,0044
	Klasse W (Hedged)	EUR	0,0093	0,0092
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0075	0,0070
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0076	0,0074
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0082	0,0077
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0058	0,0056
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0147	0,0143
	Klasse X (Inc)	USD	0,0123	0,0117
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0150	0,0152
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0121	0,0120
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0136	0,0139
	Klasse W (Acc)	USD	0,0154	0,0156
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0132	0,0135
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0137	0,0138
	Klasse X (Acc)	USD	0,0158	0,0160
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0027	0,0032
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0034	0,0038
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0044	0,0048
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0036	0,0039
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0038	0,0042
BNY Mellon European Credit Fund				
	Klasse W (Acc)	EUR	0,2881	0,3642
	Klasse X	EUR	0,4985	0,5993
BNY Mellon Future Earth Fund				
	Klasse C (Acc)	USD	0,0027	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0085	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0027	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0046	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0045	–
BNY Mellon Future Food Fund⁴				
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0113	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0067	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Future Life Fund				
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0098	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0053	–
BNY Mellon Global Bond Fund				
	Klasse C	USD	0,0197	–
	Klasse C (Inc)	USD	0,0043	0,0047
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0124	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	AUD	0,0071	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0089	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0089	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0082	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0084	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0082	–
BNY Mellon Global Credit Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0148	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0170	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0277	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0051	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0265	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0345	–
	Klasse X (Acc)	JPY	2,8665	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0349	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	2,3675	–
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	Klasse A (Inc)	USD	0,0062	0,0072
	Klasse C	USD	0,0098	0,0112
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0088	0,0097
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0051	0,0060
	Klasse I (Hedged)	EUR	0,0073	0,0084
	Klasse I (Acc) (Hedged)	SGD	0,0069	0,0081
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0062	0,0071
	Klasse W	USD	0,0092	0,0104
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0069	0,0079
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0085	0,0096
	Klasse X (Acc) (Hedged)	JPY	0,8479	1,0214
	Klasse X (Inc) (Hedged)	JPY	0,7953	0,9496
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,0090	0,0098
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0085	0,0093
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0080	0,0090
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0076	0,0085
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0046	–
	Klasse E (Acc)	CHF	0,0041	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0005	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0001	–
BNY Mellon Global Equity Fund⁴				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0109	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0116	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Global Equity Income Fund				
	Klasse A	EUR	0,0207	0,0201
	Klasse A (Inc)	USD	0,0102	0,0101
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0099	0,0095
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0147	0,0142
	Klasse B	USD	0,0181	0,0182
	Klasse B	EUR	0,0208	0,0202
	Klasse B (Inc)	USD	0,0125	0,0125
	Klasse B (Inc)	EUR	0,0154	0,0149
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0164	0,0158
	Klasse C (Inc)	USD	0,0133	0,0132
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0156	0,0150
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0173	0,0167
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0104	0,0101
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0080	0,0079
	Klasse W	USD	0,0153	0,0154
	Klasse W	EUR	0,0190	0,0185
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0084	0,0085
	Klasse W (Inc)	USD	0,0113	0,0113
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0141	0,0136
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0207	0,0201
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0153	0,0147
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0129	0,0129
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0153	0,0148
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0089	0,0089
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0096	0,0093
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0096	0,0092
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				
	Klasse C (Inc)	USD	0,0118	0,0120
	Klasse W (Acc)	USD	0,0160	0,0164
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0141	0,0145
	Klasse X (Inc)	USD	0,0125	0,0127
	Klasse X (Inc) (Hedged)	EUR	0,0107	0,0110

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0086	0,0102
	Klasse A (Inc)	USD	0,0071	0,0083
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0077	0,0087
	Klasse B (Acc)	SGD	0,0105	0,0123
	Klasse B (Acc)	USD	0,0088	0,0104
	Klasse B (Inc)	USD	0,0072	0,0085
	Klasse B (Inc)	SGD	0,0093	0,0107
	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0048	0,0035
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0050	0,0036
	Klasse E (Inc)	USD	0,0076	0,0089
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0082	0,0093
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0069	0,0080
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0075	0,0089
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0062	0,0073
	Klasse J (Acc) (Hedged)	SGD	0,0107	0,0129
	Klasse J (Inc) (Hedged)	SGD	0,0095	0,0113
	Klasse W (Acc)	USD	0,0091	0,0107
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0079	0,0094
	Klasse W (Inc)	USD	0,0075	0,0088
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0065	0,0077
BNY Mellon Global Leaders Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0069	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0053	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0083	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0031	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0223	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0218	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0034	–
BNY Mellon Global Opportunities Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0048	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				
	Klasse A	EUR	0,0054	–
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0043	–
	Klasse C	EUR	0,0134	–
	Klasse C (Inc)	EUR	0,0108	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0103	–
	Klasse G (Inc)	EUR	0,0099	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	SGD	0,0043	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	0,0044	–
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	0,0043	–
	Klasse W	EUR	0,0158	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0125	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0121	–
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0145	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)				
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0021	–
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0020	–
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0073	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0124	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0110	–
	Sterling X (Acc)	GBP	0,0243	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)				
	Klasse A	USD	0,0056	–
	Klasse C	USD	0,0148	–
	Klasse C (Inc)	USD	0,0114	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0109	–
	Klasse W	USD	0,0156	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0137	–
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0140	0,0151
	Klasse A (Inc)	USD	0,0109	0,0116
	Klasse C (Acc)	USD	0,0159	0,0171
	Klasse G (Acc)	USD	0,0142	0,0153
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0120	0,0130
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0095	0,0101
	Klasse I (Acc) (Hedged)^	CHF	–	0,0065
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0136	0,0148
	Klasse I (Inc) (Hedged)	EUR	0,0104	0,0111
	Klasse W (Acc)	USD	0,0169	0,0181
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0140	0,0150
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0142	0,0153
	Klasse W (Inc)	USD	0,0126	0,0133
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0109	0,0116
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0155	0,0165
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0117	0,0123
	Klasse X (Acc)	USD	0,0191	0,0205
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0163	0,0173
	Klasse Y (Acc)	USD	0,0192	0,0206
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	0,0177	0,0188
	Klasse Z (Acc)	USD	0,0144	0,0154
	Klasse Z (Inc)	USD	0,0133	0,0141
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0146	0,0155
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0123	0,0129
BNY Mellon Global Unconstrained Fund				
	Klasse W (Acc)	USD	0,0138	–
	Klasse X (Acc) (Hedged)	CAD	0,0252	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund				
	Klasse C	USD	0,0022	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0086	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0096	–
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0028	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0057	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0060	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0783	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0740	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0146	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0056	–
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0007	–
	Klasse S (Acc) 1	USD	0,0072	–
	Klasse W	EUR	0,0088	–
	Klasse W	USD	0,0071	–
	Klasse W (Hedged)	USD	0,0090	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SGD	0,0042	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0067	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0095	–
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0077	–
	Klasse X (Acc)	USD	0,0023	–
	Sterling X	GBP	0,0310	–
BNY Mellon Mobility Innovation Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0051	–
	Klasse E (Acc)	CHF	0,0056	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0057	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0054	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0055	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0050	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0001	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0006	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0009	–
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0011	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0011	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0009	–
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund				
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0270	–
BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund				
	Klasse E (Acc)	USD	0,0003	–
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0003	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0005	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0046	0,0055
	Klasse A (Acc)	USD	0,0042	0,0052
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0045	0,0053
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0059	0,0067
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0073	0,0082
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0070	0,0079
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0059	0,0068
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0044	0,0052
	Klasse H (Acc) (Hedged)	USD	0,0017	0,0059
	Klasse H (Inc) (Hedged)	USD	0,0017	0,0059
	Klasse V (Acc)	EUR	0,0071	0,0080
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0065	0,0075
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0063	0,0071
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0067	0,0076
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0065	0,0073
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0059	0,0068
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	USD	–	0,0051
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0063	0,0070
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0080	0,0090
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0065	0,0074
	Klasse Z (Inc)	EUR	0,0063	0,0071
	Klasse Z (Inc) (Hedged)	USD	0,0067	0,0075
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0018	–
	Klasse A (Inc)	EUR	0,0019	–
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0125	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0130	–
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0076	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0096	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0093	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0101	–
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0096	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0100	–
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0095	0,0110
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0113	0,0128

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0067	0,0057
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0095	0,0079
	Klasse B (Inc)	USD	0,0080	0,0068
	Klasse C (Acc)	USD	0,0065	0,0056
	Klasse C (Inc)	USD	0,0088	0,0076
	Klasse E (Inc)	USD	0,0091	0,0078
	Klasse E (Inc)	EUR	0,0094	0,0078
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0108	0,0090
	Sterling E (Inc)	GBP	0,0095	0,0078
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0081	0,0068
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0064	0,0055
	Klasse W (Acc)	USD	0,0102	0,0088
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0098	0,0081
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0039	0,0050
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0065	0,0055
	Klasse W (Inc)	USD	0,0090	0,0077
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0039	0,0051
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0093	0,0077
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund				
	Klasse A (Acc)	USD	0,0161	–
	Klasse A (Inc)	USD	0,0152	–
	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0025	0,0026
	Klasse C (Acc)	USD	0,0198	–
	Klasse E (Acc)	USD	0,0191	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0164	–
	Klasse E (Acc) (Hedged)	EUR	0,0172	–
	Klasse G (Acc)	USD	0,0155	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	EUR	0,0165	–
	Klasse H (Acc) (Hedged)	CHF	0,0148	–
	Klasse H (Inc) (Hedged)	EUR	0,0138	–
	Klasse I (Acc) (Hedged)	EUR	0,0151	–
	Klasse W (Acc)	USD	0,0199	–
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0178	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	CHF	0,0166	–
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0171	–
	Klasse W (Inc)	USD	0,0163	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	CHF	0,0148	–
	Klasse W (Inc) (Hedged)	EUR	0,0143	–
	Klasse W (Inc) (M)	HKD	0,0308	0,0327
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0030	0,0032
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0153	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	CHF	0,0148	–
	Klasse Z (Acc) (Hedged)	EUR	0,0148	–

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	3. Januar 2023	3. April 2023
Responsible Horizons EM Debt Impact Fund<				
	Klasse E (Acc)^	USD	–	0,0091
	Klasse E (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,0089
	Klasse G (Acc)^	USD	–	0,0081
	Klasse G (Inc)^	USD	–	0,0083
	Klasse W (Acc)^	USD	–	0,0087
	Klasse W (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,0086
	Klasse W (Inc)^	USD	–	0,0087
	Klasse W (Inc) (Hedged)^	EUR	–	0,0086
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	0,0085
Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0015	0,0023
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0026	0,0035
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0028	0,0037
	Klasse W (Inc)	EUR	0,0028	0,0037
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0036	0,0046
	Klasse Z (Acc)	EUR	0,0030	0,0039
Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund				
	Klasse A (Acc)	EUR	0,0023	0,0033
	Klasse C (Acc)	EUR	0,0032	0,0040
	Klasse E (Acc)	EUR	0,0035	0,0042
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0035	0,0044
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0034	0,0043
	Klasse G (Acc)	EUR	0,0032	0,0040
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0032	0,0041
	Klasse W (Acc) (Hedged)	USD	0,0033	0,0043
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0033	0,0042
	Klasse X (Acc)	EUR	0,0037	0,0045
	Klasse X (Acc) (Hedged)	USD	0,0037	0,0047
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0037	0,0046

^ Bitte beachten Sie das nachstehende Ereignis in Bezug auf diesen Teilfonds.

^ Diese Anteilstklasse wurde im ersten Quartal 2023 aufgelegt.

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Die Gesellschaft gab am 4. Januar 2023 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Währung der	Währung	4. Januar 2023
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	Klasse C	USD	0,0022
	Klasse E (Acc) (Hedged)	CHF	0,0086
	Klasse E (Acc) (Hedged)	USD	0,0096
	Klasse G (Acc) (Hedged)	EUR	0,0028
	Klasse W (Acc)	EUR	0,0057
	Klasse W (Acc) (Hedged)	EUR	0,0060
	Klasse W (Acc) (Hedged)	NOK	0,0783
	Klasse W (Acc) (Hedged)	SEK	0,0740
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0146
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0056

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.

Die Gesellschaft gab am 2. Februar 2023 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Währung der	Währung	2. Februar 2023
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0046
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,5402
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0046
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0047
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0026
	Klasse W (Inc) (M)	HKD	0,0316
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0030

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 Untereinlageverwalter 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 Untereinlageverwalter 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

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

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.

Die Gesellschaft gab am 1. März 2023 folgende Ausschüttungen bekannt.

Fonds	Währung der	Währung	1. März 2023
BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund	Klasse N (Inc) (M)	USD	0,0044
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	Klasse A (Inc) (M)	HKD	2,7002
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	Klasse B (Inc) (M)	USD	0,0016
	Klasse B (Inc) (M)	SGD	0,0017
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Klasse A (Inc) (M)	USD	0,0026
	Klasse W (Inc) (M)	HKD	0,0324
	Klasse W (Inc) (M)	SGD	0,0032

Am 10. April 2023 werden 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.

Nach Ablauf des Geschäftsjahres hat es keine Ereignisse gegeben, die nach Auffassung der Verwaltungsgesellschaft eine Auswirkung auf den Jahresabschluss für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr hätten haben können.

21. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Jahresabschluss wurde am 13. April 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (ungeprüft)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Dec-2022	34.121.000	34.125.369	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Dec-2022	34.121.000	34.109.757
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	29.861.000	29.910.807	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	29.861.000	29.861.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Sep-2022	29.295.000	29.387.695	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Sep-2022	29.295.000	29.307.867
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Jun-2022	29.145.000	29.216.773	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Jun-2022	29.145.000	29.145.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Nov-2022	28.641.000	28.692.952	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Nov-2022	28.641.000	28.637.140
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2022	26.500.000	26.547.358	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2022	26.500.000	26.500.000
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	23.451.465	26.122.587	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	24.014.110	25.545.078
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	24.791.000	24.855.934	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	24.791.000	24.791.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2022	23.141.000	23.199.431	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Oct-2022	23.141.000	23.141.457
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2022	23.000.000	23.071.963	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2022	23.000.000	23.013.404
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Mar-2023	21.370.000	21.270.885	United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2022	21.500.000	19.392.936
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-May-2023	17.500.000	17.438.481	United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	21.000.000	18.817.197
Bundesobligation 0.000% 14-Apr-2023 0.000	17.000.000	16.908.200	United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	21.000.000	18.794.454
United Kingdom Gilt 1.125% 31-Jan-2039	17.500.000	16.890.111	United Kingdom Gilt 1.125% 31-Jan-2039	17.500.000	17.867.274
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Jun-2023	17.000.000	16.826.848	Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 11-Mar-2022	17.000.000	17.000.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2023	15.000.000	14.943.753	China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051	96.000.000	14.391.979
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Sep-2023	15.000.000	14.731.317	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.400% 22-Jun-2053	20.230.000	13.935.549
Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.400% 22-Jun-2053	20.230.000	14.710.843	Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051	2.290.000.000	13.815.996
Spain Government Bond '144A' 3.450% 30-Jul-2043	10.500.000	10.726.590	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067	11.000.000	11.574.178
Korea Treasury Bond 3.125% 10-Sep-2052	11.000.000.000	6.667.103	Spain Government Bond '144A' 3.450% 30-Jul-2043	10.500.000	9.854.460
New Zealand Government Bond 3.500% 14-Apr-2033	12.160.000	6.538.806	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	7.584.049	9.085.355
			German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022	8.361.000	8.361.000
			German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2022	8.295.000	8.295.000

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	18.851.750	18.851.750	Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund	17.900.475	17.900.475
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jan-2023	17.000.000	16.924.642	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2022	10.300.000	10.300.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2022	10.300.000	10.296.544	United Kingdom Gilt 0.500% 22-Jul-2022	10.000.000	10.000.000
United Kingdom Gilt 0.500% 22-Jul-2022	10.000.000	9.990.700	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Sep-2022	10.000.000	10.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Oct-2022	10.000.000	9.986.785	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Oct-2022	10.000.000	10.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Sep-2022	10.000.000	9.975.651	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Sep-2022	8.700.000	8.700.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Sep-2022	8.700.000	8.691.642	Banco Santander SA 0.000% 01-Feb-2022 CP	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jan-2023	6.000.000	5.983.994	Bank of America Corp 0.000% 29-Apr-2022 CD	5.000.000	5.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Sep-2022	4.700.000	4.693.375	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.000% 14-Mar-2022 CP	5.000.000	5.000.000
MUFG Bank Ltd. 0.500% 18-Mar-2022 CD	4.000.000	4.000.000	Dexia Credit Local SA 0.000% 01-Apr-2022 CP	5.000.000	5.000.000
Societe Generale SA 'EMTN' 2.650% 23-Nov-2022 CD	4.000.000	4.000.000	HSBC UK Bank PLC 'EMTN' FRN 2.129% 19-Sep-2022	5.000.000	5.000.000
Societe Generale SA 'EMTN' 2.935% 30-Nov-2022 CD	4.000.000	4.000.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' 0.000% 05-Sep-2022 CD	5.000.000	5.000.000
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale (Zero Coupon) 0.000% 23-Sep-2022 CP	4.000.000	3.999.563	Nordea Bank Abp 0.000% 25-Feb-2022 CP	5.000.000	5.000.000
Nederlandse Waterschapsbank (Zero Coupon) 0.000% 23-Sep-2022 CP	4.000.000	3.999.415	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.000% 22-Mar-2022 CP	5.000.000	5.000.000
First Abu Dhabi Bank PJSC 0.140% 13-Apr-2022 CD	4.000.000	3.998.261	Sumitomo Mitsui Banking Corporation 0.000% 28-Feb-2022 CD	5.000.000	5.000.000
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corporation 0.000% 15-Jul-2022 CD	4.000.000	3.998.083	Swedbank AB 0.000% 10-May-2022 CP	5.000.000	5.000.000
NRW Bank (Zero Coupon) 0.000% 17-Nov-2022 CP	4.000.000	3.997.608	Toronto-Dominion Bank/The 0.620% 01-Dec-2022 CD	5.000.000	5.000.000
Kingdom of Netherland (Zero Coupon) 0.000% 03-Oct-2022 CP	4.000.000	3.997.503	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-May-2022	5.000.000	5.000.000
Paccar Financial Europe B.V. 0.000% 20-Apr-2022 CP	4.000.000	3.997.240	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-Sep-2022	4.700.000	4.700.000
MUFG Bank Ltd (Zero Coupon) 0.000% 19-Sep-2022 CD	4.000.000	3.996.501	Bayerische Motoren Werke AG (Zero Coupon) 0.000% 28-Oct-2022 CP	4.000.000	4.000.000

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2022	28.000.000	28.003.896	Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2022	28.000.000	28.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	23.000.000	23.019.766	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	23.000.000	23.000.000
Bundesobligation (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2022	22.500.000	22.496.395	Bundesobligation (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2022	22.500.000	22.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Jan-2023	17.500.000	17.473.229	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 03-Aug-2022	17.000.000	17.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 03-Aug-2022	17.000.000	17.010.158	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2022	16.700.000	16.700.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2022	16.700.000	16.720.385	Kingdom of Belgium Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Mar-2022	16.700.000	16.700.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 14-Sep-2022	16.500.000	16.501.087	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 14-Sep-2022	16.500.000	16.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2022	16.000.000	16.005.322	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Sep-2022	16.000.000	16.000.000
European Union Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2023	15.700.000	15.680.999	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 27-Jul-2022	15.400.000	15.400.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 27-Jul-2022	15.400.000	15.422.000	German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	15.000.000	15.000.000
German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jul-2022	15.000.000	15.004.735	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.750% 04-Jul-2022	14.850.000	14.850.000
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.750% 04-Jul-2022	14.850.000	14.928.125	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Sep-2022	14.000.000	14.000.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Sep-2022	14.000.000	14.001.128	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2022	14.000.000	13.999.254
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Nov-2022	14.000.000	13.995.787	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022	12.500.000	12.500.027
Republic of Austria Government Bond 3.400% 22-Nov-2022	11.800.000	11.836.052	Republic of Austria Government Bond 3.400% 22-Nov-2022	11.800.000	11.800.440
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2022	11.000.000	11.014.738	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2022	11.000.000	11.001.217
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Aug-2022	11.000.000	11.007.641	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 06-Jul-2022	11.000.000	11.000.000
Austria Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	10.500.000	10.477.505	Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022	8.500.000	8.500.000
Kingdom of Belgium Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Mar-2022	10.000.000	10.008.688	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Nov-2022	8.500.000	8.499.702
Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund	1.720.309	8.900.000	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2022	8.403.135	8.403.305
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Nov-2022	8.500.000	8.495.801	Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 30-Aug-2022	8.000.000	8.002.483
Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 30-Aug-2022	8.000.000	8.002.303	Austrian Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Oct-2022	8.000.000	8.000.000
Austria Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Oct-2022	8.000.000	8.000.000	Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2022	8.000.000	8.000.000
Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2022	8.000.000	7.990.800	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 01-Jun-2022	7.000.000	7.000.000
Netherlands Government Bond '144A' 7.500% 15-Jan-2023	7.500.000	7.539.675	France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Aug-2022	6.500.000	6.500.000
France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 01-Jun-2022	7.000.000	7.003.536			

BNY Mellon Asian Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
National Australia Bank Ltd	33.268	696.471	BHP Group Ltd	17.703	529.406
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	13.599	612.318	Delta Electronics Inc	56.000	473.708
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	27.000	480.713	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	72.900	306.629
DBS Group Holdings Ltd	18.500	454.873	Bank Central Asia Tbk PT	485.900	271.681
Link REIT (Units) (REIT)	47.800	371.584	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	12.000	239.870
Woodside Energy Group Ltd	15.834	362.794	DBS Group Holdings Ltd	9.700	230.174
SK Telecom Co Ltd	8.236	323.898	Star Entertainment Grp Ltd/The	98.969	220.931
AIA Group Ltd	32.600	318.422	SKYCITY Entertainment Group Ltd	111.042	191.385
Singapore Exchange Ltd	44.500	312.003	United Overseas Bank Ltd	8.700	181.309
United Overseas Bank Ltd	14.100	304.689	Spark New Zealand Ltd	55.781	166.266
Insurance Australia Group Ltd	93.578	301.487	Venture Corp Ltd	9.800	125.861
Bank Mandiri Persero Tbk PT	446.700	288.134	ITC Ltd GDR	27.651	105.163
MediaTek Inc	10.000	273.470	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	25.600	100.650
Venture Corp Ltd	21.700	271.826	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	292.400	97.202
Singapore Technologies Engineering Ltd	90.000	246.718	SK Square Co Ltd	1.702	78.123
CLP Holdings Ltd	28.500	245.535	Singapore Technologies Engineering Ltd	25.500	69.904
KT Corp	9.280	244.318	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	1.303	54.367
Advantech Co Ltd	24.000	242.044	Link REIT (Units) (REIT)	4.600	32.933
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	36.500	232.847	AIA Group Ltd	2.800	30.863
BHP Group Ltd	7.173	222.714	Insurance Australia Group Ltd	8.963	28.660
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	5.000	218.436			
Dexus (REIT)	33.740	216.392			
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	626.800	192.547			
Infosys Ltd ADR	8.175	183.035			
ITC Ltd	41.853	174.730			
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	591.000	169.645			
Tingyi Cayman Islands Holding Corp	86.000	159.401			
Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	39.500	159.395			
Spark New Zealand Ltd	45.222	142.813			
ITC Ltd GDR	44.353	141.128			
Elite Material Co Ltd	20.000	139.323			
Transurban Group	14.422	136.347			
Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	41.400	136.211			
Delta Electronics Inc	14.000	118.828			
Hanon Systems	13.081	117.702			
Meridian Energy Ltd	35.724	111.191			
Macquarie Korea Infrastructure Fund	12.386	107.665			
By-health Co Ltd	33.300	103.466			

BNY Mellon Asian Opportunities Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
SK Hynix Inc	19.472	1.922.102	Housing Development Finance Corp Ltd	53.166	1.680.181
Sea Ltd ADR	11.161	1.359.402	Asian Paints Ltd	28.365	1.096.061
Marico Ltd	161.989	1.046.677	Titan Co Ltd	32.888	1.072.630
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	107.300	1.036.484	Alibaba Group Holding Ltd	97.708	1.033.539
Meituan '144A'	40.500	874.516	Maruti Suzuki India Ltd	8.093	852.355
Titan Co Ltd	29.989	803.470	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	199.000	819.830
HDFC Bank Ltd	37.512	757.796	LG Chem Ltd	1.545	694.367
Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	71.900	754.348	Jubilant Foodworks Ltd	98.165	678.005
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.034.100	646.801	Samsung SDI Co Ltd	1.519	667.549
NetEase Inc	35.600	591.989	Sungrow Power Supply Co Ltd	36.800	665.139
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	37.042	552.556	Tencent Music Entertainment Group ADR	136.267	595.911
OZ Minerals Ltd	36.024	529.205	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	60.800	592.084
ICICI Bank Ltd	45.148	492.650	AIA Group Ltd	50.000	518.604
Yum China Holdings Inc	10.167	479.342	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	28.000	512.061
ASML Holding NV	906	472.724	Meituan '144A'	19.200	509.827
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	67.617	467.643	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	417.500	508.648
ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	71.181	463.961	HDFC Bank Ltd	24.559	468.500
Delta Electronics Inc	56.000	452.969	Bilibili Inc ADR	11.045	454.286
Samsung Electronics Co Ltd	7.025	395.577	Delta Electronics Inc	52.000	450.103
Tencent Holdings Ltd	9.200	366.650	LG H&H Co Ltd	546	443.794
NARI Technology Co Ltd 'A'	71.600	344.000	Tencent Holdings Ltd	9.400	443.297
Info Edge India Ltd	6.507	336.535	Yum China Holdings Inc	8.734	436.746
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	21.000	319.076	Elite Material Co Ltd	61.000	435.585
Sungrow Power Supply Co Ltd	16.600	318.293	Bank Central Asia Tbk PT	772.600	424.710
PB Fintech Ltd	35.082	317.170	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	71.181	403.620
FSN E-Commerce Ventures Ltd	12.175	297.658	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	42.300	400.538
By-health Co Ltd	90.200	268.876	NARI Technology Co Ltd 'A'	84.700	400.215
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	886.600	250.852	HDFC Asset Management Co Ltd '144A'	15.071	386.334
Kingdee International Software Group Co Ltd	93.000	249.158	Autohome Inc ADR	11.484	364.922
Tata Consultancy Services Ltd	6.120	243.731	SK Hynix Inc	4.479	349.959
Hindustan Unilever Ltd	7.353	229.023	Allkem Ltd	45.734	339.129
AIA Group Ltd	25.400	222.611	Tata Consultancy Services Ltd	7.283	336.089
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	20.800	199.806	Hindustan Unilever Ltd	10.550	325.455
Voltronic Power Technology Corp	5.000	198.970	ASML Holding NV	532	306.774
			Godrej Consumer Products Ltd	28.387	303.303
			OZ Minerals Ltd	17.102	284.284
			Info Edge India Ltd	4.375	244.701

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Alphabet Inc - Class A	1.194	3.153.360	Enphase Energy Inc	11.596	2.582.225
Block Inc	26.995	2.445.842	EPAM Systems Inc	7.287	2.524.192
SAP SE	22.538	2.375.152	Silvergate Capital Corp - Class A	47.757	2.316.359
Silvergate Capital Corp - Class A	20.502	1.756.534	NVIDIA Corp	9.079	2.233.471
Universal Music Group NV	87.876	1.727.978	Hut 8 Mining Corp	443.423	1.988.838
Accenture Plc - Class A	5.770	1.592.968	Kakao Corp	28.032	1.961.640
National Bank Holdings Corp	33.196	1.402.132	Quest Diagnostics Inc	13.750	1.863.788
Hut 8 Mining Corp	204.112	1.219.372	Meta Platforms Inc - Class A	5.645	1.703.905
Kering SA	1.447	1.016.275	Overstock.com Inc	61.760	1.675.227
Overstock.com Inc	20.939	1.007.367	Alphabet Inc - Class A	647	1.591.546
Centene Corp	11.543	956.654	MicroStrategy Inc - Class A	6.236	1.465.027
Globant SA	4.302	953.350	Hive Blockchain Technologies Ltd	798.377	1.313.351
EPAM Systems Inc	1.964	875.490	Unity Software Inc	19.897	1.204.033
Mastercard Inc	2.394	781.306	Metropolitan Bank Holding Corp	17.222	1.154.665
Marathon Digital Holdings Inc	28.598	721.870	Marathon Digital Holdings Inc	59.263	1.114.623
Archer-Daniels-Midland Co	8.683	712.616	ASX Ltd	20.760	1.099.141
Zurich Insurance Group AG	1.489	707.793	Coinbase Global Inc	17.629	1.074.037
Coinbase Global Inc	3.031	632.383	SVB Financial Group	3.169	1.043.810
NVIDIA Corp	3.610	623.329	DraftKings Inc	51.312	1.003.176
WisdomTree Inc	99.526	551.088	ROBLOX Corp	27.858	985.767
Funko Inc - Class A	26.917	535.278	Figure Acquisition Corp I	99.500	977.166
Siemens AG ADR	8.392	507.090	Block Inc	12.640	945.303
Voyager Digital Ltd	51.303	463.941	Okta Inc	11.466	920.477
Galaxy Digital Holdings Ltd	28.597	440.267	Shopify Inc - Class A	5.764	893.648
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.719	434.618	Signature Bank/New York NY	4.041	801.380
SBI Holdings Inc	20.500	411.537	AP Moller - Maersk A/S - Class B	336	764.432
GXO Logistics Inc	8.744	410.006	XPO Inc	11.117	551.507
Signature Bank/New York NY	1.274	398.536	Galaxy Digital Holdings Ltd	93.210	520.075
Enel SpA	62.429	359.654	Salesforce Inc	2.187	453.294
Hive Blockchain Technologies Ltd	174.050	357.429			

BNY Mellon Brazil Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Banco Bradesco SA ADR	525.400	2.119.014	Petroleo Brasileiro SA ADR	239.546	3.212.860
Itausa SA - Preference	1.088.654	1.962.726	Banco do Brasil SA	274.492	1.903.705
BRF SA	460.392	1.489.664	Petroleo Brasileiro SA - Preference	304.692	1.792.129
Bradespar SA - Preference	251.500	1.487.331	Vale SA	120.461	1.784.303
Suzano SA	133.391	1.354.833	Itau Unibanco Holding SA ADR	358.800	1.733.011
Banco BTG Pactual SA (Units)	246.945	1.292.153	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	582.440	1.598.393
Centrais Eletricas Brasileiras SA - Preference	98.059	1.022.276	Petroleo Brasileiro SA ADR	113.625	1.330.152
Vale SA ADR - Class B	56.400	1.004.022	Sul America SA	226.902	1.044.027
Banco do Brasil SA	136.688	1.001.171	Vale SA ADR - Class B	57.600	1.011.860
Petroleo Brasileiro SA ADR	71.225	972.499	Banco Bradesco SA ADR	282.970	989.590
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	365.912	953.502	Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	221.500	976.130
BR Seguridade Participacoes SA	171.192	911.063	Sendas Distribuidora SA ADR	67.020	906.806
Gerdau SA ADR	153.200	834.139	Itau Unibanco Holding SA - Preference	162.100	834.305
Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	129.300	772.858	Marfrig Global Foods SA	181.385	600.017
Americanas SA	167.355	729.820	Gerdau SA ADR	119.600	594.304
Sendas Distribuidora SA ADR	50.199	700.067	Bradespar SA - Preference	111.052	563.699
YDUQS Participacoes SA	193.309	687.301	Santos Brasil Participacoes SA	395.900	512.125
Marfrig Global Foods SA	229.745	656.107	Atacadao SA	129.500	441.729
Vibra Energia SA	159.231	647.850	Americanas SA	111.300	417.628
Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	373.001	635.858	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	111.500	401.001
Itau Unibanco Holding SA ADR	123.300	624.766	Vibra Energia SA	109.700	381.862
BRF SA ADR	189.808	614.352	Embraer SA ADR	34.575	375.766
Petroleo Brasileiro SA ADR	41.975	540.025	TIM SA/Brazil	141.500	348.662
Santos Brasil Participacoes SA	357.800	495.500	BR Malls Participacoes SA	217.100	348.022
Cia Brasileira de Distribuicao ADR	101.000	444.923	Telefonica Brasil SA ADR	38.700	341.757
3R PETROLEUM OLEO E GAS SA	46.679	424.001	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A '144A'	221.000	303.120
Embraer SA ADR	29.775	383.222	C&A MODAS SA	503.823	299.764
BR Malls Participacoes SA	196.000	356.847	AES Brasil Energia SA	141.800	282.297
Telefonica Brasil SA ADR	35.100	336.162	Suzano SA	28.700	279.562
TIM SA/Brazil	128.100	335.078			
Atacadao SA	88.200	330.498			
Light SA	254.479	296.895			
AES Brasil Energia SA	127.200	278.204			

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2022	5.142.000	5.098.502	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2022	5.142.000	5.142.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jul-2022	3.400.000	3.394.642	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Sep-2022	3.400.000	3.399.818
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Aug-2022	3.400.000	3.389.076	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022	3.400.000	3.399.350
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Sep-2022	3.400.000	3.386.829	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Oct-2022	3.400.000	3.397.741
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Oct-2022	3.400.000	3.382.365	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jul-2022	3.400.000	3.397.274
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	3.400.000	3.326.142	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Aug-2022	3.400.000	3.395.406
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Mar-2023	3.310.000	3.274.566	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2022	2.480.000	2.479.793
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2023	3.200.000	3.151.810	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-May-2022	2.459.000	2.459.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Mar-2023	2.900.000	2.846.261	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2022	1.900.000	1.900.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2022	2.480.000	2.472.557	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Dec-2022	1.900.000	1.900.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2022	1.900.000	1.891.997	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Dec-2022	1.900.000	1.880.538	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jan-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2023	1.900.000	1.863.816	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	1.900.000	1.860.362	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Feb-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-May-2022	1.700.000	1.699.936	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022	1.700.000	1.699.705	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Jun-2022	1.700.000	1.698.401	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Nov-2022	1.700.000	1.689.036	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Nov-2022	1.700.000	1.689.034	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Dec-2022	1.700.000	1.678.643	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-May-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	1.700.000	1.677.553	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	1.700.000	1.666.867	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Jun-2022	1.700.000	1.700.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Apr-2023	1.700.000	1.663.672	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Nov-2022	1.700.000	1.700.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Dec-2022	1.700.000	1.700.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2022	1.700.000	1.700.000

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Jan-2023	18.000.000	17.793.810	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Aug-2022	15.000.000	15.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Aug-2022	15.000.000	14.954.831	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Sep-2022	15.000.000	14.981.784
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 08-Sep-2022	15.000.000	14.947.827	Apple Inc	82.080	12.690.719
Apple Inc	85.236	13.465.517	Microsoft Corp	37.260	9.850.945
Microsoft Corp	42.411	11.708.642	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022	9.000.000	9.000.000
Amazon.com Inc	30.169	6.918.448	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022	6.000.000	6.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-May-2023	6.000.000	5.906.676	Amazon.com Inc	35.813	5.575.510
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-May-2023	6.000.000	5.885.240	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022	5.000.000	5.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jun-2023	6.000.000	5.869.663	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Nov-2022	5.000.000	5.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Nov-2022	5.000.000	4.967.753	Tesla Inc	8.509	3.507.796
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Apr-2023	5.000.000	4.902.550	Alphabet Inc	23.395	3.365.629
Tesla Inc	9.684	4.844.730	Alphabet Inc - Class A	22.970	3.273.071
Alphabet Inc - Class A	12.101	4.088.684	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022	3.000.000	3.000.000
Alphabet Inc	10.940	3.653.160	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022	3.000.000	3.000.000
Berkshire Hathaway Inc - Class B	10.333	3.220.255	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-May-2022	3.000.000	2.999.873	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Jun-2022	3.000.000	2.997.178	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-May-2022	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jul-2022	3.000.000	2.995.422	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Jun-2022	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Oct-2022	3.000.000	2.984.832	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jul-2022	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Nov-2022	3.000.000	2.980.648	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Oct-2022	3.000.000	3.000.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Nov-2022	3.000.000	3.000.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Dec-2022	3.000.000	3.000.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2022	3.000.000	3.000.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Dec-2022	3.000.000	3.000.000
			United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022	3.000.000	2.999.331

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	60.000	4.634.700	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	60.000	4.600.477
Twitter Inc '144A'	610.000	610.000	Twitter Inc '144A'	610.000	600.457
Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	716.000	564.624	Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	500.000	437.813
Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	550.000	545.831	Burford Capital Global Finance LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2030	430.000	398.705
Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031	600.000	501.086	UniCredit SpA 'EMTN' FRN	400.000	393.360
Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	520.000	474.160	Sprint LLC	353.000	359.178
Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	500.000	426.527	Centene Corp	440.000	347.966
Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	415.000	404.988	Centene Corp	346.000	314.860
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 6.375% 01-Sep-2029	389.000	371.754	HCA Inc	292.000	300.900
Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	352.000	332.310	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'	315.000	299.226
DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024	339.000	324.533	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS'	300.000	296.727
Carvana Co '144A' 10.250% 01-May-2030	370.000	323.969	Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	300.000	284.821
Newell Brands Inc 6.375% 15-Sep-2027	321.000	321.039	Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Jun-2030	315.000	281.528
Accor SA 3.000% 04-Feb-2026	300.000	309.440	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A'	275.000	265.464
Yum! Brands Inc 5.375% 01-Apr-2032	310.000	307.639	Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032	285.000	254.746
Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 10-Feb-2029	350.000	289.915	TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	254.000	253.397
Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	283.000	280.380	T-Mobile USA Inc	275.000	250.799
DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029	350.000	267.632	Kraft Heinz Foods Co	279.000	245.168
KB Home 7.250% 15-Jul-2030	260.000	260.000	TransDigm Inc '144A'	230.000	236.672
Univision Communications Inc '144A' 7.375 % 30-Jun-2030	250.000	252.852	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp	200.000	235.394

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Philip Morris International Inc 'EMTN' 2.875% 03-Mar-2026	200.000	212.064	UBS Group AG FRN 1.250% 17-Apr-2025	200.000	202.224
UBS Group AG FRN 1.250% 17-Apr-2025	200.000	211.208	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 2.500% 31-Jul-2026	100.000	123.823
AT&T Inc 'EMTN' 7.000% 30-Apr-2040	100.000	156.007	Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	100.000	120.882
Philip Morris International Inc 2.875% 14-May-2029	100.000	125.853	AT&T Inc 1.800 % 05-Sep-2026	100.000	117.974
International Business Machines Corp 1.750% 31-Jan-2031	100.000	120.238	Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 14-Dec-2022	100.000	115.018
BAT Netherlands Finance BV 'EMTN' 2.375% 07-Oct-2024	100.000	118.026	BAT Netherlands Finance BV 'EMTN' 2.375% 07-Oct-2024	100.000	106.397
Tikehau Capital SCA 2.250% 14-Oct-2026	100.000	116.039	AT&T Inc 1.300 % 05-Sep-2023	100.000	104.297
Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031	100.000	114.919	Orange SA 'EMTN' 5.375% 22-Nov-2050	50.000	102.554
M&G Plc FRN 5.625% 20-Oct-2051	100.000	114.177	Bank of America Corp 'EMTN' 0.750 26-Jul-2023	100.000	99.711
BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026	100.000	113.085	Philip Morris International Inc 'EMTN' 2.875% 03-Mar-2026	100.000	99.020
East Japan Railway Co 'EMTN' 1.162% 15-Sep-2028	100.000	112.455	ASML Holding NV 2.250% 17-May-2032	100.000	98.864
Holcim Finance Luxembourg SA 'EMTN' 0.500% 03-Sep-2030	100.000	108.855	Deutsche Bank AG FRN 5.000% 05-Sep-2030	100.000	97.749
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 3.500% 10-Feb-2027	100.000	108.764	Philip Morris International Inc 2.875% 14-May-2029	100.000	95.767
Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025	100.000	108.464	Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027	100.000	95.153
AT&T Inc 1.300 % 05-Sep-2023	100.000	107.249	Tikehau Capital SCA 2.250 14-Oct-2026	100.000	93.922
Verizon Communications Inc 2.625% 01-Dec-2031	100.000	107.217	Prologis International Funding II SA 'eMTN' 3.125 01-Jun-2031	100.000	93.664
Metropolitan Life Global Funding I 'EMTN' 1.750% 25-May-2025	100.000	106.928	Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.874 28-Apr-2171	100.000	92.613
Prosus NV 'REGS' 1.288 13-Jul-2029	100.000	106.885	Thermo Fisher Scientific Inc 0.125% 01-Mar-2025 0.125 01-Mar-2025	100.000	90.893
JPMorgan Chase & Co 'EMTN' 1.500% 27-Jan-2025	100.000	106.619	Telstra Corp Ltd 'EMTN' 1.125% 14-Apr-2026	100.000	90.568
PPG Industries Inc 2.750% 01-Jun-2029	100.000	106.552	Verizon Communications Inc 2.625 01-Dec-2031	100.000	89.327

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	31.737.000	27.095.448	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	31.080.000	32.932.320
Steelcase Inc 5.125% 18-Jan-2029	20.029.000	19.430.834	Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044	43.190.000	31.615.535
United Rentals North America Inc 3.875% 15-Nov-2027	19.934.000	18.380.945	FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	25.342.000	29.934.939
Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	18.434.000	17.428.309	Perrigo Finance Unlimited Co 4.400% 15-Jun-2030	29.676.000	25.207.936
Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	17.978.000	16.388.825	Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023	22.924.000	23.585.198
Office Properties Income Trust 4.500% 01-Feb-2025	17.698.000	15.824.998	Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	23.634.000	22.546.796
Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036	15.520.000	14.984.229	Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030	26.470.000	22.155.503
Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	17.567.000	14.125.217	Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026	23.298.000	21.995.574
Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	12.305.000	13.000.318	Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024	20.967.000	21.024.008
Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	13.208.000	11.675.074	Newell Brands Inc 4.450% 01-Apr-2026	20.121.000	19.043.451
Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	9.146.000	11.172.433	Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046	18.978.000	18.954.643
Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024	11.222.000	10.991.864	Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031	24.110.000	18.873.458
Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079	10.620.000	10.986.708	Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032	14.859.000	17.759.267
Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	11.346.000	9.955.804	American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026	17.946.820	16.984.195
Office Properties Income Trust 4.250% 15-May-2024	10.312.000	9.629.896	Western Midstream Operating LP 4.300% 01-Feb-2030	15.944.000	15.248.600
Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028	8.762.000	9.540.334	American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027	16.488.775	14.860.337
Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027	9.711.000	9.353.344	FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047	14.829.000	14.759.661
Office Properties Income Trust 2.650% 15-Jun-2026	11.829.000	9.279.304	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023	14.010.851	14.132.433
Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025	8.382.000	9.096.880	Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029	15.688.000	14.021.878
Toledo Hospital/The 6.015% 15-Nov-2048	13.116.000	9.068.398	EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028	14.877.000	13.982.730
FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031	7.963.000	8.922.772			
Brinker International Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2024	8.930.000	8.883.325			
Office Properties Income Trust 2.400% 01-Feb-2027	11.324.000	8.382.755			
Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030	8.531.000	8.228.851			
Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024	7.796.000	8.036.978			
Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031	7.751.000	7.819.860			
Toledo Hospital 5.325% 15-Nov-2028	10.569.000	7.788.592			

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	200.000	15.449.000	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	200.000	15.334.922
Sands China Ltd 5.625% 08-Aug-2025	6.179.000	5.732.622	Sprint LLC 7.875% 15-Sep-2023	4.709.000	4.806.965
Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	5.864.000	5.546.941	Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	5.044.000	4.704.431
Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	6.880.000	5.467.009	T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2031	3.364.000	3.082.722
Cloud Software Group Holdings Inc '144A' 6.500% 31-Mar-2029	5.235.000	4.476.556	Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030	3.340.000	2.778.165
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027	4.218.000	3.846.119	Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028	2.839.000	2.376.733
Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	4.075.000	3.629.619	T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028	2.354.000	2.327.054
Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	4.015.000	3.510.457	Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031	2.915.000	2.325.596
TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026	3.361.000	3.412.686	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7.875% 15-Feb-2025	2.276.000	2.310.921
Sprint LLC 7.875% 15-Sep-2023	3.112.000	3.287.007	Change Healthcare Holdings LLC / Change Healthcare Finance Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2025	2.255.000	2.247.301
Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7.875% 15-Feb-2025	3.015.000	3.115.413	Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029	2.385.000	2.242.049
Sprint LLC 7.125% 15-Jun-2024	2.939.000	3.068.226	T-Mobile USA Inc 3.375 % 15-Apr-2029	2.409.000	2.191.657
Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028	2.736.000	2.894.347	Centene Corp 4.250% 15-Dec-2027	2.341.000	2.177.130
Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029	2.959.000	2.857.879	HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030	2.330.000	2.128.499
Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028	3.135.000	2.853.590	Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031	2.335.000	2.055.851
Carvana Co '144A' 10.250% 01-May-2030	3.230.000	2.850.582	Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031	2.420.000	2.054.822
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030	3.188.000	2.834.909	Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030	2.375.000	2.040.146
American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026	2.824.000	2.755.915	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	2.197.000	1.842.995
Las Vegas Sands Corp 3.500% 18-Aug-2026	3.106.000	2.728.136	HCA Inc 5.875% 15-Feb-2026	1.680.000	1.760.369
Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 6.500% 15-Mar-2030	2.811.000	2.702.727	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9.250% 15-May-2025	1.677.000	1.754.561

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	234.264.127	234.264.127	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	245.263.288	245.263.288
EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	7.000.000	7.000.000	Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027	8.016.000	7.804.395
Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	5.800.000	5.800.000	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.700% 25-Feb-2171	7.786.000	7.237.293
China Construction Bank Corp FRN 2.850% 21-Jan-2032	5.500.000	5.487.020	Bectle SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031	7.715.000	6.318.288
Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	5.650.000	5.477.200	NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027	7.000.000	6.204.755
Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	5.500.000	5.227.980	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	6.530.000	5.516.165
Banco Santander Chile 'REGS' 2.700% 10-Jan-2025	5.000.000	4.829.000	China Construction Bank Corp FRN 2.850% 21-Jan-2032	5.500.000	5.330.080
United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 3.750% 15-Apr-2029	4.500.000	4.589.370	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' 4.500% 10-Jan-2025	5.000.000	5.056.500
Freeport Indonesia PT 'REGS' 5.315% 14-Apr-2032	4.600.000	4.523.700	Banco Santander Chile 'REGS' 2.700% 10-Jan-2025	5.000.000	4.754.250
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3.500% 31-Mar-2027	4.500.000	4.493.655	UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031	5.900.000	4.739.814
Woori Bank 'REGS' 4.750% 30-Apr-2024	4.000.000	4.157.060	Polyus Finance PLC 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028	5.000.000	4.527.500
Sociedad de Transmision Austral SA 'REGS' 4.000% 27-Jan-2032	4.200.000	4.113.186	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	5.400.000	4.484.600
Sands China Ltd 5.900% 08-Aug-2028	4.417.000	3.860.018	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3.500% 31-Mar-2027	4.500.000	4.428.000
DAE Funding LLC 'REGS' 1.550% 01-Aug-2024	4.000.000	3.761.980	QatarEnergy Trading LLC 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031	5.100.000	4.370.500
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025	3.500.000	3.588.500	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	5.300.000	4.283.500
MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.000% 18-May-2025	3.500.000	3.578.250	Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027	4.658.000	4.181.679
CSN Resources SA 'REGS' 5.875% 08-Apr-2032	3.500.000	3.389.210	Access Bank PLC 'REGS' 6.125% 21-Sep-2026	4.800.000	3.947.705
JSW Steel Ltd 'REGS' 5.050% 05-Apr-2032	3.800.000	3.077.650	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS' 5.250% 27-Apr-2029	4.000.000	3.925.010
Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.875% 23-Jan-2043	3.000.000	3.056.250	Riyad Sukuk Ltd FRN 3.174% 25-Feb-2030	4.000.000	3.921.000
CT Trust 'REGS' 5.125% 03-Feb-2032	3.237.000	3.019.500	Pertamina Persero PT 'REGS' 4.150% 25-Feb-2060	4.200.000	3.910.972

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Mexico Government International Bond 4.400% 12-Feb-2052	672.000	669.352	Mexico Government International Bond 'GMTN' 4.750% 08-Mar-2044	36.818	437.335
Qatar Government International Bond 'REGS' 4.817% 14-Mar-2049	700.000	651.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031	43.182	416.870
Philippine Government International Bond 3.556% 29-Sep-2032	400.000	372.920	Philippine Government International Bond 3.556% 29-Sep-2032	36.364	392.200
Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	300.000	298.134	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6.125% 19-Feb-2031	36.364	386.550
Philippine Government International Bond 5.950% 13-Oct-2047	300.000	294.284	SA Global Sukuk Ltd 'REGS' 2.694% 17-Jun-2031	36.364	367.080
Hungary Government International Bond 'REGS' 5.500% 16-Jun-2034	300.000	291.564	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.625% 29-May-2032	36.364	360.400
Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	400.000	282.300	Philippine Government International Bond 5.950% 13-Oct-2047	27.273	315.000
Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.500% 22-Feb-2029	273.000	275.566	Hungary Government International Bond 'REGS' 5.500% 16-Jun-2034	27.273	306.000
Lithuania Government International Bond 'EMTN' 4.125% 25-Apr-2028	224.000	219.121	Petroleos Mexicanos 6.490% 23-Jan-2027	29.545	289.331
Lenovo Group Ltd 'REGS' 6.536% 27-Jul-2032	200.000	201.940	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033	29.545	283.583
Angolan Government International Bond 'REGS' 8.750% 14-Apr-2032	200.000	200.000	Turkey Government International Bond 5.950% 15-Jan-2031	34.091	276.563
Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	200.000	200.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024	37.727	273.900
EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	200.000	200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032	29.545	273.713
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	200.000	200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.500% 22-Feb-2029	24.818	255.596
Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	200.000	200.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 2.500% 31-Jul-2035	33.874	248.434
Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	200.000	200.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC 'REGS' (Perpetual) 0.000% 26-Jan-2171	36.364	243.000
Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	200.000	200.000	Lithuania Government International Bond 'EMTN' 4.125% 25-Apr-2028	20.364	240.903
UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 'REGS' 4.951% 07-Jul-2052	200.000	200.000	BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	22.727	239.125
Chile Government International Bond 3.500% 31-Jan-2034	200.000	199.864	Mexico Government International Bond 4.500% 31-Jan-2050	20.182	232.660
Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	200.000	199.404	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023	20.455	226.087
Colombia Government International Bond 8.000% 20-Apr-2033	200.000	198.300	Yili Holding Investment Ltd 1.625% 19-Nov-2025	22.727	221.563
Jordan Government International Bond 'REGS' 7.750% 15-Jan-2028	200.000	198.196	Egypt Government International Bond 'RegS' 5.875% 16-Feb-2031	27.273	214.125
Mexico Government International Bond 4.875% 19-May-2033	200.000	196.246	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS' 4.875% 15-Jun-2030	18.182	210.260
Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	200.000	191.824	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS' 6.250% 14-Nov-2024	18.182	203.500
Republic of Poland Government International Bond 5.750% 16-Nov-2032	190.000	188.011	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 'REGS' 4.951% 07-Jul-2052	18.182	201.750
Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	200.000	184.900	Jordan Government International Bond 'REGS' 7.750% 15-Jan-2028	18.182	200.560
Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	250.000	182.852	Oman Government International Bond 'REGS' 6.250% 25-Jan-2031	18.182	199.466
Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	300.000	182.250	Republic of Poland Government International Bond 5.750% 16-Nov-2032	17.273	195.130
Consorcio Transmuntaro SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	200.000	177.480	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	18.182	195.000
MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	200.000	172.722	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	18.182	190.800
Bulgaria Government International Bond 4.125% 23-Sep-2029	167.000	164.746	Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	20.455	188.978
Indonesia Government International Bond 1.400% 30-Oct-2031	200.000	163.032	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.500% 31-Jul-2030	20.261	187.846
Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	200.000	162.500	Mexico Government International Bond 4.875% 19-May-2033	18.182	184.116
Philippine Government International Bond 3.200% 06-Jul-2046	200.000	154.750	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.250% 09-May-2028	18.182	182.500
Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032	200.000	146.500	Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048	18.182	181.100
Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030	150.000	136.200	Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4.875% 22-Jan-2030	18.182	176.500
Estonia Government International Bond 4.000% 12-Oct-2032	97.000	95.697	Georgia Government International Bond 'REGS' 2.750% 22-Apr-2026	18.182	174.540
			Tullow Oil PLC 'REGS' 10.250% 15-May-2026	18.182	172.140
			Bulgaria Government International Bond 4.125% 23-Sep-2029	15.182	172.057
			Indonesia Government International Bond 1.400% 30-Oct-2031	18.182	166.820
			Pertamina Persero PT 'REGS' 4.175% 21-Jan-2050	18.182	166.008
			Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS' 2.000% 28-Oct-2026	18.182	165.000
			Mexico Government International Bond 2.659% 24-May-2031	18.182	163.380
			Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	18.182	163.300
			MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031	18.182	160.100
			Bahrain Government International Bond 'REGS' 5.450% 16-Sep-2032	18.182	159.750
			Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 2.950% 06-May-2031	18.182	159.500
			Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029	18.182	159.500
			Philippine Government International Bond 3.200% 06-Jul-2046	18.182	157.354
			Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051	18.182	154.554
			Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	18.182	154.000
			Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049	18.182	133.000

BNY Mellon Emerging Markets Debt local Currency Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	24.600.000	4.271.101	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	57.450.000	8.570.658
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	11.000.000	1.940.952	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	104.488.700	5.048.530
Thailand Government Bond 1.585% 17-Dec-2035	44.200.000	1.013.292	Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027	108.275.000	5.031.780
Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	4.100.000	914.287	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	26.528.000	4.901.958
Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	20.000.000	911.009	Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031	87.455.206	4.017.315
Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	464.300.000	872.683	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	24.160.000	3.565.364
Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	10.150.000.000	637.992	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027	17.757.000.000	3.403.590
Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	394.000.000	584.086	Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027	347.650.000	2.480.139
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	10.775.000	512.252	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	13.479.000	2.452.653
Mexican Bonos 10.000% 05-Dec-2024	9.880.000	496.981	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	34.409.000.000	2.227.828
Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	6.300.000.000	450.369	Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	38.709.681	1.962.214
Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	2.250.000	429.124	Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027	24.878.000.000	1.684.363
Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	577.620.000	388.569	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	1.790.000.000	1.671.143
Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047	8.000.000	336.792	Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036	55.197.000	1.528.916
Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	5.200.000	249.439	China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026	10.400.000	1.521.266
Mexican Bonos 8.000% 31-Jul-2053	5.000.000	202.989	Russian Federal Bond - OFZ 0.000% 19-Jan-2028	394.000.000	1.470.507
Malaysia Government Bond 3.899% 16-Nov-2027	500.000	112.916	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	1.450.000.000	1.404.956
Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	1.300.000	85.567	Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030	7.947.900.000	1.376.289
Argentina Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	783	277	Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042	28.817.200	1.262.628
			Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048	27.383.516	1.247.413
			Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026	20.445.690	1.241.216
			Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	1.225.000.000	1.176.071
			Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	4.833.000	1.125.910
			Russian Federal Bond - OFZ 0.000% 23-Mar-2033	265.381.000	1.087.627
			Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	4.100.000	1.037.192
			Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.800% 01-Oct-2033	1.370.000.000	1.034.703
			Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029	5.592.000	989.807

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027	6.189.000	1.063.405	China Government Bond 3.290% 23-May-2029	6.890.000	1.009.412
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	6.100.000	1.059.094	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025	5.681.000	1.008.276
Colombian TES 9.250% 28-May-2042	2.933.300.000	525.870	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	10.500.000	498.708
Panama Government International Bond 6.400% 14-Feb-2035	400.000	395.784	Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 0.000% 19-Jan-2028	51.853.000	427.718
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	7175.000	341.105	Panama Government International Bond 6.400% 14-Feb-2035	400.000	413.300
Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029	1.500.000	334.495	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030	400.000.000	373.440
Korea Treasury Bond 3.375% 10-Jun-2032	463.280.000	311.666	Hungary Government International Bond 'REGS' 5.500% 16-Jun-2034	300.000	306.000
Indonesia Treasury Bond 8.750% 15-May-2031	4.200.000.000	300.246	Russian Federal Bond - OFZ 0.000% 23-Mar-2033	54.985.000	275.519
Panama Government International Bond 4.500% 16-Apr-2050	300.000	299.697	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028	280.000.000	268.816
Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038	6.500.000	296.078	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035	285.000.000	265.185
Hungary Government International Bond 'REGS' 5.500% 16-Jun-2034	300.000	291.564	Lithuania Government International Bond 'EMTN' 4.125% 25-Apr-2028	236.000	253.809
Indonesia Treasury Bond 6.375% 15-Apr-2032	4.050.000.000	254.568	Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061	300.000	246.003
Romanian Government International Bond 'REGS' 6.625% 27-Sep-2029	250.000	248.445	Egypt Government International Bond 'RegS' 5.875% 16-Feb-2031	300.000	238.875
Pertamina Persero PT 'REGS' 6.500% 27-May-2041	200.000	244.250	China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026	1.600.000	236.481
Lithuania Government International Bond 'EMTN' 4.125% 25-Apr-2028	236.000	230.859	Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	200.000	215.600
KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.750% 19-Apr-2047	200.000	221.890	Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024	850.000	215.028
Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4.375% 05-Feb-2049	200.000	210.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 6.500% 27-May-2041	200.000	212.630
Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034	1.100.000	209.794	United Arab Emirates International Government Bond 'REGS' 4.951% 07-Jul-2052	200.000	201.750
Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030	110.100.000	206.940	Jordan Government International Bond 'REGS' 7.750% 15-Jan-2028	200.000	200.560
Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 3.500% 09-Jul-2041	596.220	200.329	Oman Government International Bond 'REGS' 6.000% 01-Aug-2029	200.000	198.398
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	4.172.700	200.180	Philippine Government International Bond 3.556% 29-Sep-2032	200.000	196.100
Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	200.000	200.000	Republic of Poland Government International Bond 5.750% 16-Nov-2032	190.000	195.130
Angolan Government International Bond 'REGS' 8.750% 14-Apr-2032	200.000	200.000	Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028	200.000	195.000
Coruripe Netherlands BV 'REGS' 10.000% 10-Feb-2027	200.000	200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027	200.000	190.800
EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4.387% 30-Nov-2046	200.000	200.000	Mexico Government International Bond 4.875% 19-May-2033	200.000	188.500
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.375% 24-Mar-2029	200.000	200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 6.750% 20-Sep-2029	200.000	186.040
Prosus NV 'REGS' 4.193% 19-Jan-2032	200.000	200.000	DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029	200.000	182.032
Republic of South Africa Government International Bond 7.300% 20-Apr-2052	200.000	200.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.800% 01-Oct-2033	240.000.000	181.262
Saudi Government International Bond 'REGS' 5.500% 25-Oct-2032	200.000	200.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	200.000	177.728
Mashreqbank PSC FRN 7.875% 24-Feb-2033	200.000	199.404	Bulgaria Government International Bond 4.125% 23-Sep-2029	171.000	176.178
Colombia Government International Bond 8.000% 20-Apr-2033	200.000	198.300	China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	1.130.000	175.285
Jordan Government International Bond 'REGS' 7.750% 15-Jan-2028	200.000	198.196	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033	200.000	174.500
Mexico Government International Bond 4.875% 19-May-2033	200.000	196.246	Angolan Government International Bond 'REGS' 8.750% 14-Apr-2032	200.000	173.500
BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030	200.000	196.200	Tullow Oil PLC 'REGS' 10.250% 15-May-2026	200.000	172.140
Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030	200.000	195.856	Endeavour Mining PLC 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026	200.000	169.500
CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026	200.000	194.650	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4.375% 05-Feb-2049	200.000	167.240
Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028	200.000	192.860	Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034	200.000	167.100
Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030	200.000	191.824	Indonesia Government International Bond 1.400% 30-Oct-2031	200.000	166.820
Republic of Poland Government International Bond 5.750% 16-Nov-2032	190.000	188.011	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032	200.000	162.100
Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048	779.000	187.827	Philippine Government International Bond 3.200% 06-Jul-2046	200.000	160.000
Philippine Government International Bond 3.556% 29-Sep-2032	200.000	186.460	Mexican Bonos 5.500% 04-Mar-2027	3.500.000	157.235
Alibaba Group Holding Ltd 4.500% 28-Nov-2034	200.000	184.900	Thailand Government Bond 4.875% 22-Jun-2029	4.929.000	156.444
Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031	200.000	183.300	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031	200.000	154.750
Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030	250.000	182.852	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031	200.000	154.000
GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 4.400% 30-Mar-2032	200.000	182.132	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030	172.000	153.665
Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050	200.000	182.040	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028	2.294.000.000	149.056
Consorcio Transmataro SA 'REGS' 5.200% 11-Apr-2038	200.000	177.480	Anadolu Efes Biraclilik Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028	200.000	148.104
Colombia Government International Bond 3.250% 22-Apr-2032	200.000	169.942	Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051	175.000	146.983
Bulgaria Government International Bond 4.125% 23-Sep-2029	171.000	168.692	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.500% 22-Feb-2029	150.000	140.438
Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038	119.200.000	167.438	Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049	200.000	137.100
Indonesia Government International Bond 1.400% 30-Oct-2031	200.000	163.032			
Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032	200.000	162.500			
Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032	200.000	157.613			
Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049	200.000	156.000			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	61.554.640	61.554.640	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	61.831.586	61.831.586
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 01-Sep-2022	4.000.000	3.988.802	Mexican Bonos 5,750% 05-Mar-2026	117.500.000	5.312.216
Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28-Feb-2035	40.800.000	2.362.364	Republic of South Africa Government Bond 10,500% 21-Dec-2026	57.500.000	4.025.486
Chile Government International Bond 4,340% 07-Mar-2042	2.300.000	2.298.160	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 01-Sep-2022	4.000.000	3.988.800
China Construction Bank Corp FRN 2,850% 21-Jan-2032	2.000.000	1.995.280	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000% 01-Jan-2025	18.800.000	3.659.076
Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,875% 23-Sep-2032	1.950.000	1.870.500	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,875% 23-Sep-2032	3.250.000	2.957.940
Mexican Bonos 7,750% 13-Nov-2042	39.440.000	1.834.828	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28-Feb-2035	41.000.000	2.376.121
Dominican Republic International Bond 'REGS' 5,500% 22-Feb-2029	1.811.000	1.819.075	Chile Government International Bond 4,340% 07-Mar-2042	2.300.000	2.184.960
Hazine Mustesarliği Varlik Kiralama AS 'REGS' 7,250% 24-Feb-2027	1.800.000	1.800.000	China Construction Bank Corp FRN 2,850% 21-Jan-2032	2.000.000	1.973.080
Mexico Government International Bond 4,400% 12-Feb-2052	1.301.000	1.295.874	Egypt Government International Bond 'REGS' 8,875% 29-May-2050	2.500.000	1.962.414
Republic of South Africa Government International Bond 7,300% 20-Apr-2052	1.249.000	1.249.000	Mexican Bonos 7,750% 13-Nov-2042	39.440.000	1.789.470
Mexico Government International Bond 2,375% 11-Feb-2030	1.100.000	1.247.931	Hazine Mustesarliği Varlik Kiralama AS 'REGS' 7,250% 24-Feb-2027	1.800.000	1.772.375
Chile Government International Bond 3,240% 06-Feb-2028	1.200.000	1.227.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 5,500% 22-Feb-2029	1.811.000	1.689.085
Philippine Government International Bond 3,950% 20-Jan-2040	1.200.000	1.206.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 0,000% 01-Mar-2022	26.000.000	1.654.997
Colombia Government International Bond 4,500% 15-Mar-2029	1.200.000	1.180.080	Egypt Government International Bond 'REGS' 0,000% 18-Jan-2022	26.000.000	1.651.842
Mexico Government International Bond 1,375% 15-Jan-2025	1.000.000	1.152.548	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5,000% 01-Oct-2028	1.350.000.000	1.522.465
EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS' 4,387% 30-Nov-2046	1.150.000	1.150.000	Lukoil Capital DAC 'REGS' 3,600% 26-Oct-2031	2.550.000	1.518.750
Prosus NV 'REGS' 4,193% 19-Jan-2032	1.150.000	1.126.960	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,500% 01-Mar-2026	1.200.000.000	1.413.480
Senegal Government International Bond 'REGS' 4,750% 13-Mar-2028	1.000.000	1.126.259	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3,700% 25-Feb-2171	1.500.000	1.404.075
Nigeria Government International Bond 'REGS' 8,375% 24-Mar-2029	1.000.000	1.000.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2,750% 14-Apr-2041	1.900.000	1.375.424

BNY Mellon Euroland Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2028	34.800.000	35.339.100	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2028	34.800.000	34.453.745
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2026	16.800.000	16.752.084	Norway Government Bond '144A' 1.500% 19-Feb-2026	175.000.000	16.918.428
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2029	12.200.000	12.467.058	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2026	16.800.000	16.848.444
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2052	12.730.000	11.084.900	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	16.010.000	14.450.035
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031	10.500.000	9.814.665	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.000% 22-Jun-2026	13.700.000	14.188.421
Sweden Government Bond '144A' 1.000% 12-Nov-2026	96.500.000	8.967.102	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2029	12.200.000	12.285.888
Bundesschatzanweisungen 0.400% 13-Sep-2024	8.410.000	8.340.913	Netherlands Government Bond '144A' 2.000% 15-Jul-2024	9.675.000	9.960.402
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.500% 15-Jul-2028	8.800.000	7.877.294	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2052	10.550.000	8.905.150
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	6.080.010	6.772.523	Sweden Government Bond '144A' 1.000% 12-Nov-2026	96.500.000	8.675.688
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Apr-2026	6.300.000	5.918.620	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Aug-2026	8.850.000	8.671.407
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Feb-2032	6.500.000	5.876.995	Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.000% 28-Oct-2027	9.000.000	8.374.860
Hellenic Republic Government Bond '144A' 2.000% 22-Apr-2027	5.900.000	5.799.936	Bundesschatzanweisungen 0.400% 13-Sep-2024	8.410.000	8.215.594
Spain Government Bond '144A' 0.700% 30-Apr-2032	5.300.000	5.182.870	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Feb-2031	8.820.000	8.206.566
Spain Government Bond '144A' 1.500% 30-Apr-2027	4.900.000	5.120.451	Bundesobligation 0.000% 09-Oct-2026	8.200.000	8.098.746
French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Feb-2027	5.150.000	4.703.655	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	6.228.933	6.638.522
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 2.500% 19-Nov-2025	4.500.000	4.497.615	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030	6.275.000	6.548.402
Republic of Austria Government Bond '144A' 0.900% 20-Feb-2032	4.530.000	4.428.739	French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2031	6.950.000	6.483.794
French Republic Government Bond OAT 0.500% 25-May-2025	4.500.000	4.335.165	Hellenic Republic Government Bond '144A' 2.000% 22-Apr-2027	5.900.000	5.667.262
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 15-Dec-2024	4.400.000	4.315.964	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 15-Mar-2023	5.450.000	5.518.348
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0.000% 15-Jun-2029	4.600.000	4.241.660	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.000% 22-Oct-2031	5.600.000	5.140.072
Bundesobligation 0.000% 16-Apr-2027	4.500.000	4.188.735	Spain Government Bond '144A' 1.500% 30-Apr-2027	4.900.000	5.003.530
Bundesobligation 0.000% 13-Oct-2023	4.000.000	3.973.360	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2036	4.750.000	4.534.255
French Republic Government Bond OAT '144A' 0.100% 01-Mar-2026	3.606.801	3.831.180	Bundesobligation 0.000% 16-Apr-2027	4.500.000	4.267.935
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15-Feb-2027	3.920.000	3.661.598	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 15-Dec-2024	4.400.000	4.265.317
			China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050	27.800.000	4.242.191

BNY Mellon European Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
BPCE SA 0.625% 28-Apr-2025	600.000	609.546	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	575.332	691.958
Credit Agricole SA FRN 0.625% 12-Jan-2028	600.000	599.970	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Aug-2027	500.000	515.559
Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.375% 04-Dec-2045	520.000	569.548	L'Oreal SA 0.875% 29-Jun-2026	500.000	493.015
Allianz SE FRN 2.241% 07-Jul-2045	600.000	567.630	Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026	470.000	471.927
Verizon Communications Inc 4.750% 31-Oct-2034	520.000	556.929	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.125% 24-Jun-2026	500.000	463.265
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Aug-2027	500.000	525.145	Orange SA 'EMTN' 0.000% 29-Jun-2026	500.000	448.410
ING Groep NV FRN 5.250% 14-Nov-2033	500.000	524.258	AT&T Inc 3.150 % 04-Sep-2036	400.000	424.003
Asahi Group Holdings Ltd 1.151% 19-Sep-2025	500.000	517.115	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC FRN 0.939% 24-Feb-2058	406.569	404.371
CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028	500.000	513.070	LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.125% 13-Sep-2023	406.000	400.072
L'Oreal SA 0.875% 29-Jun-2026	500.000	500.760	Santander Consumer Finance SA 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2024	400.000	392.142
Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.125% 24-Jun-2026	500.000	499.950	Molson Coors Beverage Co 1.250% 15-Jul-2024	400.000	387.776
Orange SA 'EMTN' 0.000% 29-Jun-2026	500.000	496.453	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.875% 11-Jul-2030	400.000	350.476
Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	450.000	444.294	McDonald's Corp 'GMTN' 2.375% 27-Nov-2024	300.000	315.747
TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	445.000	428.032	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	333.000	310.776
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	363.653	412.327	Allianz SE 'EMTN' FRN 4.252% 05-Jul-2052	300.000	300.451
HSBC Holdings Plc FRN 3.019% 15-Jun-2027	410.000	410.000	Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026	337.000	297.527
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3.875% 16-Jun-2032	400.000	399.856	International Business Machines Corp 'EMTN' 0.875% 31-Jan-2025	300.000	295.725
ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	400.000	399.036	CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024	302.000	295.154
Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 3.750% 01-Feb-2033	400.000	397.120	Fidelity National Information Services Inc 1.000% 03-Dec-2028	345.000	294.216
BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.875% 11-Jul-2030	400.000	396.468	Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 9.000% 29-Aug-2042	290.000	290.000

BNY Mellon Future Earth Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
NextEra Energy Inc	1.358	105.253	National Grid PLC	5.765	84.534
LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	7.900	85.144	Eversource Energy	960	84.084
Ingersoll Rand Inc	1.542	76.500	Weyerhaeuser Co (REIT)	2.080	72.172
RWE AG	1.404	59.592	Mowi ASA	3.136	62.344
Darling Ingredients Inc	834	58.524	Unilever PLC	1.039	53.931
Danaher Corp	229	56.801	Microsoft Corp	170	52.393
Sungrow Power Supply Co Ltd	3.100	54.007	Ebara Corp	1.200	51.494
Hubbell Inc - Class B	285	53.313	Kubota Corp	3.000	51.059
Voltronic Power Technology Corp	1.000	52.799	Greencoat UK Wind Plc/Funds	23.729	45.045
Neste Oyj	1.111	49.169	Acuity Brands Inc	255	44.311
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	600	48.086	Texas Instruments Inc	250	40.865
Trane Technologies Plc	236	36.126	Legrand SA	407	35.948
Greencoat UK Wind Plc/Funds	17.774	33.617	Shimano Inc	200	33.958
NARI Technology Co Ltd 'A'	5.500	29.627	Johnson Matthey PLC	1.175	32.406
OZ Minerals Ltd	1.725	24.961	Deere & Co	87	32.130
StarPower Semiconductor Ltd 'A'	500	24.635	Ecolab Inc	197	31.501
SolarEdge Technologies Inc	99	23.038	Sungrow Power Supply Co Ltd	2.100	31.371
Orsted AS '144A'	192	21.791	Xylem Inc/NY	212	23.013
Aker Carbon Capture ASA	11.335	20.651	Samsung SDI Co Ltd	49	21.691
Epiroc AB	1.179	20.381	Daikin Industries Ltd	100	18.409
WEG SA	3.255	18.069	Vestas Wind Systems A/S	605	17.091
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	2.000	17.578	SolarEdge Technologies Inc	41	13.239
SSE Plc	801	17.483	Vitasoy International Holdings Ltd	7.037	12.363
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	8.000	13.945	Nidec Corp	200	12.095
XPeng Inc	800	13.699	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H'	8.000	11.603
			RWE AG	292	11.318

BNY Mellon Future Food Fund** für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Archer-Daniels-Midland Co	1.063	85.234	Mosaic Co/The	1.419	78.338
CF Industries Holdings Inc	742	67.765	Nutrien Ltd	787	66.324
Sysco Corp	657	52.410	Corteva Inc	1.060	60.057
Grocery Outlet Holding Corp	1.463	44.486	Ingredion Inc	663	59.579
Darling Ingredients Inc	566	43.436	CNH Industrial NV	4.174	55.225
Zebra Technologies Corp	87	31.261	Ecolab Inc	280	41.103
Danaher Corp	115	30.829	Givaudan SA	12	39.072
Illumina Inc	141	28.496	Danone SA	663	37.937
Vital Farms Inc	1.188	21.847	Sprouts Farmers Market Inc	1.183	33.896
Trimble Inc	294	18.388	Deere & Co	86	33.071
Mosaic Co/The	384	17.903	Tyson Foods Inc - Class A	351	31.231
Chr Hansen Holding A/S	268	17.566	PepsiCo Inc	145	25.904
PepsiCo Inc	83	13.964	Brixmor Property Group Inc (REIT)	1.042	25.028
Kerry Group Plc	136	13.779	Trimble Inc	331	21.117
Twist Bioscience Corp	443	13.581	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	5.717	21.106
Costco Wholesale Corp	24	11.919	Archer-Daniels-Midland Co	212	20.157
Deere & Co	27	9.629	AGCO Corp	156	19.316
Corteva Inc	62	3.949	Topcon Corp	1.500	19.215
Koninklijke Ahold Delhaize NV	135	3.888	Sysco Corp	224	19.025
Nutrien Ltd	41	3.852	Nestle SA	171	19.023
			Bayer AG	340	18.949
			Costco Wholesale Corp	37	18.609
			Unilever Plc	355	16.117
			CF Industries Holdings Inc	148	16.105
			Koninklijke Ahold Delhaize NV	540	15.196
			Kerry Group Plc	158	14.644
			Delivery Hero SE '144A'	302	14.472
			Novozymes A/S	235	13.148
			Grieg Seafood ASA	1.080	12.229
			Suntory Beverage & Food Ltd	300	11.198
			Iveco Group NV	819	10.494
			Bucher Industries AG	28	10.458

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Life Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Eli Lilly & Co	387	106.546	Abbott Laboratories	1.232	140.389
Boston Scientific Corp	2.225	96.929	Novo Nordisk A/S	1.060	113.133
Humana Inc	202	90.313	UnitedHealth Group Inc	161	85.728
MetLife Inc	1.249	85.135	Principal Financial Group Inc	1.102	83.201
Edwards Lifesciences Corp	724	78.140	Medtronic Plc	797	75.788
Dexcom Inc	399	76.565	GlaxoSmith Kline Plc	3.220	69.478
Sanofi	752	76.387	Centene Corp	822	63.677
Elevance Health Inc	143	75.182	Home Depot Inc/The	177	58.608
Centene Corp	822	70.295	HCA Healthcare Inc	275	56.496
Becton Dickinson and Co	245	60.596	Elevance Health Inc	93	48.067
Novo Nordisk A/S	515	54.440	Merck & Co Inc	522	47.615
Chubb Ltd	243	49.875	Sherwin-Williams Co/The	174	47.141
ResMed Inc	187	45.431	Eli Lilly & Co	126	43.701
Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	168	43.052	Roche Holding AG	127	43.506
AbbVie Inc	259	40.024	Novartis AG	462	39.337
SCOR SE	2.393	38.258	Lowe's Cos Inc	175	38.910
UnitedHealth Group Inc	75	36.796	Siemens Healthineers AG '144A'	608	37.389
Zoetis Inc	176	32.761	Thermo Fisher Scientific Inc	63	36.027
National Vision Holdings Inc	794	32.518	AstraZeneca Plc	262	33.451
Roche Holding AG	95	32.249	Lonza Group AG	45	29.820
ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	4.785	29.327	L'Oreal SA	67	27.708
Amedisys Inc	166	29.075	Sugi Holdings Co Ltd	600	26.725
Petco Health & Wellness Co Inc - Class A	1.937	28.743	Topcon Corp	2.000	24.636
Danaher Corp	104	28.528	Welltower Inc (REIT)	251	24.393
Regeneron Pharmaceuticals Inc	38	26.989	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	357	24.218
Intuitive Surgical Inc	124	26.818	Johnson & Johnson	126	22.165
Prudential Plc	2.236	26.474	Smith & Nephew PLC	1.387	21.545
Illumina Inc	123	26.288	Acushnet Holdings Corp	523	21.486
Zurich Insurance Group AG	50	24.201	Humana Inc	39	20.515
Alkermes Plc	824	20.780	Amplifon SpA	718	20.131
Abbott Laboratories	178	20.759	Cooper Cos Inc/The	68	19.880
Teladoc Health Inc	240	17.499	Discovery Ltd	2.458	19.352
Inspire Medical Systems Inc	74	16.587	Jackson Financial Inc	451	19.280
			Straumann Holding AG	180	18.482
			Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	4.000	16.772

BNY Mellon Global Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	23.460.000	23.497.934	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	4.696.094	23.412.557
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	19.120.000	18.887.120	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	14.480.000	14.481.158
Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029 0.500 15-Nov-2029	121.040.000	16.527.352	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	11.536.756	13.981.762
Australia Government Bond 0.500% 21-Sep-2026	21.560.000	14.040.936	Australia Government Bond 0.500% 21-Sep-2026	21.560.000	12.994.187
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	11.510.000	10.439.695	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	13.100.000	12.443.976
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.435% 31-Jul-2024	10.310.000	10.302.159	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.850% 01-Jul-2025	9.530.000	11.227.684
Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	12.950.000	9.534.430	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	12.950.000	8.772.239
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	8.575.839	8.400.394	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	12.320.000	8.417.827
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	7.240.000	6.841.789	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	8.720.000	7.550.905
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.825.000	6.818.135	Denmark Government Bond 0.500% 15-Nov-2029	52.990.000	7.347.672
United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	6.590.000	6.458.200	Japan Government Ten Year Bond 0.100% 20-Dec-2029	858.500.000	6.630.677
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	6.920.000	6.445.820	United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	6.590.000	6.472.873
Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	7.860.000	6.221.302	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.020.000	6.381.262
New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2025	8.910.000	6.019.430	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.387% 11-May-2022	5.610.000	5.610.427
Japan Government Thirty Year Bond 1.000% 20-Mar-2052	786.550.000	5.211.315	Spain Government Bond '144A' 5.900% 30-Jul-2026	4.140.000	5.270.472
Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	101.000.000	5.123.674	Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	123.780.000	5.154.472
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030	4.650.000	5.070.210	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.900% 15-Sep-2026	6.880.000	4.744.903
Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.900% 15-Sep-2026	6.880.000	4.969.007	Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029	104.130.000	4.685.745
New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4.500% 15-Apr-2027	8.300.000	4.765.046	European Investment Bank 0.375% 24-Jul-2024	4.940.000	4.684.602
United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	4.670.000	4.420.815	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.111.141	4.557.816
United States Treasury Note/Bond 0.875% 30-Sep-2026	4.920.000	4.294.327	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	3.581.216	4.556.538
Australia Government Bond 3.000% 21-Nov-2033	5.900.000	4.270.633	Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	494.357.790	4.477.359
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateriale 1.625% 20-Jul-2027	4.270.000	4.235.354	Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025	4.120.000	4.444.067
United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	2.708.959	4.217.697	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026	2.743.435	4.181.538
New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-May-2031	9.090.000	4.172.124	Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032 30-Jul-2032	2.990.000	4.176.218
Republic of Poland Government Bond 4.000% 25-Oct-2023	17.723.000	4.061.261	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024	3.955.197	4.164.235
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jan-2031	4.483.927	3.994.767	United Kingdom Gilt 4.500% 07-Sep-2034	2.160.000	3.935.181
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	4.810.000	3.939.042	Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	5.360.000	3.864.443
Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	5.620.000	3.881.628	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	3.420.000	3.742.301
Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	4.930.000	3.837.315	Ireland Government Bond 1.000% 15-May-2026	3.530.000	3.703.222
Svensk Exportkredit AB 'EMTN' 0.235% 08-Nov-2023	4.000.000	3.829.062	Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029	72.800.000	3.679.839
Council Of Europe Development Bank 0.750% 22-Jul-2027	3.810.000	3.744.351	FMS Wertmanagement 1.375% 07-Mar-2025	3.500.000	3.655.757
BNG Bank NV 'REGS' FRN 5.048% 05-Aug-2026	3.630.000	3.733.244	Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046	596.600.000	3.648.174
FMS Wertmanagement 1.375% 07-Mar-2025	3.500.000	3.541.823	Republic of Poland Government Bond 4.000% 25-Oct-2023	17.723.000	3.617.585
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 09-Dec-2024	3.420.000	3.525.941	Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	62.750.000	3.023.112
New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	6.430.000	3.388.981	Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029	3.350.000	2.992.905
Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	6.940.000	3.284.629			
Queensland Treasury Corp '144A' 1.500% 20-Aug-2032	5.760.000	3.163.532			

BNY Mellon Global Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	307.349.120	307.349.120	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	299.957.902	299.957.902
United States Treasury Note/Bond 3.250% 30-Jun-2027	23.600.000	23.026.594	United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026	27.200.000	25.171.231
United States Treasury Note/Bond 3.000% 31-Jul-2024	18.980.000	18.946.700	United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2027	12.000.000	10.966.835
United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2027	20.250.000	18.762.832	Canadian Imperial Bank of Commerce 3.600% 07-Apr-2032	8.070.000	7.395.725
United States Treasury Note/Bond 2.625% 31-May-2027	16.300.000	15.504.738	FedEx Corp 4.250% 15-May-2030	7.217.000	7.386.684
Bundesschatzbrief 0.000% 05-Apr-2024	9.612.472	9.987.686	Bundesschatzbrief 0.000% 05-Apr-2024	5.669.785	5.749.117
Canadian Imperial Bank of Commerce 3.600% 07-Apr-2032	8.070.000	8.041.109	Verizon Communications Inc 2.550% 21-Mar-2031	5.900.000	5.692.320
United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	7.670.400	7.659.939	Ureco Finance NV 'EMTN' 3.250% 13-Jun-2032	5.388.000	5.552.968
United States Treasury Note/Bond 1.250% 30-Nov-2026	7.645.900	7.183.263	JPMorgan Chase & Co FRN 2.522% 22-Apr-2031	5.482.000	5.379.322
Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031	7.439.000	6.093.992	ING Groep NV FRN 4.252% 28-Mar-2033	5.774.000	5.212.916
Citigroup Inc FRN 4.112% 22-Sep-2033	5.764.000	5.761.695	Banco Santander SA 'EMTN' FRN 4.750% 30-Aug-2028	4.700.000	5.052.207
CEZ AS 'EMTN' 2.375% 06-Apr-2027	5.489.000	5.751.854	Exelon Corp 4.050% 15-Apr-2030	4.500.000	4.901.670
Banco Santander SA 'EMTN' FRN 4.750% 30-Aug-2028	4.900.000	5.723.818	Entergy Corp 2.800% 15-Jun-2030	4.900.000	4.725.609
Ureco Finance NV 'EMTN' 3.250% 13-Jun-2032	5.388.000	5.611.038	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 1.102% 29-Apr-2033	4.375.000	4.711.536
ING Groep NV FRN 4.252% 28-Mar-2033	5.774.000	5.584.494	Reche Holdings Inc '144A' 2.076% 13-Dec-2031	4.802.000	4.573.185
BNP Paribas SA 'EMTN' 3.625% 01-Sep-2029	5.100.000	5.077.079	McDonald's Corp 'GMTN' 0.625% 29-Jan-2024	4.400.000	4.557.537
Bank of America Corp FRN 4.571% 27-Apr-2033	4.800.000	4.672.426	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030	4.225.054	4.508.257
Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.250% 07-Feb-2029	5.090.000	4.590.131	HSBC Holdings PLC FRN 3.000% 22-Jul-2028	3.295.000	4.505.754
Bundesschatzbrief 0.400% 13-Sep-2024	4.500.000	4.573.897	Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024	4.400.000	4.424.857
McDonald's Corp 'GMTN' 3.000% 31-May-2034	4.590.000	4.371.061	RWE AG 'EMTN' 2.750% 24-May-2030	4.121.000	4.254.425

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	58.563.400	57.310.718	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	48.888.500	46.717.841
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	45.960.000	46.027.721	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	39.230.000	39.220.385
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	16.890.300	15.559.574	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	3.636.673	18.129.683
United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	16.860.000	15.345.190	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	13.875.600	13.649.037
iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	139.600	14.541.018	United States Treasury Floating Rate Note FRN 2.571% 31-Oct-2023	13.030.000	13.060.275
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	13.875.600	13.866.386	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	12.770.300	11.735.302
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	8.154.957	10.134.525	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	10.840.500	9.486.418
Blackrock Global Funds - Asian High Yield Bond Fund	1.371.600	9.268.832	United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	9.370.000	9.035.866
United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	9.370.000	9.167.183	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	9.430.000	8.897.924
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	9.296.967	9.076.294	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	10.920.000	8.688.701
Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	12.440.000	8.992.040	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	83.061	8.063.700
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	9.430.000	8.920.557	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	11.400.000	7.997.154
Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	11.590.000	8.917.413	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	8.189.290	7.788.088
iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	83.061	8.329.529	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	12.440.000	7.763.274
Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	11.400.000	7.941.869	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	6.227.287	7.547.048
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	8.189.290	7.751.808	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	9.470.000	7.048.463
New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	12.950.000	7.512.858	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	6.524.140	6.713.512
Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	8.800.000	6.944.959	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	42.927	4.597.083
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.435% 31-Jul-2024	5.980.000	5.971.835	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	4.132.480	4.580.720
Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	11.530.000	5.914.657	United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023	4.360.000	4.330.366
Denmark Government Bond 0.000% 15-Nov-2031	44.460.000	5.582.739			
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	1.000.862	4.988.270			
New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	10.140.000	4.954.579			
Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030	79.490.000	4.913.760			
Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4.648% 15-Mar-2027	6.050.000	4.726.028			
Republic of Poland Government Bond 4.000% 03-May-2024	20.523.000	4.663.293			
American Express Co 3.375% 03-May-2024	4.550.000	4.549.660			

BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
SK Hynix Inc	14.191	1.398.592	Housing Development Finance Corp Ltd	52.331	1.663.179
HDFC Bank Ltd	51.877	1.034.715	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	55.000	1.019.337
Sea Ltd ADR	8.157	1.021.276	Alibaba Group Holding Ltd	91.872	972.333
Marico Ltd	142.776	925.997	Livent Corp	37.142	918.783
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	86.100	826.581	Asian Paints Ltd	24.618	914.078
WEG SA	145.898	813.937	Maruti Suzuki India Ltd	8.673	895.656
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	46.000	765.644	AIA Group Ltd	87.000	885.515
Meituan '144A'	34.800	755.458	EPAM Systems Inc	2.489	873.516
Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	67.200	739.925	Titan Co Ltd	26.772	845.196
Titan Co Ltd	26.281	703.722	Samsung SDI Co Ltd	1.932	844.098
Credicorp Ltd	4.665	655.701	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	89.500	800.426
Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	44.389	620.707	Globant SA	3.404	738.746
Tata Consultancy Services Ltd	13.089	569.275	Jubilant Foodworks Ltd	105.919	721.379
Bank Mandiri Persero Tbk PT	885.500	558.304	Tencent Holdings Ltd	15.600	710.897
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	156.209	551.083	LG Chem Ltd	1.506	671.340
Raia Drogasil SA	141.494	549.769	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	164.000	668.833
NetEase Inc	32.400	514.931	Yum China Holdings Inc	13.594	664.401
XP Inc	27.906	504.129	NARI Technology Co Ltd 'A'	146.400	614.407
ASML Holding NV	946	502.566	MercadoLibre Inc	663	596.789
Tencent Holdings Ltd	11.600	500.840	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	61.800	578.672
NARI Technology Co Ltd 'A'	98.900	494.536	HDFC Bank Ltd	29.973	554.877
Delta Electronics Inc	63.000	493.796	Sungrow Power Supply Co Ltd	29.900	518.563
Yum China Holdings Inc	10.472	483.686	Tencent Music Entertainment Group ADR	115.302	505.255
OZ Minerals Ltd	30.967	460.595	Meituan '144A'	19.300	499.299
AIA Group Ltd	48.000	447.639	Info Edge India Ltd	8.757	493.398
ICICI Bank Ltd	38.195	417.053	Tata Consultancy Services Ltd	10.859	464.602
Info Edge India Ltd	8.025	415.790	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	126.553	452.382
ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	60.857	397.166	ASML Holding NV	788	433.466
FSN E-Commerce Ventures Ltd	17.711	395.087	OTP Bank Nyrt	10.208	430.441
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	55.589	384.456	Hindustan Unilever Ltd	13.679	422.075
Globant SA	1.591	377.684	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	333.000	408.027
LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	33.200	363.236	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	58.500	394.944
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	32.100	300.190	HDFC Asset Management Co Ltd '144A'	15.590	393.843
Sungrow Power Supply Co Ltd	16.300	287.931	Godrej Consumer Products Ltd	34.308	366.423
Hindustan Unilever Ltd	9.351	282.454	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	60.857	351.406
Advantest Corp	4.600	277.212	LG H&H Co Ltd	429	348.672
PB Fintech Ltd	31.530	275.593	Advantest Corp	5.500	346.074
By-health Co Ltd	76.700	248.411	SK Hynix Inc	4.668	344.858
			Autohome Inc ADR	10.263	326.123
			Elite Material Co Ltd	43.000	307.799
			Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	39.100	290.329

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Equity Fund** für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Exelon Corp	255.155	10.815.181	Apple Inc	73.680	11.641.576
Sanofi	89.654	9.153.960	Accenture Plc - Class A	33.770	9.876.141
AstraZeneca Plc	73.300	9.003.288	Ferguson PLC	68.739	9.742.253
Trane Technologies Plc	59.566	8.984.374	Costco Wholesale Corp	19.868	9.646.277
Cooper Cos Inc/The	23.495	8.355.583	Citigroup Inc	166.203	8.807.535
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	10.799	8.248.666	Texas Instruments Inc	49.736	7.942.500
Eli Lilly & Co	19.916	6.838.854	Abbott Laboratories	59.729	6.990.324
Nestle SA	58.681	6.813.313	Microsoft Corp	23.826	6.773.735
Goldman Sachs Group Inc/The	20.824	6.471.099	Alphabet Inc - Class A	10.605	6.687.622
Barclays Plc	2.688.476	6.123.397	Goldman Sachs Group Inc/The	18.539	6.567.281
JPMorgan Chase & Co	44.140	6.081.579	TE Connectivity Ltd	53.895	6.358.598
Chubb Ltd	28.208	5.899.720	Relx Plc	223.008	6.198.599
Progressive Corp/The	44.294	5.553.315	Unilever PLC	121.215	5.523.568
Hubbell Inc - Class B	28.063	5.400.193	Dollar General Corp	22.348	5.479.669
Darling Ingredients Inc	63.008	4.950.493	Suzuki Motor Corp	159.100	5.367.897
Novartis AG	58.769	4.936.645	SAP SE	4.7032	5.056.354
CME Group Inc	22.000	4.833.185	CME Group Inc	27.922	5.007.376
Apple Inc	31.368	4.774.278	Sony Group Corp	69.400	4.974.443
SSE Plc	210.676	4.529.701	Continental AG	44.859	4.927.500
Microsoft Corp	16.727	4.315.572	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	46.562	4.668.693
Wolters Kluwer NV	41.548	4.289.533	Barclays Plc	2.009.606	4.006.243
Norfolk Southern Corp	15.938	3.922.502	Vivendi SE	307.221	3.946.463
Bank Mandiri Persero Tbk PT	6.090.800	3.799.533	Applied Materials Inc	30.362	3.842.432
SCOR SE	210.919	3.446.289	Ecolab Inc	25.303	3.744.507
Alphabet Inc - Class A	16.381	3.402.017	Cooper Cos Inc/The	13.260	3.636.080
Roche Holding AG	9.780	3.379.621	Swedbank AB	218.472	3.482.363
Universal Music Group NV	149.698	3.218.500	Samsung SDI Co Ltd	7.365	3.467.409
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	496.000	3.158.875	Eversource Energy	41.360	3.400.680
Amazon.com Inc	17.360	2.981.198	Infoma PLC	518.140	3.364.303
Samsung SDI Co Ltd	6.891	2.980.996	Medtronic Plc	40.471	3.300.393
SAP SE	28.130	2.845.985	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	5.117	3.234.638
General Electric Co	32.124	2.820.453	Trane Technologies Plc	21.748	3.228.912
Swedbank AB	181.419	2.708.049	Associated British Foods PLC	125.759	2.860.033
Relx Plc	85.954	2.285.955	Hubbell Inc - Class B	12.226	2.753.635
			Albemarle Corp	10.351	2.691.097
			JPMorgan Chase & Co	18.541	2.465.222
			Amazon.com Inc	10.773	2.351.843

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Exelon Corp	326.944	14.085.706	Merck & Co Inc	133.747	11.969.574
AstraZeneca Plc	106.962	12.979.954	Novartis AG	130.252	11.242.413
AbbVie Inc	85.933	12.927.742	Unilever PLC	208.932	10.519.259
Interpublic Group of Cos Inc/The	415.886	12.672.033	Infosys Ltd ADR	431.276	10.197.413
MetLife Inc	166.193	11.504.319	Eversource Energy	111.783	9.814.951
Comerica Inc	133.666	11.275.917	Delta Electronics Inc	1.116.000	9.743.915
Medtronic Plc	115.651	11.056.962	Hubbell Inc - Class B	41.401	9.497.699
Deutsche Post AG	271.249	11.054.699	PepsiCo Inc	52.611	9.457.671
Hasbro Inc	127.363	10.348.018	First Horizon Corp	405.331	9.050.262
Delta Electronics Inc	1.116.000	10.347.277	Principal Financial Group Inc	103.598	7.839.722
Kraft Heinz Co/The	232.050	9.267.689	Anglo American PLC	164.928	7.723.494
FedEx Corp	55.683	9.225.086	Cie Financiere Richemont SA	67.153	7.657.441
Marathon Petroleum Corp	112.441	8.700.991	Philip Morris International Inc	74.973	7.529.995
CME Group Inc	45.049	8.678.265	Bunzl PLC	199.151	7.327.607
Broadcom Inc	16.946	8.398.107	Hasbro Inc	127.363	7.082.089
Johnson Controls International plc	163.373	8.123.737	Citigroup Inc	122.410	6.929.091
Mercedes-Benz Group AG	126.378	8.085.759	Emerson Electric Co	70.724	6.645.377
Enel SpA	1.483.815	8.032.620	Royal Dutch Shell Plc	267.979	6.471.789
Goldman Sachs Group Inc/The	26.395	7.844.269	Paychex Inc	42.552	5.940.895
Industria de Diseno Textil SA	304.540	7.733.616	QUALCOMM Inc	43.636	5.815.906
British American Tobacco Plc	188.148	7.663.812	Sysco Corp	62.741	5.359.394
Cisco Systems Inc	156.903	7.458.098	JPMorgan Chase & Co	39.877	5.232.375
Hewlett Packard Enterprise Co	446.597	7.313.098	Procter & Gamble Co/The	31.972	5.084.389
Gilead Sciences Inc	110.647	7.212.132	Informa Plc	683.134	4.941.952
First Horizon Corp	405.331	7.140.885	TotalEnergies SE	94.403	4.738.977
Garmin Ltd	73.106	6.911.648	KDDI Corp	141.200	4.438.043
Fidelity National Information Services Inc	107.478	6.670.082	British American Tobacco Plc	109.522	4.212.324
Chesapeake Energy Corp	79.148	6.618.508	State Street Corp	65.994	4.169.222
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	155.045	6.603.580	RELX Plc	139.579	4.101.533
Sanofi	69.493	6.558.028	British American Tobacco PLC ADR	94.261	3.942.635
Roche Holding AG	18.285	6.257.721	Industria de Diseno Textil SA	169.509	3.789.947
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	23.026	6.237.073	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	13.834	3.702.097
RELX Plc	215.951	6.138.440	CMS Energy Corp	54.972	3.652.104
PepsiCo Inc	34.102	5.950.830	Marathon Petroleum Corp	31.714	3.404.769
State Street Corp	65.994	5.848.044	MetLife Inc	46.013	3.372.580
Dominion Energy Inc	83.009	5.533.766	AstraZeneca Plc	23.634	3.167.253
Flowerserve Corp	191.737	4.967.650			
Sage Group Plc/The	522.768	4.820.753			
Hubbell Inc - Class B	24.899	4.594.272			
Bayer AG	72.028	4.035.548			

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
eircom Finance DAC 2.625% 15-Feb-2027	1.370.000	1.300.862	TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	1.366.000	1.333.723
AthenaHealth Group Inc '144A' 6.500% 15-Feb-2030	1.142.000	1.100.725	Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	1.101.000	994.339
Fertitta Entertainment Finance Co Inc '144A' 6.750% 15-Jan-2030	1.101.000	1.073.375	VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029	1.048.000	987.266
OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024	1.010.000	993.625	Amynta Agency Borrower Inc FRN 4.604% 31-Jan-2025	965.007	951.703
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031	870.000	880.300	Directv Financing LLC FRN 5.750% 02-Aug-2027	970.000	916.866
TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029	908.000	877.655	First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029	1.051.000	871.484
Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	940.000	837.248	TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025	755.000	867.233
Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	868.000	810.133	eircom Finance DAC 2.625% 15-Feb-2027	1.020.000	834.138
Scientific Games US FinCo Inc '144A' 6.625% 01-Mar-2030	841.000	803.375	Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024	868.000	819.656
CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025	813.000	783.403	Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030	940.000	816.367
Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.375% 15-Jul-2027	784.000	769.350	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025	1.004.000	779.750
CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028	800.000	769.194	Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029	907.000	774.204
Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028	773.000	718.645	Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027	935.000	761.467
Sealed Air Corp '144A' 5.000% 15-Apr-2029	710.000	697.626	Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029	825.000	753.764
Allwyn International AS 'REGS' 3.875% 15-Feb-2027	760.000	678.413	Encore Capital Group Inc 'REGS' 5.375% 15-Feb-2026	665.000	744.521
Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026	663.000	670.845	COO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030	870.000	732.361
Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027	690.000	660.113	LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029	838.000	718.123
Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030	773.000	653.900	Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028	741.000	700.365
SBA Communications Corp 3.125% 01-Feb-2029	781.000	653.751	Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028	790.000	699.752
Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026	670.000	653.644	CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025	689.000	687.234

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Deutsche Post AG	337.850	15.221.949	Enbridge Inc	436.790	18.092.096
ONEOK Inc	190.402	11.625.348	Clearway Energy Inc	311.894	11.194.342
Bouygues SA	335.792	11.217.778	Naturgy Energy Group SA	376.063	11.001.254
Enel SpA	1.445.689	10.778.281	ONEOK Inc	181.194	10.797.960
Hess Midstream LP - Class A	303.327	9.717.196	Antero Midstream Corp	1.022.270	10.357.833
Clearway Energy Inc	275.216	9.599.274	Engie SA	761.000	9.895.896
SSE Plc	374.151	8.079.909	Enagas SA	472.144	8.346.296
Medical Properties Trust Inc (REIT)	511.128	7.606.003	Exelon Corp	192.892	8.253.520
Vinci SA	80.448	6.967.508	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	264.184	7.927.957
Dominion Energy Inc	99.479	5.989.550	Atlantia SpA	303.583	7.249.680
PPL Corp	206.477	5.980.467	Deutsche Post AG	193.157	6.998.922
Antero Midstream Corp	404.636	4.313.974	Red Electrica Corp SA	400.277	6.846.245
Drax Group Plc	408.107	3.338.047	PPL Corp	237.123	6.735.050
Engie SA	220.831	2.894.926	SSE Plc	332.551	6.703.327
Orange SA	263.637	2.628.268	Orange SA	656.422	6.624.330
Enbridge Inc	49.020	2.174.025	Verizon Communications Inc	139.383	6.391.842
Vistra Corp	88.708	2.047.060	Williams Cos Inc/The	188.628	5.931.839
Enagas SA	65.274	1.457.130	Enel SpA	1.156.859	5.771.624
Red Electrica Corp SA	59.953	1.190.903	Medical Properties Trust Inc (REIT)	441.151	4.965.592
Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	38.215	1.096.411	Bouygues SA	170.341	4.922.213
			Italgas SpA	741.608	4.215.121
			Vistra Corp	169.150	3.876.442
			Constellation Energy Corp	71.260	3.590.052
			Hess Midstream LP - Class A	123.845	3.500.688
			Proximus SADP	376.305	3.490.118
			Vinci SA	32.846	3.134.733
			Public Service Enterprise Group Inc	34.913	2.148.113
			Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	2.474.000	2.035.070
			Drax Group Plc	284.580	2.000.816

BNY Mellon Global Leaders Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Fastenal Co	45.200	2.627.776	Ecolab Inc	14.450	2.093.615
West Pharmaceutical Services Inc	8.240	1.973.703	Air Liquide SA	8.950	1.292.031
Ecolab Inc	8.500	1.556.380	Novo Nordisk A/S	9.800	1.217.304
Air Liquide SA	6.800	1.187.373	Tencent Holdings Ltd	32.400	936.180
L'Oreal SA	2.500	1.002.230	FANUC Corp	5.900	828.276
Old Dominion Freight Line Inc	3.150	938.843	Automatic Data Processing Inc	2.600	671.615
Keyence Corp	1.800	775.174	AIA Group Ltd	62.000	654.969
Adobe Inc	1.500	627.120	TJX Cos Inc/The	8.200	653.134
ASML Holding NV	970	578.103	Intuitive Surgical Inc	2.300	613.112
Illumina Inc	2.400	557.854	Amphenol Corp - Class A	7.200	563.296
Intuitive Surgical Inc	2.200	503.881	Mastercard Inc	1.600	547.782
AIA Group Ltd	50.000	401.648	Roche Holding AG	1.630	527.752
Roche Holding AG	1.000	334.398	L'Oreal SA	1.400	523.897
Microsoft Corp	1.100	319.894	ASML Holding NV	870	513.266
Alphabet Inc	2.200	268.794	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	660	493.715
Texas Instruments Inc	1.200	212.692	Keyence Corp	1.200	491.808
NIKE Inc	1.300	168.322	CSL Ltd	2.440	491.654
			Microsoft Corp	2.000	486.695
			Fastenal Co	9.600	484.699
			Texas Instruments Inc	2.800	463.961
			Illumina Inc	2.100	435.536
			Alphabet Inc	4.400	423.606
			NIKE Inc	3.800	410.477
			Edwards Lifesciences Corp	5.600	405.053
			Industria de Diseno Textil SA	16.900	402.128
			Adobe Inc	1.200	392.404
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.800	378.625

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Global Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Exelon Corp	24.532	1.044.764	Ferguson PLC	6.200	754.662
Trane Technologies Plc	6.500	955.356	Alphabet Inc - Class A	1.286	737.864
AstraZeneca Plc	6.873	840.417	Costco Wholesale Corp	1.392	637.651
Hubbell Inc - Class B	3.606	692.222	Unilever PLC	13.912	625.073
Chubb Ltd	3.278	653.201	Eversource Energy	7.200	592.785
SSE Plc	32.839	537.626	Swedbank AB	35.768	588.896
Universal Music Group NV	22.605	507.377	Citigroup Inc	9.868	569.037
Microsoft Corp	1.475	394.699	Microsoft Corp	2.154	554.071
Cooper Cos Inc/The	1.017	372.717	Goldman Sachs Group Inc/The	1.140	368.121
SAP SE	2.871	292.675	Ebara Corp	7.900	366.134
FANUC Corp	1.900	287.832	Abbott Laboratories	3.269	363.684
Medtronic Plc	3.165	280.309	Universal Music Group NV	16.603	362.303
Alphabet Inc - Class A	736	274.149	Apple Inc	2.475	360.474
Lonza Group AG	461	260.930	Vivendi SE	28.707	342.514
Apple Inc	1.694	260.737	AstraZeneca Plc	2.418	306.234
AIA Group Ltd	27.200	259.852	Roche Holding AG	902	305.451
TE Connectivity Ltd	1.886	230.960	Mastercard Inc	838	280.098
Roche Holding AG	618	212.752	Trane Technologies Plc	1.851	278.323
Amazon.com Inc	829	207.471	Diageo Plc	6.202	274.114
Diageo Plc	4.246	195.629	Amazon.com Inc	1.605	265.744
Mastercard Inc	573	188.840	Relx Plc	9.604	264.401
Relx Plc	6.581	182.289	Accenture Plc - Class A	898	259.815
Accenture Plc - Class A	616	181.699	Ecolab Inc	1.740	258.875
CME Group Inc	842	173.928	Medtronic Plc	2.814	258.711
Goldman Sachs Group Inc/The	523	166.130	SAP SE	2.453	246.152
Sony Group Corp	1.900	163.339	CME Group Inc	1.232	241.741
Wolters Kluwer NV	1.425	140.373	Sony Group Corp	2.700	229.088
Abbott Laboratories	1.249	137.234	TE Connectivity Ltd	1.837	225.260
Texas Instruments Inc	799	133.759	Exelon Corp	5.067	215.758
Samsung SDI Co Ltd	298	132.923	AIA Group Ltd	21.400	206.668
Applied Materials Inc	1.131	120.981	Wolters Kluwer NV	2.084	206.001
Suzuki Motor Corp	3.600	119.566	Cooper Cos Inc/The	633	201.925
Costco Wholesale Corp	237	119.229	Texas Instruments Inc	1.169	189.735
Barclays Plc	57.758	117.158	Samsung SDI Co Ltd	385	177.051
			Suzuki Motor Corp	5.200	174.694
			HDFC Bank Ltd	9.644	173.574
			Barclays Plc	84.307	171.980
			Applied Materials Inc	1.657	170.073
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.772	164.430
			Hubbell Inc - Class B	745	149.638
			Lonza Group AG	272	147.935
			Bayer AG	2.376	141.031

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Ishares Physical Gold ETC	3.534.477	121.183.989	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	13.546.676	111.200.576
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	121.000.000	120.087.378	Ishares Physical Gold ETC	2.670.127	87.071.918
Invesco Physical Gold ETC	658.547	116.288.495	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	17.343.053	82.730.537
Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	116.946.000	78.803.305	Invesco Physical Gold ETC	466.666	76.588.712
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	17.343.053	77.363.707	United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	65.500.000	56.617.215
iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	684.846	66.312.908	Unilever Plc	1.242.593	53.775.451
Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	689.026	61.822.684	United States Treasury Floating Rate Note FRN 2.571% 31-Oct-2023	52.000.000	50.850.789
United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	61.767.200	58.259.221	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 29-Nov-2022	50.500.000	50.466.588
United States Treasury Note/Bond 2.250 15-Feb-2052	65.500.000	58.170.652	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 0.000% 08-Nov-2022	354.812	49.561.125
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	55.300.000	54.903.797	Alphabet Inc - Class A	21.060	46.801.810
Unilever Plc	1.201.716	51.776.519	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	71.265.000	46.424.199
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 29-Nov-2022	50.500.000	50.425.765	JPMorgan Chase & Co	308.847	38.619.765
United States Treasury Floating Rate Note FRN 0.325% 31-Oct-2023	52.000.000	45.575.468	Volkswagen AG - Preference	243.675	38.129.762
Exelon Corp	1.145.233	42.920.418	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	381.133	37.496.625
Sanofi	423.426	41.314.138	Microsoft Corp	146.384	36.434.893
Ensemble Investment Corp SA (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2024	403.000	40.300.000	NIKE Inc	264.485	32.390.485
Shell Plc	1.393.959	34.891.970	ConocoPhillips	341.082	31.582.972
Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	43.716.000	29.547.408	Thermo Fisher Scientific Inc	64.264	30.882.757
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	39.267.000	29.523.642	Linde Plc	110.292	30.588.273
Booking Holdings Inc	13.482	28.848.982	CME Group Inc	149.202	30.581.960
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	26.170.000	26.106.009	TE Connectivity Ltd	248.056	29.584.181
Greece Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2022	24.000.000	24.048.480	Norfolk Southern Corp	122.437	27.958.421
Shell PLC	1.074.600	23.935.028	Ecolab Inc	179.091	27.408.000
Microsoft Corp	85.612	23.618.423	Medtronic Plc	302.413	26.661.353
Amundi Physical Gold ETC	326.786	22.496.430	Otis Worldwide Corp	380.713	26.569.730
United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	23.073.100	21.914.928	Chubb Ltd	137.711	26.062.482
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	480.510.000	21.560.424	Alcon Inc	413.201	25.887.785
Greece Government Bond 4.375% 01-Aug-2022	20.000.000	20.432.000	L'Oreal SA	71.149	25.018.052
ICON Plc	83.993	18.755.775	Mastercard Inc	76.055	24.272.095
Dominion Energy Inc	246.439	18.485.782	Abbott Laboratories	220.643	24.114.148
			Greece Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2022	24.000.000	24.000.000
			RWE AG	650.237	23.748.639
			AstraZeneca Plc	204.539	23.126.639
			Sanofi	275.626	22.764.329

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse GBP
United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jan-2025	7.850.000	7.495.209	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Apr-2022	3.600.000	3.598.138
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Aug-2022	3.500.000	3.486.672	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Aug-2022	3.500.000	3.492.970
United Kingdom Gilt 0.500% 22-Jul-2022	3.300.000	3.300.990	United Kingdom Gilt 0.500% 22-Jul-2022	3.300.000	3.298.408
iShares Physical Gold ETC	93.328	2.651.174	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	2.599.700	2.214.238
Invesco Physical Gold ETC	17.413	2.562.895	United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Aug-2022	2.200.000	2.196.086
United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	3.163.900	2.528.565	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	311.304	2.175.314
United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Aug-2022	2.200.000	2.189.850	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jan-2025	2.207.400	2.050.910
United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	2.601.100	2.155.360	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	439.426	1.787.597
iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	21.171	1.775.309	iShares Physical Gold ETC	59.946	1.697.667
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	439.426	1.640.019	Invesco Physical Gold ETC	11.731	1.673.325
United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	1.870.700	1.515.142	Unilever Plc	35.450	1.370.703
Unilever Plc	38.108	1.458.211	United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	1.720.000	1.248.295
Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	17.373	1.301.936	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 0.000% 08-Nov-2022	8.744	1.050.230
United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	1.720.000	1.276.594	Alphabet Inc - Class A	539	1.005.791
New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	2.495.000	1.221.309	JPMorgan Chase & Co	7.280	760.272
Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	11.500	998.410	Volkswagen AG - Preference	5.697	753.355
Exelon Corp	30.928	982.922	Microsoft Corp	3.484	734.477
Sanofi	11.649	953.318	iShares MSCI Brazil UCITS ETF DE - ETF	27.297	717.076
United Kingdom Gilt 0.750% 22-Jul-2023	850.000	837.854	TE Connectivity Ltd	6.666	668.628
Shell Plc	39.383	825.124	Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	7.491	650.424
Booking Holdings Inc	392	695.982	Chubb Ltd	3.925	649.627
iShares MSCI Brazil UCITS ETF DE - ETF	27.297	658.877	Thermo Fisher Scientific Inc	1.618	649.527
Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	1.149.000	648.660	Norfolk Southern Corp	3.240	632.736
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	1.032.000	647.848	NIKE Inc	5.921	605.200
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	15.810.000	608.104	Otis Worldwide Corp	10.336	602.919
Amundi Physical Gold ETC	9.992	599.759	Alcon Inc	11.137	593.676
Microsoft Corp	2.540	584.911			

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	39.303.700	39.105.139	United States Treasury Note/Bond 2.500% 30-Apr-2024	29.399.200	28.741.663
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	37.500.000	37.573.157	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 2.000% 15-Feb-2022	28.000.000	28.000.000
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2022	26.000.000	25.908.646	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2022	26.000.000	25.933.261
Ishares Physical Gold ETC	538.846	20.036.973	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	12.921.600	12.738.915
Invesco Physical Gold ETC	102.826	19.452.664	Ishares Physical Gold ETC	388.824	12.580.292
United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Mar-2023	12.921.600	12.726.725	WisdomTree WTI Crude Oil - ETC	1.378.130	12.570.038
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	2.111.866	10.606.821	Invesco Physical Gold ETC	71.200	11.862.399
iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	108.740	10.301.017	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	2.111.866	10.528.280
United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	10.686.600	10.043.796	Unilever Plc	185.722	8.152.174
Unilever Plc	208.698	9.173.024	United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	8.290.000	7.904.665
Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	84.030	8.465.854	Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 0.000% 08-Nov-2022	46.376	6.386.751
United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	8.290.000	8.238.437	JPMorgan Chase & Co	44.302	6.148.780
United States Treasury Floating Rate Note FRN 4.323% 30-Apr-2024	8.100.000	8.093.698	Alphabet Inc - Class A	2.525	6.007.684
New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	13.720.000	8.041.207	United States Treasury Note/Bond 0.125% 31-Dec-2022	6.000.000	5.959.688
Exelon Corp	166.587	6.890.402	Linde Plc	16.198	4.801.504
Sanofi	64.471	6.783.602	Microsoft Corp	18.144	4.755.938
Shell Plc	230.396	6.155.116	Norfolk Southern Corp	19.190	4.646.689
Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	60.500	6.072.691	RWE AG	119.083	4.502.581
United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,125% 31-Dec-2022	6.000.000	5.931.797	iShares MSCI Brazil UCITS ETF DE - ETF	129.813	4.490.779
Booking Holdings Inc	1.798	4.268.329	Otis Worldwide Corp	57.089	4.415.211
iShares MSCI Brazil UCITS ETF DE - ETF	129.813	4.253.768	Volkswagen AG - Preference	25.936	4.379.655
Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	5.418.000	4.095.326	Thermo Fisher Scientific Inc	8.052	4.374.665
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	4.866.000	4.090.965	ConocoPhillips	42.852	4.304.964
Microsoft Corp	13.849	4.075.732	NIKE Inc	30.833	4.238.650
Amundi Physical Gold ETC	54.515	3.710.270			

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	319.091.785	319.091.785	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	371.567.811	371.567.811
Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp 'REGS' 5.250% 15-May-2026	12.953.000	14.542.966	Cogent Communications Group Inc 'REGS' 4.375% 30-Jun-2024	14.000.000	14.841.484
INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	10.405.000	11.682.709	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp 'REGS' 5.250% 15-May-2026	12.953.000	14.751.931
Oi European Group BV 'REGS' 2.875% 15-Feb-2025	11.400.000	10.653.426	Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026	14.074.000	14.630.259
Getlink SE 3.500% 30-Oct-2025	9.000.000	8.683.949	Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023	10.346.000	11.883.600
Faurecia SE 7.250% 15-Jun-2026	7.088.000	7.139.892	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025	13.000.000	11.112.465
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 6.000% 15-Jun-2027	7.000.000	6.982.250	EnQuest PLC '144A' 'EMTN' 7.000% 15-Oct-2023	11.107.104	10.915.588
Grifols SA 'REGS' 3.200% 01-May-2025	7.000.000	6.688.498	Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4.707% 31-Aug-2026	10.925.000	10.604.082
Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026	5.674.000	6.380.131	DKT Finance ApS 'REGS' 7.000% 17-Jun-2023	10.000.000	10.086.298
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2025	6.021.000	6.372.066	House of HR 'REGS' 7.500% 15-Jan-2027	10.000.000	9.780.558
Banjay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026	5.605.000	6.369.080	MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027 6.250% 15-Jan-2027	9.000.000	9.421.920
Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 6.007% 01-Apr-2024	5.500.000	6.240.238	CeramTec BondCo GmbH 'REGS' 5.250% 15-Dec-2025	8.000.000	8.952.017
Paprec Holding SA 'REGS' 4.000% 31-Mar-2025	6.500.000	6.076.589	INEOS Rafnes AS Term Loan 2.100% 08-Nov-2024	8.571.429	8.906.789
CITGO Petroleum Corp '144A' 7.000% 15-Jun-2025	6.000.000	5.955.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024	9.000.000	8.467.248
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN 1.125% 05-Nov-2079	6.500.000	5.863.904	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027	11.000.000	8.426.300
PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026	5.000.000	5.742.651	INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026	8.500.000	8.329.027
Kraton Polymers Holdings BV FRN 0.000% 15-Mar-2029	5.000.000	5.657.820	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025	8.000.000	8.318.457
Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3.875% 15-Nov-2025	5.450.000	5.496.006	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.561% 25-Jan-2023	8.000.000	8.207.180
Promontoria Holding 264 BV 'regs' FRN 6.250% 15-Aug-2023	4.600.000	5.219.393	Crystal Almond SARL 'REGS' 4.250% 15-Oct-2024	6.750.000	7.895.404
GCP Applied Technologies Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2026	5.000.000	5.062.500	LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027	8.000.000	7.725.000

BNY Mellon Global Unconstrained Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	855.500	810.453	iShares Physical Gold ETC	27.310	900.362
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	600.000	601.246	Citigroup Inc	7.625	433.007
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	580.000	535.112	Apple Inc	2.507	393.636
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	515.000	509.443	Legrand SA	3.638	330.738
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028	529.385	502.105	CRH Plc	5.346	285.794
Sanofi	4.101	433.783	GSK Plc	12.386	257.226
TE Connectivity Ltd	2.616	365.206	Applied Materials Inc	1.783	242.394
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	345.000	336.762	Mastercard Inc	601	199.301
Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund	216.237	308.197	Alibaba Group Holding Ltd	16.600	192.733
Lonza Group AG	519	273.114	Abbott Laboratories	1.550	182.059
Ashtead Group Plc	3.053	242.271	Bureau Veritas SA	6.586	162.295
Hubbell Inc - Class B	1.297	242.100	Texas Instruments Inc	935	160.513
Medtronic Plc	2.097	227.665	CME Group Inc	663	159.418
Trane Technologies Plc	1.456	224.185	Travis Perkins PLC	10.633	154.660
Exelon Corp	5.126	215.804	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.436	153.087
Cooper Cos Inc/The	514	207.176	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	28.700	146.195
Eli Lilly & Co	707	205.480	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	2.138	140.882
FANUC Corp	1.200	184.183	Ecolab Inc	950	139.148
Assurant Inc	785	148.412	Associated British Foods PLC	7.500	137.425
Universal Music Group NV	7.105	147.235	Roche Holding AG	394	133.306
Chubb Ltd	717	136.192	Ferguson Plc	868	126.529
HDFC Bank Ltd ADR	1.416	97.974	Vivendi SE	8.646	117.497
VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc	53.573	72.334	M3 Inc	3.900	113.428
			Otis Worldwide Corp	1.264	98.198
			AstraZeneca Plc	739	96.086
			Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028	11.601.096	95.565
			Accenture Plc - Class A	237	78.742
			Goldman Sachs Group Inc/The	190	63.083

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Kosten		Wichtige Verkäufe	Erlöse	
	Nominal	JPY		Nominal	JPY
ADEKA Corp	389.100	955.426.081	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	230.800	611.539.987
Nakanishi Inc	266.200	660.643.853	Totetsu Kogyo Co Ltd	252.000	575.242.169
Direct Marketing MIX Inc	408.000	645.786.343	Anritsu Corp	352.600	511.424.709
Aida Engineering Ltd	680.600	625.742.464	m-up Holdings Inc	294.300	413.805.096
Minkabu The Infonoid Inc	243.700	624.810.463	RS Technologies Co Ltd	51.000	375.720.750
Vector Inc	411.100	477.054.925	Yonex Co Ltd	319.600	375.510.867
TechMatrix Corp	207.800	370.049.459	Premium Group Co Ltd	159.200	289.560.127
Insource Co Ltd	152.800	323.411.108	Nippon Gas Co Ltd	153.300	285.678.072
Nifco Inc/Japan	109.300	310.521.901	Resorttrust Inc	131.500	276.136.578
Atrae Inc	163.500	281.979.567	Sanken Electric Co Ltd	44.800	272.656.944
Vision Inc/Tokyo Japan	218.100	264.202.338	Wacom Co Ltd	279.900	220.301.838
Ain Holdings Inc	39.600	256.463.343	Ain Holdings Inc	24.200	170.145.771
Oporun Co Ltd	123.100	252.059.402	Insource Co Ltd	51.600	160.031.176
m-up Holdings Inc	242.500	251.896.704	Arata Corp	33.000	138.348.513
MCJ Co Ltd	270.500	250.983.886	TRE Holdings Corp	77.600	121.047.692
RS Technologies Co Ltd	29.600	188.360.718	TechMatrix Corp	58.400	116.515.766
TRE Holdings Corp	111.500	187.506.848	Dowa Holdings Co Ltd	18.300	90.025.580
Zenkoku Hoshu Co Ltd	39.000	187.243.953	Zenkoku Hoshu Co Ltd	15.500	79.033.900
Nippon Gas Co Ltd	76.900	139.706.919	Nifco Inc/Japan	21.100	70.815.116
Anicom Holdings Inc	199.900	134.714.047	Vector Inc	56.700	68.055.389
Dowa Holdings Co Ltd	24.400	123.301.647	BrainPad Inc	54.500	65.162.603
Sanken Electric Co Ltd	22.900	114.783.411	Direct Marketing MIX Inc	33.600	60.520.123
Japan Medical Dynamic Marketing Inc	62.200	93.346.367			
Resorttrust Inc	41.700	91.166.401			
Sakata INX Corp	85.400	83.457.617			

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
West Pharmaceutical Services Inc	101.700	24.119.564	Oracle Corp	403.073	29.207.150
Costco Wholesale Corp	26.200	11.994.561	Johnson & Johnson	153.762	26.814.070
Canadian National Railway Co	94.300	10.083.629	Colgate-Palmolive Co	233.211	17.133.812
Dassault Systemes SE	120.057	3.939.959	FANUC Corp	109.600	16.633.746
Edwards Lifesciences Corp	47.600	3.359.837	Jardine Matheson Holdings Ltd	301.000	15.089.156
Booking Holdings Inc	1.450	3.089.019	Microsoft Corp	55.300	14.166.667
Paychex Inc	13.246	1.375.779	TJX Cos Inc/The	187.600	11.398.822
			Novo Nordisk A/S	106.855	10.213.166
			Alphabet Inc	3.900	9.177.168
			Automatic Data Processing Inc	40.700	8.676.042
			Alimentation Couche-Tard Inc	205.400	7.727.956
			Amphenol Corp - Class A	111.200	7.241.506
			Compass Group Plc	339.081	7.205.402
			Roche Holding AG	20.230	7.132.935
			Waters Corp	22.300	6.700.295
			Edwards Lifesciences Corp	65.000	6.567.931
			Industria de Diseno Textil SA	219.900	5.966.153
			Stryker Corp	23.300	5.574.734
			NIKE Inc	48.100	5.572.333
			Nestle SA	47.602	5.463.680
			Fastenal Co	89.500	4.660.979
			Keyence Corp	10.600	4.487.768
			Fortinet Inc	43.600	4.325.955
			Linde Plc	14.000	3.937.627
			CSL Ltd	20.651	3.746.460
			Intuitive Surgical Inc	13.000	3.471.676
			Cognizant Technology Solutions Corp	44.000	3.432.306
			L'Oreal SA	9.124	3.201.309
			Alimentation Couche-Tard Inc	67.800	2.947.637
			LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.800	2.739.234
Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.					

BNY Mellon Mobility Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Albemarle Corp	85.677	18.528.666	NVIDIA Corp	110.140	25.359.491
Trimble Inc	245.280	16.836.017	Alphabet Inc	130.578	20.571.018
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	148.800	12.372.082	MP Materials Corp	304.457	14.746.292
BYD Co Ltd 'H'	412.500	11.700.823	Hubbell Inc - Class B	64.452	13.733.661
Epiroc AB	527.801	10.442.994	Marvell Technology Inc	258.073	13.677.358
Regal Rexnord Corp	62.828	9.054.395	Rockwell Automation Inc	56.632	13.349.463
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	359.296	8.912.701	Alstom SA	396.276	12.937.388
Suzuki Motor Corp	217.000	7.401.924	Diodes Inc	153.980	12.879.163
FANUC Corp	50.500	6.966.503	Magna International Inc (Units)	171.920	11.551.333
Hubbell Inc - Class B	36.120	6.764.619	Mercedes-Benz Group AG	142.707	10.689.474
Magna International Inc (Units)	71.833	6.205.501	STMicroelectronics NV	264.328	10.401.498
Aptiv Plc	47.278	6.035.900	Geely Automobile Holdings Ltd	6.420.000	10.141.962
Twilio Inc - Class A	72.880	5.908.844	Siemens AG	89.545	9.634.854
Power Integrations Inc	67.671	5.702.578	Albemarle Corp	36.640	9.402.287
Eaton Corp Plc	37.642	5.545.481	Tesla Inc	24.098	9.133.661
TE Connectivity Ltd	36.975	4.793.351	Visteon Corp	74.970	8.932.637
Knorr-Bremse AG	100.550	4.309.072	Eaton Corp Plc	58.607	8.909.248
Samsung SDI Co Ltd	8.843	4.265.802	Semtech Corp	132.115	8.539.011
Infineon Technologies AG	159.484	4.046.240	Samsung SDI Co Ltd	16.524	8.049.864
Daimler Truck Holding AG	105.409	3.804.944	ON Semiconductor Corp	134.537	7.968.786
General Motors Co	95.533	3.652.229	Roper Technologies Inc	18.027	7.949.301
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	440.000	3.517.116	ABB Ltd	274.276	7.846.966
Amphenol Corp - Class A	45.603	3.217.623	QUALCOMM Inc	51.348	7.594.590
East Japan Railway Co	44.200	2.212.316	XPeng Inc	575.204	7.230.151
Uber Technologies Inc	68.146	2.176.856	Lyft Inc	330.987	7.174.998
Lumentum Holdings Inc	22.307	2.072.697	CrowdStrike Holdings Inc	36.816	6.587.550
KION Group AG	95.866	2.071.051	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	587.400	6.509.317
			Alfen Beheer BV '144A'	67.562	6.485.962
			ANSYS Inc	21.027	6.462.204
			CNH Industrial NV	429.126	6.406.246
			Everbridge Inc	187.458	6.010.271
			Daimler Truck Holding AG	217.204	5.858.038
			Cie Plastic Omnium SA	209.108	5.281.767
			MediaTek Inc	154.000	5.185.195
			Schneider Electric SE	31.468	5.037.385
			Denso Corp	68.500	4.847.015
			WolfSpeed Inc	47.335	4.725.575
			Lumentum Holdings Inc	50.078	4.667.956
			Anritsu Corp	383.600	4.535.334

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse EUR
JCDecaux SA	85.680	2.099.719	Acciona SA	12.223	2.270.922
Sacyr SA	759.772	1.709.689	Sopra Steria Group SACA	12.314	1.971.269
Sopra Steria Group SACA	10.502	1.688.759	Signify NV '144A'	45.432	1.809.152
Telefonica Deutschland Holding AG	584.053	1.662.318	Klepierre SA (REIT)	62.314	1.471.666
Alten SA	11.546	1.478.263	Unipol Gruppo SpA	288.058	1.436.259
Elis SA	96.177	1.307.254	Sixt SE	11.379	1.412.548
Dermapharm Holding SE	19.248	1.157.422	Edenred	29.845	1.399.158
Signify NV '144A'	32.371	1.151.023	Telefonica Deutschland Holding AG	491.790	1.398.811
Bekaert SA	29.887	1.070.595	Rheinmetall AG	6.869	1.376.516
Fnac Darty SA	20.102	1.055.370	TietoEVRY Oyj	55.644	1.350.590
Scandic Hotels Group AB '144A'	239.294	1.008.640	Eramet SA	10.634	1.258.377
TKH Group NV Dutch Cert	18.010	774.291	Eiffage SA	13.529	1.235.791
Rexel SA	38.265	757.405	Nobina AB	99.709	1.031.697
Mediaset Espana Comunicacion SA	159.643	744.015	Eurofins Scientific SE	13.533	995.322
Trigano SA	6.531	743.962	JCDecaux SA	53.651	978.971
Arkema SA	6.380	721.293	Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	97.934	977.279
Publicis Groupe SA	12.377	707.625	Italgas SpA	167.395	960.516
Sixt SE	4.859	680.055	Scandic Hotels Group AB '144A'	246.199	897.277
HelloFresh SE	19.775	567.121	Iren SpA	373.111	895.609
OCI NV	17.048	543.950	BE Semiconductor Industries NV	16.296	885.306
GN Store Nord AS	15.541	536.246	Publicis Groupe SA	16.634	873.628
HUGO BOSS AG	9.344	465.265	Schaeffler AG - Preference	146.869	846.229
Deutsche EuroShop AG	20.824	456.561	Dermapharm Holding SE	16.602	831.421
Eurofins Scientific SE	5.453	417.243	Korian SA	40.796	788.136
Sartorius AG - Preference	1.137	370.820	Aegon NV	162.167	744.874
BE Semiconductor Industries NV	8.857	369.613	Rexel SA	40.259	723.094
Eiffage SA	3.988	359.661	Brenntag SE	10.516	722.620
			Sacyr SA	290.337	707.586
			Bekaert SA	19.954	677.805
			Valmet Oyj	26.001	655.355
			Elis SA	48.361	648.936
			Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	10.072	611.081
			Alten SA	4.911	595.793
			Fnac Darty SA	13.551	591.584
			Sartorius AG - Preference	1.604	580.589
			Arkema SA	5.504	551.079
			Anima Holding SpA '144A'	128.741	529.943
			GFT Technologies SE	12.206	514.718

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Sanofi ADR	32.136	1.573.725	Merck & Co Inc	7.954	772.067
BioMarin Pharmaceutical Inc	16.598	1.414.384	AbbVie Inc	4.279	671.772
AbbVie Inc	8.984	1.327.173	Catalent Inc	9.348	662.780
Eli Lilly & Co	3.585	1.180.841	Merck KGaA	3.135	547.850
Cytokinetics Inc	28.028	1.146.419	Lonza Group AG	1.062	518.356
Merck KGaA	6.176	1.130.577	Roche Holding AG	1.488	487.800
Danaher Corp	3.822	1.050.601	Eli Lilly & Co	1.459	471.397
Seagen Inc	5.975	948.309	Sartorius AG - Preference	1.426	470.058
illumina Inc	4.438	948.299	Avantor Inc	17.440	438.472
Denali Therapeutics Inc	27.419	945.782	Sarepta Therapeutics Inc	3.956	426.794
AstraZeneca Plc	6.838	907.715	CRISPR Therapeutics AG	7.024	412.818
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.229	863.510	Fate Therapeutics Inc	16.948	319.272
Repligen Corp	4.436	857.993	Repligen Corp	1.394	268.423
Catalent Inc	7.690	810.379	Seagen Inc	1.507	252.018
Moderna Inc	5.039	800.836	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.247	238.115
Biogen Inc	3.171	793.891	Sanofi ADR	4.948	234.619
uniQure NV	32.287	776.780	Cytokinetics Inc	4.331	233.138
Ultragenyx Pharmaceutical Inc	15.605	749.867	Bio-Techne Corp	620	191.280
Alnylam Pharmaceuticals Inc	5.325	741.199	AstraZeneca Plc	1.474	188.073
Legend Biotech Corp ADR	15.101	732.391	uniQure NV	8.244	167.029
Merck & Co Inc	7.954	720.071	Quantarix Corp	13.329	149.394
Sarepta Therapeutics Inc	8.673	715.289	ICON PLC	489	120.776
Intellia Therapeutics Inc	10.671	667.295	PTC Therapeutics Inc	2.383	92.278
Bio-Techne Corp	1.799	651.888			
PTC Therapeutics Inc	12.875	568.840			
Keros Therapeutics Inc	16.757	544.611			
Sartorius AG - Preference	1.235	520.876			
Lonza Group AG	890	514.145			
Beam Therapeutics Inc	7.947	508.767			
Fate Therapeutics Inc	15.093	468.217			
Kymera Therapeutics Inc	19.305	441.337			
CRISPR Therapeutics AG	5.624	426.378			
Avantor Inc	13.323	410.202			
IQVIA Holdings Inc	2.075	401.218			
Roche Holding AG	1.137	391.481			
MeiraGTx Holdings plc	41.959	368.581			

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	48.698.500	42.720.121	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Jan-2025	39.861.100	37.213.385
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	41.432.100	38.025.980	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.433% 31-Oct-2023	31.650.000	30.405.304
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	15.433.600	13.558.916	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	12.586.900	10.916.873
United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	14.978.100	13.296.378	Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023	14.430.000	9.889.016
United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026	12.586.900	11.091.689	United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030	11.103.600	9.520.328
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	11.910.000	10.956.134	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 4.383% 31-Jan-2024	7.972.400	7.621.966
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	7.892.106	9.442.307	United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045	8.760.000	7.132.640
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	8.743.810	8.609.594	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	10.160.000	6.969.429
Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	10.640.000	7.192.160	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	7.850.000	6.923.639
Canadian Government Bond 0.250% 01-May-2023	9.920.000	7.133.515	United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	7.200.000	6.902.289
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043	7.850.000	7.113.963	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	10.640.000	6.786.789
New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	12.510.000	7.007.606	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	7.226.622	6.494.363
Canada Housing Trust No 1 '144A' 1.750% 15-Jun-2030	10.160.000	6.944.891	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023	8.750.000	6.135.897
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Apr-2027	7.110.083	6.673.055	French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025	5.432.201	5.794.528
United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	7.200.000	6.218.654	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023	5.359.428	5.147.309
Canadian Government Bond 1.750% 01-Mar-2023	8.110.000	5.815.161	Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023	125.640.000	4.788.914
Denmark Government Bond 0.000% 15-Nov-2031	43.180.000	5.301.142	Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023	6.980.000	4.759.878
Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051	10.450.000	5.003.337	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041	2.803.691	3.494.129
New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051	9.450.000	4.363.672	Republic of Poland Government Bond 4.000% 25-Oct-2023	16.940.000	3.453.917
Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.150% 12-Aug-2032	18.450.000	4.156.591	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031	3.522.360	3.450.007
Dexia Credit Local SA 0.500% 22-Jul-2023	3.500.000	4.100.771	Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2044	2.330.000	3.440.170
Canada Housing Trust No 1 '144A' FRN 4.648% 15-Mar-2027	5.630.000	3.918.092			
International Bank for Reconstruction & Development FRN 4.448% 22-Nov-2028	4.090.000	3.686.178			

BNY Mellon Sustainable Global Emerging Markets Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	42.000	587.486	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	16.025	90.226
Alia Group Ltd	45.800	399.599	Hualan Biological Engineering Inc	31.600	79.861
Hindustan Unilever Ltd	10.566	349.670	ASML Holding NV	89	53.669
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	43.447	348.904	Alia Group Ltd	4.600	49.594
Marico Ltd	50.666	339.095	Samsung SDI Co Ltd	111	46.484
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.092.900	323.045	Delta Electronics Inc	5.000	41.527
Tata Consultancy Services Ltd	8.141	295.309	XPeng Inc	5.600	39.574
HDFC Bank Ltd	15.997	280.788	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	3.400	34.344
WEG SA	46.802	272.027	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.000	30.809
ASML Holding NV	567	260.986	Hindustan Unilever Ltd	839	26.722
Godrej Consumer Products Ltd	23.506	254.366	WEG SA	2.820	20.564
NARI Technology Co Ltd 'A'	68.000	237.397	PB Fintech Ltd	2.335	11.320
Dr Lal PathLabs Ltd '144A'	7.489	233.513	Sungrow Power Supply Co Ltd	500	8.200
By-health Co Ltd	95.600	225.837			
Housing Development Finance Corp Ltd	7.893	225.165			
Bandhan Bank Ltd '144A'	67.522	218.650			
Raia Drogasil SA	49.433	218.315	Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.		
Samsung SDI Co Ltd	517	218.291			
Delta Electronics Inc	26.000	213.297			
Livent Corp	6.969	212.934			
Info Edge India Ltd	4.322	202.932			
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	28.800	200.757			
LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	29.800	200.481			
Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A'	41.500	199.543			
Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd	7.400	196.056			
Novozymes A/S	3.843	190.345			
L'Oreal SA	590	188.969			
Infineon Technologies AG	7.645	173.323			
Clicks Group Ltd	10.704	166.627			
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	2.700	161.654			
Sungrow Power Supply Co Ltd	9.900	156.580			
Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	33.400	155.103			
StarPower Semiconductor Ltd 'A'	3.200	148.426			
Capitec Bank Holdings Ltd	1.613	148.388			
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	27.500	146.728			
Havells India Ltd	8.776	138.298			
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	3.500	126.403			
Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	73.908	125.987			
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A'	14.900	121.811			
Discovery Ltd	19.677	118.729			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd	2.222	118.480			
Afya Ltd - Class A	8.357	117.633			
HDFC Life Insurance Co Ltd '144A'	16.977	117.305			
Syngene International Ltd '144A'	16.979	115.599			
Fleury SA	33.455	114.168			
ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd '144A'	16.025	105.420			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
United States Treasury Floating Rate Note FRN 0.275% 31-Oct-2023	10.724.300	9.659.900	United States Treasury Floating Rate Note FRN 0.486% 31-Oct-2023	10.724.300	10.346.688
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 29-Nov-2022	4.668.000	4.661.118	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 29-Nov-2022	4.668.000	4.667.838
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15-Feb-2025	4.525.000	4.483.086	Ishares Physical Gold ETC	67.964	2.209.562
Invesco Physical Gold ETC	20.255	3.554.227	Invesco Physical Gold ETC	13.514	2.207.869
Ishares Physical Gold ETC	100.675	3.448.292	Unilever Plc	48.398	2.198.056
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.300% 15-Aug-2023	3.205.000	3.181.468	Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	3.085.000	2.015.020
Unilever Plc	55.289	2.483.807	United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	1.967.700	1.700.850
United States Treasury Note/Bond 3.250% 15-May-2042	2.579.400	2.430.593	Alphabet Inc - Class A	678	1.476.299
Merrill Lynch International & Co CV 0.000% 24-Jan-2025	25.921	2.325.755	Amundi Physical Gold ETC	18.559	1.257.482
Amundi Physical Gold ETC	33.257	2.318.584	Microsoft Corp	4.880	1.205.143
New Zealand Government Bond 0.500% 15-May-2024	3.703.000	2.118.102	Ensemble Investment Corp SA (WTS) 08-Nov-2022	8.635	1.189.362
Australia Government Bond 2.750% 21-Apr-2024	3.085.000	2.077.714	JPMorgan Chase & Co	9.319	1.187.424
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Mar-2023	2.000.000	1.995.360	Linde Plc	4.199	1.151.456
Exelon Corp	44.903	1.758.311	HDFC Bank Ltd ADR	18.867	1.137.501
United States Treasury Note/Bond 2.250% 15-Feb-2052	1.967.700	1.749.312	Wisdomtree Carbon - ETC	35.967	1.057.934
Sanofi	16.756	1.645.893	Volkswagen AG - Preference	6.339	982.545
Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031	35.110.000	1.575.381	Chubb Ltd	5.105	966.695
Microsoft Corp	5.134	1.377.055	Norfolk Southern Corp	4.131	940.211
Ensemble Investment Corp SA (WTS) 04-Nov-2024	11.500	1.150.000	CME Group Inc	4.481	921.113
Booking Holdings Inc	546	1.133.103	TE Connectivity Ltd	7.655	919.765
Australia Government Bond 3.750% 21-Apr-2037	1.512.000	1.113.228	RWE AG	24.186	877.385
Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047	1.699.000	1.112.711	Sanofi	10.562	871.736
			Otis Worldwide Corp	11.874	830.281
			Alcon Inc	13.043	811.748
			Greencoat UK Wind Plc/Funds	465.067	799.733

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	13.525.000	12.964.921	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029	13.480.000	12.790.131
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Feb-2032	6.785.000	6.085.106	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	6.550.000	6.078.529
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2035	5.000.000	5.546.020	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Feb-2032	6.785.000	5.996.683
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	4.300.000	4.922.816	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2035	5.000.000	5.213.705
Bundesobligation 0.000% 16-Apr-2027	3.600.000	3.663.497	Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024	4.225.000	4.255.116
United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040	4.950.000	3.529.584	United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023	4.300.000	4.158.152
Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	496.450.000	3.519.001	Bundesobligation 0.000% 10-Apr-2026	3.550.000	3.660.119
Australia Government Bond 1.250% 21-May-2032	5.800.000	3.150.213	Bundesobligation 0.000% 16-Apr-2027	3.600.000	3.521.363
United States Treasury Note/Bond 3.000% 30-Jun-2024	3.050.000	3.043.696	Republic of Italy 1.350% 15-Apr-2022	2.900.000	3.162.886
United States Treasury Note/Bond 4.125% 15-Nov-2032	2.775.000	2.870.293	United States Treasury Note/Bond 3.000% 30-Jun-2024	3.050.000	3.048.031
Hellenic Republic Government Bond '144A' 2.000% 22-Apr-2027	2.650.000	2.763.575	Australia Government Bond 1.250% 21-May-2032	5.800.000	3.032.430
United Kingdom Gilt 1.250% 31-Jul-2051	2.010.000	2.557.384	Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050	507.200.000	3.002.702
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	2.225.718	2.553.234	United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022	2.900.000	2.899.767
United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2032	2.450.000	2.404.072	Hellenic Republic Government Bond '144A' 2.000% 22-Apr-2027	2.650.000	2.663.148
United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025	2.450.000	2.339.367	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15-Apr-2033	2.284.787	2.496.762
United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2029	2.475.000	2.304.844	United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	2.475.000	2.390.464
United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031	1.930.000	2.080.027	United States Treasury Note/Bond 1.875% 28-Feb-2029	2.475.000	2.296.336
Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035	28.769.000	1.696.964	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	2.250.000	2.282.043
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Jun-2032	1.925.000	1.582.895	United Kingdom Gilt 1.250% 31-Jul-2051	2.010.000	2.074.230
Ireland Government Bond 0.350% 18-Oct-2032	1.325.000	1.193.815	Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	1.875.000	1.856.469
			Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049	1.600.000	1.653.000
			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01-Jun-2032	1.925.000	1.545.530

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse USD
Raytheon Technologies Corp	153.069	14.852.839	AbbVie Inc	100.610	15.034.679
Sanofi ADR	254.320	13.017.617	Devon Energy Corp	222.951	13.982.243
JPMorgan Chase & Co	99.999	12.912.696	CVS Health Corp	112.604	11.261.342
MetLife Inc	164.906	11.141.041	Marathon Petroleum Corp	109.327	10.270.899
Gilead Sciences Inc	150.895	10.983.395	Merck & Co Inc	110.364	9.798.069
Chubb Ltd	49.405	9.932.306	CF Industries Holdings Inc	112.658	9.739.612
Comerica Inc	110.980	9.704.914	UnitedHealth Group Inc	16.929	8.500.520
Exxon Mobil Corp	103.540	9.659.998	Exelon Corp	203.960	8.456.013
Allstate Corp/The	71.894	9.494.573	Valero Energy Corp	63.272	7.629.469
Interpublic Group of Cos Inc/The	281.745	8.484.124	Comerica Inc	107.126	7.432.052
CME Group Inc	44.638	8.447.370	Constellation Energy Corp	88.670	7.352.001
Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023	157.821	7.931.498	MetLife Inc	105.632	7.098.391
Medtronic Plc	80.218	7.917.691	Hubbell Inc - Class B	29.394	6.543.866
Cisco Systems Inc	153.027	7.523.458	Assurant Inc	40.352	6.406.265
Hewlett Packard Enterprise Co	455.625	7.523.229	Ameriprise Financial Inc	24.193	6.098.633
Goldman Sachs Group Inc/The	22.341	7.351.693	Exxon Mobil Corp	64.719	5.983.489
British American Tobacco Plc ADR	158.514	6.852.794	Bank of America Corp	171.556	5.854.437
Bank of America Corp	184.617	6.772.818	Charles Schwab Corp/The	67.620	5.834.778
Omnicom Group Inc	95.830	6.619.324	State Street Corp	62.067	5.325.451
Bunge Ltd	68.592	6.567.184	Organon & Co	190.680	5.281.913
International Game Technology Plc	254.090	6.437.979	Norfolk Southern Corp	21.619	5.264.579
Schlumberger Ltd	142.407	6.305.875	Clearway Energy Inc	152.252	5.141.459
US Bancorp	124.265	6.230.293	Vistra Corp	216.189	5.129.696
Freeport-McMoRan Inc	184.441	6.185.000	Eli Lilly & Co	15.571	5.029.096
Valero Energy Corp	63.272	6.032.813	Bank of America Corp	36.090	4.953.766
Exelon Corp	127.705	5.964.195	Medical Properties Trust Inc (REIT)	232.021	4.769.048
EOG Resources Inc	44.128	5.786.247	Morgan Stanley	54.691	4.730.321
Caterpillar Inc	26.394	5.700.029	Vodafone Group PLC ADR	398.164	4.726.088
Ameriprise Financial Inc	18.327	5.495.541			
Constellation Energy Corp	87.191	5.406.035			
Comcast Corp	132.269	5.337.127			
Eli Lilly & Co	17.782	5.089.113			
Everest Re Group Ltd	14.946	4.936.112			
Merck & Co Inc	60.036	4.891.748			
AbbVie Inc	31.114	4.518.852			
PPL Corp	162.764	4.428.052			
Eaton Corp Plc	28.610	4.277.818			
Fidelity National Information Services Inc	63.311	4.204.781			
UnitedHealth Group Inc	7.643	3.906.144			
Hess Corp	32.914	3.741.840			
Weyerhaeuser Co (REIT)	94.112	3.657.496			
Hubbell Inc - Class B	18.487	3.555.561			
Hartford Financial Services Group Inc/The	49.834	3.553.868			
PNC Financial Services Group Inc/The	21.749	3.531.598			

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse USD
Los Angeles Community College District/CA 1.606% 01-Aug-2028	17.500.000	15.399.775	City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 3.303% 01-Nov-2039	21.635.000	22.113.134
County of Cook IL 5.790% 15-Nov-2029	12.650.000	13.384.144	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5.000% 01-May-2049	10.000.000	11.116.500
Dallas Fort Worth International Airport 3.089% 01-Nov-2040	13.440.000	11.215.012	Los Angeles Community College District/CA 1.606% 01-Aug-2028	12.500.000	10.593.750
Florida Municipal Power Agency 1.425% 01-Oct-2026	11.750.000	10.702.135	Massachusetts School Building Authority 3.395 % 15-Oct-2040	11.450.000	10.476.407
PEFA Inc 5.000 % 01-Sep-2049	9.850.000	10.208.343	Piedmont Municipal Power Agency 5.000% 01-Jan-2030	8.700.000	10.060.749
State Public School Building Authority 5.426% 15-Sep-2026	8.500.000	9.065.675	City of New York NY 4.000% 01-Mar-2050	11.000.000	9.464.620
Chicago O'Hare International Airport 5.000% 01-Jan-2033	8.850.000	8.923.809	State of New York 3.110% 15-Feb-2037	10.000.000	9.425.000
California Statewide Communities Development Authority 7.140% 15-Aug-2047	8.500.000	8.690.250	New York State Urban Development Corp 2.840% 15-Mar-2032	10.000.000	9.018.000
Black Belt Energy Gas District 5.250% 01-Feb-2053	7.500.000	7.772.775	New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028	10.000.000	8.850.600
City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 4.258% 01-Feb-2036	7.865.000	7.697.240	City of New York NY 2.173% 01-Aug-2034	10.000.000	8.584.800
Detroit City School District 6.645% 01-May-2029	6.900.000	7.509.201	City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033	7.000.000	8.352.680
Municipal Electric Authority of Georgia 6.474% 01-Jul-2045	7.000.000	7.000.000	Indianapolis Local Public Improvement Bond Bank 4.000% 01-Jun-2040	8.000.000	7.905.120
Chicago Park District 2.925% 01-Jan-2038	9.530.000	6.868.938	Santa Monica-Malibu Unified School District 2.944% 01-Aug-2036	9.500.000	7.320.225
Public Finance Authority 8.145% 01-Aug-2028	6.700.000	6.740.814	Pennsylvania Turnpike Commission 3.416% 01-Dec-2041	9.000.000	6.814.890
San Joaquin Hills Transportation Corridor Agency 3.492% 15-Jan-2050	7.500.000	6.073.050	State of California 5.250% 01-Aug-2032	5.000.000	6.130.060
Tennessee State School Bond Authority 1.515% 15-Sep-2026	6.480.000	5.964.451	Michigan Finance Authority 5.000% 01-Dec-2034	5.275.000	5.804.874
Texas Water Development Board 5.000% 15-Oct-2042	5.000.000	5.848.050	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2036	5.110.000	5.584.310
Michigan Finance Authority 5.000% 01-Dec-2034	5.275.000	5.565.811	Texas Water Development Board 5.000% 15-Oct-2042	5.000.000	5.579.050
University of Houston 5.000% 15-Feb-2037	5.230.000	5.471.626	University of Houston 5.000% 15-Feb-2037	5.230.000	5.505.498
City of Houston TX Airport System Revenue 4.000% 01-Jul-2047	5.000.000	5.410.400	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.400% 01-Aug-2025	5.000.000	5.074.350
State of Connecticut Special Tax Revenue 5.000% 01-Nov-2034	3.750.000	4.778.850	State of Oregon Department of Transportation 2.851% 15-Nov-2032	5.000.000	4.745.100
Massachusetts Educational Financing Authority 4.595% 01-Jul-2031	4.700.000	4.700.000	Pennsylvania Higher Educational Facilities Authority 4.000% 15-Aug-2044	4.965.000	4.671.866
State Board of Administration Finance Corp 2.154% 01-Jul-2030	5.295.000	4.628.360	Sycamore Community City School District 4.000% 01-Dec-2029	4.080.000	4.638.797
New York Transportation Development Corp 3.573% 01-Jul-2029	5.000.000	4.505.700	City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2040	4.500.000	4.512.240
City of Atlanta GA Department of Aviation 5.000% 01-Jul-2028	3.955.000	4.339.822	State of Connecticut Special Tax Revenue 5.000% 01-Nov-2034	3.750.000	4.343.175
University of Michigan 3.504% 01-Apr-2052	5.000.000	4.216.500	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2.984% 15-Nov-2042	5.800.000	4.288.868
Oklahoma Development Finance Authority '2022-ONG A3' 4.714% 01-May-2052	4.200.000	4.193.000	City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029	3.975.000	4.165.776
Hampton Roads Transportation Accountability Commission 5.000% 01-Jul-2026	3.500.000	4.166.505	Hampton Roads Transportation Accountability Commission 5.000% 01-Jul-2026	3.500.000	4.010.335
Indiana Finance Authority 4.314% 01-Mar-2052	4.250.000	4.031.168	New York State Dormitory Authority 2.412% 01-Jul-2031	5.000.000	3.993.500
Massachusetts Educational Financing Authority 4.429% 01-Jul-2029	4.000.000	4.000.000	Alabama Federal Aid Highway Finance Authority 1.856% 01-Sep-2029	4.000.000	3.631.160
Greater Orlando Aviation Authority 5.000% 01-Oct-2044	3.750.000	3.876.975	Camden County Improvement Authority/The 5.000% 01-Jul-2033	3.000.000	3.510.750
Alabama Federal Aid Highway Finance Authority 1.727% 01-Sep-2028	4.350.000	3.777.323	Onondaga Civic Development Corp 5.000% 01-Dec-2029	2.870.000	3.281.311
Michigan State Building Authority 2.705% 15-Oct-2040	5.000.000	3.694.750	Industrial Development Authority of the City of Phoenix Arizona/The 0.020% 15-Nov-2052	3.160.000	3.160.000
New Jersey Educational Facilities Authority 3.613% 01-Jul-2050	5.000.000	3.613.150	Chicago O'Hare International Airport 5.000% 01-Jan-2033	3.000.000	3.001.350
Maryland Economic Development Corp 5.250% 30-Jun-2052	3.040.000	3.227.355	Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2031	2.470.000	2.974.745
City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029	2.995.000	3.180.046			
Port Authority of New York & New Jersey 5.000% 15-Jan-2052	3.000.000	3.120.240			

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 3.631% 13-Dec-2029	11.568.000	11.568.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028	6.944.000	5.179.371
ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 5.125% 22-Feb-2033	8.700.000	8.679.033	Coca-Cola Co/The 0.800% 15-Mar-2040	5.941.000	5.171.820
BPCE SA 'EMTN' 0.375% 02-Feb-2026	8.000.000	7.970.880	Coca-Cola Europacific Partners Plc 0.750% 24-Feb-2022	4.949.000	4.949.000
Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 3.875% 16-Jun-2032	7.900.000	7.897.156	Yorkshire Building Society 'EMTN' 0.500% 01-Jul-2028	5.260.000	4.573.677
Enel Finance International NV 0.250% 17-Nov-2025	7.492.000	7.479.189	Societe Generale SA 'EMTN' 0.125% 18-Feb-2028	5.000.000	4.454.220
Unicaja Banco SA 'EMTN' FRN 2.250% 15-Nov-2027	7.100.000	7.089.279	TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	4.734.000	4.377.150
KBC Group NV 'EMTN' 3.000% 25-Aug-2030	7.100.000	7.072.168	Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Apr-2171	4.200.000	4.047.000
Morgan Stanley FRN 2.950% 07-May-2032	6.562.000	6.562.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN' 0.875% 18-Jul-2025	4.082.000	4.027.921
Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	6.600.000	6.525.991	Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 1.000% 13-Apr-2028	4.483.000	3.777.704
Societe Generale SA 'EMTN' 2.625% 30-May-2029	6.300.000	6.297.984	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028	4.073.000	3.601.399
Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 4.125% 08-Sep-2025	6.300.000	6.288.345	Becton Dickinson and Co 1.000% 15-Dec-2022	3.580.000	3.595.628
Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.100% 26-Jan-2025	6.200.000	6.197.396	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 17-Jul-2023	3.584.000	3.581.133
Bank of America Corp 'EMTN' FRN 2.824% 27-Apr-2033	6.138.000	6.135.423	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032	4.385.000	3.455.718
Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 4.000% 21-Nov-2029	6.100.000	6.093.412	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 4.000% 21-Sep-2029	3.355.000	3.309.455
TenneT Holding BV 'EMTN' 2.750% 17-May-2042	6.179.000	6.071.053	BNP Paribas SA FRN 0.500% 01-Sep-2028	3.900.000	3.269.596
Allianz SE 'EMTN' FRN 4.252% 05-Jul-2052	6.000.000	6.000.420	Allianz SE 'EMTN' FRN 4.252% 05-Jul-2052	3.200.000	3.148.656
ASR Nederland NV FRN 7.000% 07-Dec-2043	5.975.000	5.928.813	National Grid PLC 'Emtn' 2.949% 30-Mar-2030	3.122.000	3.133.302
de Volksbank NV FRN 2.375% 04-May-2027	5.700.000	5.690.538	Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 28-Aug-2023	3.150.000	3.119.550
Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 4.000% 22-Sep-2026	5.700.000	5.688.657	Bouygues SA 3.250% 30-Jun-2037	3.000.000	3.089.686
Arval Service Lease SA/France 'EMTN' 0.875% 17-Feb-2025	5.300.000	5.292.951	ING Groep NV FRN 1.750% 16-Feb-2031	3.200.000	3.076.673

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	1.100.000	1.081.789	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.978% 09-Jun-2024	600.000	595.068
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	700.000	712.562	Koninklijke Philips NV 'EMTN' 1.375% 30-Mar-2025	500.000	508.231
Vonovia SE 'EMTN' 0.625% 24-Mar-2031	700.000	659.791	Snam SpA 'EMTN' 1.250% 28-Aug-2025	500.000	475.167
Veolia Environnement SA 'EMTN' 1.940% 07-Jan-2030	600.000	644.549	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025	500.000	469.190
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.978% 09-Jun-2024	600.000	614.478	Orange SA 'EMTN' 0.125% 16-Sep-2029	500.000	446.456
Enel Finance International NV 'EMTN' 1.125% 16-Sep-2026	600.000	608.945	Veolia Environnement SA 'EMTN' 1.940% 07-Jan-2030	400.000	418.104
Vattenfall AB 'EMTN' 0.500% 24-Jun-2026	600.000	601.142	Telia Co AB FRN 1.375% 11-May-2081	400.000	382.725
Engie SA FRN (Perpetual) 1.500% 30-May-2028	600.000	595.494	Vattenfall AB 'EMTN' 0.500% 24-Jun-2026	400.000	367.104
Societe Generale SA FRN 0.875% 22-Sep-2028	600.000	595.155	Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.300% 10-Nov-2029	400.000	360.770
Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	600.000	587.777	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	400.000	359.479
LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 07-Sep-2026	600.000	580.436	BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024	300.000	299.112
Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028	600.000	575.620	BPCE SA 0.125% 04-Dec-2024	300.000	296.171
ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	600.000	566.759	AbbVie Inc 2.125% 17-Nov-2028	300.000	294.706
HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 1.500% 04-Dec-2024	550.000	565.589	TenneT Holding BV FRN (Perpetual) 2.374% 22-Oct-2170	300.000	290.781
Credit Agricole SA 'EMTN' 0.125% 09-Dec-2027	600.000	559.554	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'eMTN' 0.750% 09-Aug-2027	300.000	282.909
SSE Plc 'EMTN' 1.375% 04-Sep-2027	500.000	526.035	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031	300.000	277.833
Koninklijke Philips NV 'EMTN' 1.375% 30-Mar-2025	500.000	519.415	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 0.750% 12-Jan-2034	300.000	272.353
Snam SpA 'EMTN' 1.250% 28-Aug-2025	500.000	518.330	Societe Generale SA FRN 0.875% 22-Sep-2028	300.000	270.561
BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024	500.000	514.420	Royal Schiphol Group NV 'EMTN' 1.500% 05-Nov-2030	300.000	269.918
Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026	500.000	505.691	Novartis Finance SA 0.000% 23-Sep-2028	300.000	269.796
Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.450% 19-May-2025	500.000	503.661	ESB Finance DAC 'EMtn' 1.000% 19-Jul-2034	300.000	267.418
BPCE SA 0.125% 04-Dec-2024	500.000	502.260	Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.502% 05-May-2171	300.000	251.175
JPMorgan Chase & Co FRN 0.768% 09-Aug-2025	550.000	501.523	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.500% 28-Nov-2029	300.000	251.049
Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027	500.000	501.245	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.000% 22-Sep-2033	300.000	248.326
Digital Intrepid Holding BV 1.375% 18-Jul-2032	700.000	498.774	FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 0.250% 02-Dec-2030	300.000	246.032
Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027	500.000	497.515	Pfizer Inc 2.625% 01-Apr-2030	250.000	222.339
UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029	500.000	497.240	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032	200.000	204.439
Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.300% 10-Nov-2029	500.000	495.200	Verbund AG 0.900% 01-Apr-2041	200.000	200.642
Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	500.000	491.800	Electricite de France SA 'EMTN' 4.750% 12-Oct-2034	200.000	199.881
Orange SA 'EMTN' 0.125% 16-Sep-2029	500.000	490.580	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.750% 24-Jul-2032	200.000	194.826
FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 0.250% 02-Dec-2030	500.000	480.670	Suez SACA 'EMTN' 2.875% 24-May-2034	200.000	189.879
AIB Group Plc 'EMTN' FRN 0.500% 17-Nov-2027	450.000	444.654	Peabody Capital No 2 Plc 2.750% 02-Mar-2034	226.000	181.292
Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 0.375% 10-May-2027	450.000	442.980	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 15-Oct-2028	200.000	179.898
Citigroup Inc FRN 3.713% 22-Sep-2028	437.000	437.582	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 23-Sep-2029	200.000	179.023
Thermo Fisher Scientific Inc 0.875% 01-Oct-2031	450.000	425.873	SSE Plc 'EMTN' 1.375% 04-Sep-2027	200.000	178.746
			Amgen Inc 3.000% 22-Feb-2029	200.000	174.448
			LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 07-Sep-2026	200.000	174.378
			Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN 1.250% 11-Jun-2029	200.000	172.810
			VF Corp 0.250% 25-Feb-2028	200.000	170.014
			Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027	200.000	163.600
			La Banque Postale SA 'EMTN' 0.750% 23-Jun-2031	200.000	159.960
			Banco Santander SA 'EMTN' FRN 0.625% 24-Jun-2029	200.000	158.440
			Orsted AS 'EMTN' 2.875% 14-Jun-2033	148.000	154.733
			Bristol-Myers Squibb Co 2.950% 15-Mar-2032	165.000	149.589
			Vonovia SE 'EMTN' 0.625% 24-Mar-2031	200.000	147.118
			JPMorgan Chase & Co FRN 0.768% 09-Aug-2025	150.000	137.845

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

ANHANG 1

OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (ungeprüft)

Gemäß der OGAW-V-Richtlinie, den irischen Umsetzungsvorschriften und den Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) zur Vergütung im Rahmen von OGAW („der OGAW-Vergütungskodex“) ist die Gesellschaft verpflichtet, Einzelheiten zu der von der Verwaltungsgesellschaft im Geschäftsjahr an ihre Mitarbeiter gezahlten Vergütung offenzulegen.

In Übereinstimmung mit den Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG, geändert durch die Richtlinie 2014/91/EG, (die „OGAW-Richtlinie“) unterliegt die Verwaltungsgesellschaft den in Artikel 14(b) der OGAW-Richtlinie genannten Vergütungsregelungen. Diese fordern von den Verwaltungsgesellschaften von OGAW die Einführung von Vergütungsvorschriften, -verfahren und -praktiken, die:

- mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind;
- nicht zur Übernahme von übermäßigen Risiken ermutigen, die mit den Risikoprofilen oder der maßgeblichen Dokumentation des OGAW nicht vereinbar sind; und
- die Verwaltungsgesellschaft des OGAW nicht daran hindern, pflichtgemäß im besten Interesse des OGAW zu handeln.

Die Verwaltungsgesellschaft wendet ihre Vergütungspolitik und -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 2022:

	USD
Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr (ohne MwSt.)	345.501
Davon feste Vergütung	202.485
Davon variable Vergütung	143.016

ANHANG 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 2022 angegeben:

Fund	währung	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere	% der Summe der verleihbaren Vermögenswerte	% des Netto- inventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	9.018.528	4,36	2,69
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	160.667	0,50	0,11
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	8.112.634	1,57	1,46
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	1.979.912	1,13	1,11
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	173.391	0,38	0,37
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	61.330.660	4,46	4,33
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	38.759.960	13,21	11,00
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	389.675	1,98	1,61
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	2.301.930	16,34	9,11
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	444.437	2,74	1,81
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	2.231.278	10,23	5,83
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	26.262.142	16,47	14,87
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	3.495.133	8,48	7,97
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	13.777.377	5,36	3,37
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	21.907.141	6,30	5,69
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	28.702.803	21,79	8,32
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	218.075	2,64	0,62
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	13.833.764	4,39	3,52
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	21.197.934	4,84	3,96
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	9.813.629	9,18	8,93
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	17.647.178	14,43	14,43
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	21.881	0,05	0,05
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	318.824	1,55	1,18
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	185.649.586	17,62	8,82
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	330.947	1,03	0,55
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	1.574.901	0,82	0,45
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	65.273.418	13,30	12,19
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.333.323	12,43	9,03
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	642.605.374	3,10	2,75
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	6.556.860	15,31	15,18
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	3.635.332	1,07	1,02

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

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 2022 bei jedem Sicherheitentreuhänder als Sachsicherheit gehalten wurden, die im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden:

Fund	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund		EUR	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	5.062.744		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	14.122.368
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.037.542		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	7.772.842
	Euroclear Triparty	3.233.576		Euroclear Triparty	18.617.595
		9.333.862			40.512.805
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		GBP	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	176.644		Euroclear Triparty	408.895
		176.644			408.895
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund		USD	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	7.666.417		Euroclear Triparty	2.525.999
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.228.618			2.525.999
		8.895.035	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund		USD
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund		USD		Euroclear Triparty	479.553
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	157.329			479.553
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.261.105	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund		USD
	Euroclear Triparty	656.158		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	160.673
		2.074.592		Euroclear Triparty	2.237.997
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund		USD			2.398.670
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	123.344	BNY Mellon Euroland Bond Fund		EUR
	Euroclear Triparty	58.392		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	8.954.042
		181.736		Euroclear Triparty	18.124.609
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund		USD			27.078.651
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	6.067	BNY Mellon European Credit Fund		EUR
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	62.872.137		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	495.682
		62.878.204		Euroclear Triparty	3.105.384
					3.601.066

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Bond Fund		USD	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	986.124		Euroclear Triparty	3.153.267
	Euroclear Triparty	13.105.941			10.162.570
		14.092.065			
BNY Mellon Global Credit Fund		USD	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	4.845.957		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	19.659.961
	Euroclear Triparty	17.776.707			19.659.961
		22.622.664			
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund		USD	BNY Mellon Global Leaders Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	29.351.956		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	22.989
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.704.546			22.989
	Euroclear Triparty	355.923	BNY Mellon Global Opportunities Fund		USD
		31.412.425		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	341.595
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund		USD			341.595
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	242.961	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)		EUR
		242.961		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	94.348.455
BNY Mellon Global Equity Fund**		USD		Euroclear Triparty	101.841.615
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	9.852.183			196.190.070
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	5.136.561	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)		GBP
		14.988.744		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	347.707
BNY Mellon Global Equity Income Fund		USD			347.707
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	20.864.375	BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)		USD
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.466.072		Euroclear Triparty	1.667.804
		22.330.447			1.667.804
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund		USD	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.567.292		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	26.790.312
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	4.442.011		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.283.285

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

		39.441.995			Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
		67.515.592	Fonds	Sicherheitentreuhänder	
Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten			
BNY Mellon Global Unconstrained Fund		USD	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund		EUR
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	2.329.219		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	7.099.929
	Euroclear Triparty	207.590			7.099.929
		2.536.809	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund		USD
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund		JPY		The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	57.186
	The Bank of New York Mellon, Niederlassung London	635.645.454		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	3.670.312
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	52.536.422			3.727.498
		688.181.876			

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

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.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Art und Qualität der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2022:

Fund	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund	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 Fund			USD
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		9.333.856	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		62.878.204
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		6				62.878.204
			9.333.862	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			USD
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			GBP	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		40.512.805
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		4.643				40.512.805
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		172.001	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			USD
			176.644	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		408.895
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund			USD				408.895
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		6.158.271	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund			USD
Aktien	Anerkannte Aktienindizes		2.736.764	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		2.439.986
			8.895.035	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		86.013
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund			USD				2.525.999
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		2.074.592	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund			USD
			2.074.592	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		469.425
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund			USD	Aktien	Anerkannte Aktienindizes		10.128
Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade		181.736				479.553
			181.736				

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			USD	BNY Mellon Global Equity Fund**			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.350.891		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	9.832.293
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	47.779		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	5.156.451
			2.398.670				14.988.744
BNY Mellon Euroland Bond Fund			EUR	BNY Mellon Global Equity Income Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	27.060.390		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	21.182.059
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	18.261		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	1.148.388
			27.078.651				22.330.447
BNY Mellon European Credit Fund			EUR	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.576.822		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	10.162.554
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	24.244		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	16
			3.601.066				10.162.570
BNY Mellon Global Bond Fund			USD	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	14.092.044		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.769.797
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	21		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	15.890.164
			14.092.065				19.659.961
BNY Mellon Global Credit Fund			USD	BNY Mellon Global Leaders Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	20.572.427		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	22.989
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	2.050.237				22.989
			22.622.664	BNY Mellon Global Opportunities Fund			USD
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund			USD		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	341.595
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.483.382				341.595
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	28.929.043	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)			EUR
			31.412.425		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	111.733.102
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*			USD		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	84.456.968
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	242.961				196.190.070
			242.961				

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			GBP
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	347.707
			347.707
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.667.804
			1.667.804
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	67.303.030
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	212.562
			67.515.592
BNY Mellon Global Unconstrained Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	497.456
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	2.039.353
			2.536.809
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			JPY
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	574.892.393
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	113.289.483
			688.181.876
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			EUR
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	4.932.913
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	2.167.016
			7.099.929
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.670.312
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	57.186
			3.727.498

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

In den folgenden Tabellen sind die zehn wichtigsten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, per 31. Dezember 2022 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
Vereinigte Staaten von Amerika	4.026.704	Vereinigte Staaten von Amerika	124.935
French Republic	1.683.043	German Federal Republic	32.619
German Federal Republic	1.512.046	French Republic	19.518
European Investment Bank	1.021.595	European Investment Bank	1.510
Republic of Austria	457.485	Republic of Austria	1.340
Kingdom of the Netherlands	356.210	International Bank for Reconstruction & Development	1.113
Republic of Finland	237.781	Republic of Finland	299
Government of Canada	20.512	Kingdom of the Netherlands	248
International Bank for Reconstruction & Development	11.982	Commonwealth of Australia	79
European Union	5.889	Swiss Federation	49
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund[^]	USD
Glencore PLC	14.561	Vereinigte Staaten von Amerika	62.877.141
UnitedHealth Group Inc	13.277	French Republic	1.063
Rio Tinto PLC	12.894	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD
Compass Group PLC	12.714	Vereinigte Staaten von Amerika	23.031.106
Meta Platforms Inc	12.301	French Republic	11.734.452
AVEVA Group PLC	10.859	German Federal Republic	1.730.013
SSE PLC	10.812	European Investment Bank	1.057.250
BP PLC	9.773	Republic of Austria	860.561
Salesforce Inc	8.762	Republic of Finland	510.172
Citigroup Inc	8.005	Kingdom of Belgium	417.895
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	Kingdom of the Netherlands	379.263
Vereinigte Staaten von Amerika	6.082.037	Vereinigtes Königreich	341.152
Johnson & Johnson	247.061	Government of Canada	217.719
Pfizer Inc	163.942	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund[^]	USD
Fast Retailing Co Ltd	142.951	French Republic	170.937
Hitachi Ltd	133.786	Vereinigte Staaten von Amerika	156.581
JPMorgan Chase & Co	120.262	European Investment Bank	19.403
Marsh & McLennan Cos Inc	113.762	Republic of Austria	18.301
CME Group Inc	109.334	Republic of Finland	15.271
Mastercard Inc	108.945	German Federal Republic	15.004
KDDI Corp	107.932	Kingdom of the Netherlands	8.311
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	International Bank for Reconstruction & Development	5.086
Vereinigte Staaten von Amerika	1.304.618	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD
French Republic	293.104	Vereinigte Staaten von Amerika	124.935
German Federal Republic	161.865	German Federal Republic	32.619
Republic of Austria	107.570	French Republic	19.518
Kingdom of Belgium	75.785	European Investment Bank	1.510
Vereinigtes Königreich	58.141	Republic of Austria	1.340
Republic of Finland	26.160	International Bank for Reconstruction & Development	1.113
European Investment Bank	17.311	Republic of Finland	299
International Bank for Reconstruction & Development	13.037	Kingdom of the Netherlands	248
Kingdom of the Netherlands	11.581	Commonwealth of Australia	79
		Swiss Federation	49

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR
French Republic	1.249.344	French Republic	11.507.861
German Federal Republic	372.053	Vereinigte Staaten von Amerika	4.431.483
Norwegian Government	274.642	German Federal Republic	3.265.656
Republic of Austria	207.818	Republic of Austria	2.328.616
Kingdom of the Netherlands	180.345	European Investment Bank	1.942.930
Eurozone	86.013	Vereinigtes Königreich	1.140.815
International Bank for Reconstruction & Development	47.538	Kingdom of the Netherlands	1.120.642
European Investment Bank	41.261	Republic of Finland	721.912
Republic of Finland	31.571	International Bank for Reconstruction & Development	230.836
Inter-American Development Bank	26.682	Inter-American Development Bank	147.542
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	BNY Mellon European Credit Fund	EUR
French Republic	260.879	French Republic	1.926.430
German Federal Republic	56.932	German Federal Republic	575.266
Republic of Austria	42.771	Republic of Austria	271.757
Norwegian Government	32.339	Vereinigtes Königreich	234.468
Kingdom of the Netherlands	29.547	Kingdom of the Netherlands	150.718
Republic of Finland	18.988	Republic of Finland	120.298
European Investment Bank	13.115	Vereinigte Staaten von Amerika	78.182
International Bank for Reconstruction & Development	10.683	Norwegian Government	77.390
Eurozone	10.128	European Investment Bank	62.538
Inter-American Development Bank	3.142	International Bank for Reconstruction & Development	38.382
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	BNY Mellon Global Bond Fund	USD
French Republic	1.108.030	French Republic	7.572.262
Vereinigte Staaten von Amerika	359.854	Kingdom of the Netherlands	1.909.467
German Federal Republic	248.434	German Federal Republic	1.753.389
Republic of Austria	170.343	Republic of Austria	1.496.477
Norwegian Government	152.561	Republic of Finland	516.593
Kingdom of the Netherlands	125.114	Vereinigtes Königreich	332.114
Republic of Finland	63.350	European Investment Bank	236.807
European Investment Bank	61.869	Vereinigte Staaten von Amerika	142.344
Eurozone	47.779	International Bank for Reconstruction & Development	128.542
International Bank for Reconstruction & Development	41.664	Government of Canada	2.544

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD
French Republic	11.439.107	French Republic	10.396.282
German Federal Republic	4.622.745	Vereinigte Staaten von Amerika	8.143.993
Republic of Austria	2.333.111	German Federal Republic	2.360.251
Kingdom of the Netherlands	813.615	Kingdom of the Netherlands	239.183
Republic of Finland	647.894	Salesforce Inc	89.849
Government of Canada	274.760	Enphase Energy Inc	48.075
Vereinigte Staaten von Amerika	237.037	Baxter International Inc	42.683
Amazon.com Inc	205.018	Kingdom of Sweden	42.351
Johnson & Johnson	205.018	Raytheon Technologies Corp	38.004
Microsoft Corp	205.017	Activision Blizzard Inc	37.985
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD
Shell PLC	2.521.884	Vereinigte Staaten von Amerika	6.308.613
BP PLC	2.346.143	French Republic	1.309.573
Sanofi	1.890.616	German Federal Republic	721.399
HSBC Holdings PLC	1.873.440	Republic of Austria	471.490
Glencore PLC	1.872.701	European Investment Bank	427.399
Vereinigte Staaten von Amerika	1.767.080	Vereinigtes Königreich	270.806
British American Tobacco PLC	1.101.988	Kingdom of the Netherlands	259.444
Vodafone Group PLC	999.935	Republic of Finland	214.900
Lloyds Banking Group PLC	880.386	Kingdom of Belgium	159.080
STMicroelectronics NV	619.751	International Bank for Reconstruction & Development	17.690
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	BNY Mellon Global Infrastructure Income Funds	USD
Salesforce Inc	19.009	French Republic	2.462.617
Enphase Energy Inc	10.171	Salesforce Inc	829.315
Baxter International Inc	9.030	German Federal Republic	703.651
Raytheon Technologies Corp	8.040	Visa Inc	690.922
Activision Blizzard Inc	8.036	Volkswagen AG	519.533
Exxon Mobil Corp	7.996	Rio Tinto PLC	433.308
TransDigm Group Inc	7.072	Enphase Energy Inc	365.368
Hewlett Packard Enterprise Co	6.304	Vereinigte Staaten von Amerika	326.120
Rio Tinto PLC	5.898	Baxter International Inc	324.392
Biogen Inc	5.784	Exxon Mobil Corp	296.501
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	BNY Mellon Global Leaders Fund^	USD
Vereinigte Staaten von Amerika	4.497.683	French Republic	17.838
French Republic	4.068.651	German Federal Republic	4.602
German Federal Republic	647.778	Kingdom of the Netherlands	466
Kingdom of the Netherlands	608.711	Kingdom of Sweden	83
Alphabet Inc	517.523	BNY Mellon Global Opportunities Fund^	USD
Nintendo Co Ltd	513.656	French Republic	150.436
Toyota Motor Corp	513.656	Vereinigte Staaten von Amerika	140.972
Nippon Telegraph & Telephone Corp	405.036	Kingdom of the Netherlands	41.293
Sony Group Corp	314.401	German Federal Republic	8.894
Recruit Holdings Co Ltd	248.094		

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	72.138.547	French Republic	348.024
German Federal Republic	18.903.324	Sanofi	148.567
BP PLC	7.204.559	BP PLC	143.858
Republic of Austria	6.738.228	HSBC Holdings PLC	128.904
Howmet Aerospace Inc	5.066.717	Shell PLC	121.463
Vereinigte Staaten von Amerika	4.318.273	British American Tobacco PLC	84.916
Kingdom of the Netherlands	3.718.531	German Federal Republic	79.233
Reckitt Benckiser Group PLC	3.575.662	Vodafone Group PLC	78.576
Republic of Finland	3.165.958	Glencore PLC	68.399
STMicroelectronics NV	3.069.206	Lloyds Banking Group PLC	65.182
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)^	GBP	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY
French Republic	269.799	French Republic	159.303.150
German Federal Republic	69.605	Vereinigte Staaten von Amerika	148.550.429
Kingdom of the Netherlands	7.054	Kingdom of Belgium	106.557.875
Kingdom of Sweden	1.249	Vereinigtes Königreich	81.749.037
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	Kingdom of the Netherlands	48.130.748
Vereinigte Staaten von Amerika	788.936	German Federal Republic	30.074.937
French Republic	477.028	Visa Inc	9.408.722
German Federal Republic	171.244	Volkswagen AG	8.347.991
European Investment Bank	103.126	Alphabet Inc	5.269.837
Republic of Austria	59.078	Nintendo Co Ltd	5.253.642
International Bank for Reconstruction & Development	38.481	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR
Republic of Finland	20.986	Vereinigte Staaten von Amerika	3.719.187
Kingdom of the Netherlands	6.265	German Federal Republic	595.647
Swiss Federation	1.730	French Republic	548.466
Commonwealth of Australia	627	Glencore PLC	111.754
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	Visa Inc	76.551
French Republic	21.788.069	SSE PLC	72.206
European Investment Bank	10.881.293	Salesforce Inc	67.647
German Federal Republic	9.547.654	Volkswagen AG	63.917
Vereinigte Staaten von Amerika	7.804.222	Rio Tinto PLC	62.414
Republic of Austria	5.885.574	Roche Holding AG	53.233
Kingdom of the Netherlands	3.697.414	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD
Republic of Finland	2.475.720	Vereinigte Staaten von Amerika	3.670.312
Commonwealth of Australia	2.432.257	Glencore PLC	5.719
International Bank for Reconstruction & Development	1.265.948	Roche Holding AG	5.719
Norwegian Government	678.550	Marathon Petroleum Corp	5.719
		Shell PLC	5.317
		Safran SA	4.435
		Barclays PLC	3.561
		Prudential PLC	3.553
		Capgemini SE	3.428
		SSE PLC	3.128

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

^ Wenn zum 31. Dezember 2022 weniger als zehn Sicherheitengeber vorhanden waren, wurden alle Emittenten einbezogen.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Währungen der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2022:

Fund	währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund	währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund		EUR	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund		USD
Kanadischer Dollar		98	Australischer Dollar		79
Euro		5.281.857	Euro		55.471
Schwedische Krone		29	Pfund Sterling		1.201
Schweizer Franken		76	Schweizer Franken		50
US-Dollar		4.051.802	US-Dollar		124.935
		9.333.862			181.736
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		GBP	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund		USD
Euro		6.891	Euro		1.063
Japanischer Yen		19.611	US-Dollar		62.877.141
Pfund Sterling		79.418			62.878.204
Schwedische Krone		17	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund		USD
Schweizer Franken		3.267	Australischer Dollar		3.891
US-Dollar		67.440	Kanadischer Dollar		28
		176.644	Euro		16.753.839
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund		USD	Neuseeländischer Dollar		217
Euro		313.121	Pfund Sterling		383.902
Japanischer Yen		888.913	Schwedische Krone		311
Pfund Sterling		91.388	Schweizer Franken		2.548
Schweizer Franken		185.663	US-Dollar		23.368.069
US-Dollar		7.415.950			40.512.805
		8.895.035	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund		USD
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund		USD	Euro		249.631
Australischer Dollar		3.718	US-Dollar		159.264
Kanadischer Dollar		16			408.895
Euro		694.365			
Pfund Sterling		71.333			
Schweizer Franken		542			
US-Dollar		1.304.618			
		2.074.592			

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR
Dänische Krone	850	Australischer Dollar	118.819
Euro	2.127.143	Kanadischer Dollar	2.568
Norwegische Krone	292.317	Dänische Krone	180
Pfund Sterling	17.176	Euro	20.867.165
Schwedische Krone	8.768	Neuseeländischer Dollar	234
Schweizer Franken	6.084	Norwegische Krone	65.743
US-Dollar	73.661	Pfund Sterling	1.297.525
	2.525.999	Schwedische Krone	19.620
		Schweizer Franken	5.640
		US-Dollar	4.701.157
			27.078.651
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	BNY Mellon European Credit Fund	EUR
Dänische Krone	100	Australischer Dollar	2.121
Euro	429.905	Dänische Krone	240
Norwegische Krone	34.420	Euro	3.132.371
Pfund Sterling	2.023	Norwegische Krone	82.371
Schwedische Krone	1.032	Pfund Sterling	238.105
Schweizer Franken	717	Schwedische Krone	2.512
US-Dollar	11.356	Schweizer Franken	1.816
	479.553	US-Dollar	141.530
			3.601.066
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	BNY Mellon Global Bond Fund	USD
Dänische Krone	472	Australischer Dollar	364
Euro	1.809.208	Kanadischer Dollar	2.544
Norwegische Krone	162.380	Euro	13.533.190
Pfund Sterling	9.542	Pfund Sterling	354.902
Schwedische Krone	4.871	Schweizer Franken	1.004
Schweizer Franken	3.378	US-Dollar	200.061
US-Dollar	408.819		
	2.398.670		14.092.065

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD
Australischer Dollar	46.947	Euro	13.042.119
Kanadischer Dollar	204	Japanischer Yen	50.624
Euro	20.012.344	Pfund Sterling	32.704
Schwedische Krone	393	Schwedische Krone	42.350
Schweizer Franken	1.004	US-Dollar	9.162.650
US-Dollar	2.561.772		22.330.447
	22.622.664	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	Kanadischer Dollar	65
Euro	4.753.786	Euro	3.574.273
Japanischer Yen	4.974.793	Pfund Sterling	270.044
Pfund Sterling	18.680.233	US-Dollar	6.318.188
Schweizer Franken	586.887		10.162.570
US-Dollar	2.416.726	BNY Mellon Global Infrastructure income Fund	USD
	31.412.425	Euro	4.847.556
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*	USD	Japanischer Yen	1.210.744
Euro	9.817	Pfund Sterling	2.045.266
Japanischer Yen	10.711	Schwedische Krone	5.512
Pfund Sterling	6.919	Schweizer Franken	215.300
US-Dollar	215.514	US-Dollar	11.335.583
	242.961		19.659.961
BNY Mellon Global Equity Fund**	USD	BNY Mellon Global Leaders Fund	USD
Euro	6.210.393	Euro	22.906
Japanischer Yen	3.273.998	Schwedische Krone	83
Pfund Sterling	79.962		22.989
Schwedische Krone	9.471	BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD
Schweizer Franken	172.580	Euro	200.623
US-Dollar	5.242.340	US-Dollar	140.972
	14.988.744		341.595

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fund währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD
Australischer Dollar	89.825	Australischer Dollar	2.475.595
Kanadischer Dollar	139	Kanadischer Dollar	737
Euro	117.638.490	Dänische Krone	2.101
Japanischer Yen	29.458.902	Euro	52.583.702
Neuseeländischer Dollar	20	Neuseeländischer Dollar	500
Pfund Sterling	32.753.576	Norwegische Krone	833.192
Schwedische Krone	35.530	Pfund Sterling	1.703.555
Schweizer Franken	2.164.859	Schwedische Krone	537.872
US-Dollar	14.048.729	Schweizer Franken	15.027
	196.190.070	US-Dollar	9.363.311
			67.515.592
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD
Euro	346.459	Australischer Dollar	2.534
Schwedische Krone	1.248	Euro	814.085
	347.707	Pfund Sterling	1.114.481
		Schwedische Krone	1.041
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	Schweizer Franken	46.117
Australischer Dollar	627	US-Dollar	558.551
Kanadischer Dollar	19		2.536.809
Euro	834.315		
Pfund Sterling	42.175		
Schweizer Franken	1.731		
US-Dollar	788.937		
	1.667.804		

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund wahrung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY
Kanadischer Dollar	7.529
Euro	367.176.421
Japanischer Yen	35.164.523
Pfund Sterling	89.640.832
Schwedische Krone	518.711
Schweizer Franken	2.248.706
US-Dollar	193.425.154
	688.181.876
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR
Euro	1.502.350
Japanischer Yen	183.552
Pfund Sterling	607.758
Schwedische Krone	305
Schweizer Franken	105.378
US-Dollar	4.700.586
	7.099.929
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD
Euro	15.616
Japanischer Yen	2.051
Pfund Sterling	22.962
Schweizer Franken	7.728
US-Dollar	3.679.141
	3.727.498

* Siehe Erluterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erluterung 20 zum Abschluss.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Wertpapierleihgeschäften und den entgegengenommenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022:

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.

Fund	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 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	-	-	-	-	-	9.018.528	-	9.018.528
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	7.578	15.452	507.137	8.803.689	6	9.333.862
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2	160.665	160.667
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	181	66	4.396	172.001	176.644
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	8.112.634	8.112.634
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	10.745	24.335	191.885	5.931.306	2.736.764	8.895.035
BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1.979.912	-	1.979.912
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	11.361	87.030	1.976.201	-	2.074.592
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	173.391	-	173.391
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	199	3.528	178.009	-	181.736
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	61.324.891	5.769	61.330.660
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	7.281	88.306	310.823	62.471.795	-	62.878.204
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	38.759.960	-	38.759.960
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	108.247	177.010	3.136.275	37.091.273	-	40.512.805

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Unbefristet	Gesamt
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	389.675	-	389.675
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	4.341	2.682	29.373	372.500	-	408.895
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.301.930	-	2.301.930
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	-	110.767	170.860	2.158.359	86.013	2.525.999
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	444.437	-	444.437
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	4.341	15.724	39.051	410.308	10.128	479.553
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.231.278	-	2.231.278
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	13.023	69.575	164.989	2.103.304	47.779	2.398.670
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	195.368	26.066.774	-	26.262.142
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	18.362	173.333	2.561.769	24.306.926	18.261	27.078.651
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	3.495.133	-	3.495.133
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	20.813	61.907	364.019	3.130.083	24.244	3.601.066
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	13.777.377	-	13.777.377
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	97.904	94.907	1.013.857	12.885.375	21	14.092.065
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	21.907.141	-	21.907.141
Erhaltene Sachsi- cherheiten	-	-	267	304.516	2.803.074	17.464.571	2.050.237	22.622.664

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Unbefristet	Gesamt
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	6.914.369	21.788.433	-	28.702.803
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	331	42.274	2.440.777	28.929.043	31.412.425
BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund*								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	218.075	218.075
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	-	-	-	242.961	242.961
BNY Mellon Global Equity Fund**								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1	13.833.763	13.833.764
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	205.661	496.892	9.129.740	5.156.451	14.988.744
BNY Mellon Global Equity Income Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	1	21.197.933	21.197.934
Erhaltene Sachsicherheiten	-	60.822	67.275	502.610	620.250	19.931.101	1.148.388	22.330.447
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	411.058	9.402.570	-	9.813.629
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	14.259	10.510	335.711	9.802.074	16	10.162.570
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	17.647.178	17.647.178
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	609	350.157	3.419.030	15.890.164	19.659.961
BNY Mellon Global Leaders Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	21.881	21.881
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	898	328	21.763	-	22.989
BNY Mellon Global Opportunities Fund								
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	318.824	318.824
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	4.334	34.159	303.101	-	341.595

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fund	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 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	-	-	-	41.156.135	35.376.251	99.702.497	9.414.703	185.649.586
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	661.612	1.690.842	7.567.764	101.812.884	84.456.968	196.190.070
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	330.947	330.947
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	13.587	4.956	329.164	-	347.707
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	982.567	-	592.334	-	1.574.901
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	640	100.268	1.566.896	-	1.667.804
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	1.008	65.272.410	-	65.273.418
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	143.789	640.836	4.965.440	61.552.965	212.562	67.515.592
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	2.057.429	275.894	2.333.323
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	19.226	18.445	459.785	2.039.353	2.536.809
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	(209)	642.605.583	642.605.374
Erhaltene Sachsicherheiten	-	198.676	70.531	3.358.199	51.587.804	519.677.182	113.289.483	688.181.876
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	6.556.860	6.556.860
Erhaltene Sachsicherheiten	-	48.208	48.208	11.651	149.178	4.675.669	2.167.016	7.099.929
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	-	-	-	-	-	-	3.635.332	3.635.332
Erhaltene Sachsicherheiten	-	-	-	12.274	3.040.971	617.066	57.186	3.727.498

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Siehe Erläuterung 20 zum Abschluss.

TRANSAKTIONEN MIT AKTIENSWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS

Die nachfolgenden Tabellen enthalten ausführliche Angaben zum gesamten Brutto-Nominalvolumen von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps sowie den absoluten beizulegenden Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Gegenparteien, zum 31. Dezember 2022:

Fund	Kontrahent	Gründungsland	Gesamter Bruttonominalwert	Absoluter beizulegender Zeitwert	% des Nettoinventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			EUR	EUR	
	Bank of America Merrill Lynch	Vereinigtes Königreich	115.099	115.099	0,03
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	21.086	21.086	0,01
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	584.932	584.932	0,17
	Gesamt		721.117	721.117	0,22
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			GBP	GBP	
	Bank of America Merrill Lynch	Vereinigtes Königreich	83.004.643	5.648.447	4,04
	Barclays Bank PLC	Vereinigtes Königreich	65.017.849	2.616.829	1,87
	JPMorgan Chase Bank	Vereinigte Staaten von Amerika	73.389.099	3.603.456	2,58
	Morgan Stanley	Vereinigtes Königreich	19.021.258	1.838.256	1,32
	Gesamt		240.432.849	13.706.988	9,81
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			EUR	EUR	
	BNP Paribas	Vereinigte Staaten von Amerika	79.012.416	16.679.108	14,74
	Gesamt		79.012.416	16.679.108	14,74
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund			USD	USD	
	Goldman Sachs	Vereinigte Staaten von Amerika	32.571.908	155.236	0,67
	Gesamt		32.571.908	155.236	0,67

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse der Währungen der vom Fonds im Rahmen von offenen Derivatgeschäften vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 31. Dezember 2022:

Fund	währung	Erhaltene Barsicherheiten	Gestellte Barsicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		GBP	GBP
	Pfund Sterling	2.918.635	-
		2.918.635	-
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund		EUR	EUR
	Euro	-	(540.000)
		-	(540.000)

TRANSAKTIONEN MIT AKTIENSWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps (Nettoengagement) und der in diesem Zusammenhang entgegengenommenen/gestellten Sicherheiten zum 31. Dezember 2022:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der offenen Derivate.

Fund	Unter 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 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
Total Return Swaps	-	-	-	-	721.117	-	-	721.117
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Aktienindex-Swaps	-	-	379.924	-	(667.402)	-	-	(287.478)
Aktien-Swaps	-	-	484.535	-	2.784.356	-	-	3.268.891
Erhaltene Barsicherheiten	2.918.635							2.918.635
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien-Swaps	-	-	-	(1.213)	4.537.161	-	-	4.535.948
Total Return Swaps (Gestellte)	-	-	-	(4.400)	(4.293.160)	(1.203.133)	-	(5.500.693)
Barsicherheiten	(540.000)							(540.000)
BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Aktien-Swaps	-	-	-	-	83.918	-	-	83.918

ANHANG IV

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: [213800550EJY18WPBT81](#)

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

●● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 73,4 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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 eine Auflistung von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt? [Führen Sie die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale an. Für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit Umweltzielen führen Sie die in Artikel 9 dieser Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Anlage beigetragen hat. Für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen mit sozialen Zielen getätigt wurden, führen Sie bitte die sozialen Ziele an.]

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 30. September 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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
- Eine Investition 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.

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Schwach
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	Qualitative Fallstudien für die 5 Top-Positionen im Fonds (nach Gewichtung) sind nachstehend beigefügt
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 5	Qualitative Fallstudien für die 5 Top-Positionen im Fonds (nach Gewichtung) sind nachstehend beigefügt

#	Bestand	Gewichtung im Teilfonds (%) zum 31. Dez. 2022	Nachhaltigkeitsindikator	Thematische Begründung für Nachhaltigkeit
1	SAP SE	5,16	Innovation in der Lieferkette, wie durch qualitative Fallstudien belegt.	SAP entwickelt Blockchain-gestützte Lösungen für Unternehmen zur Förderung der Effizienz/Nachhaltigkeit von Lieferketten und zur Nachverfolgung, Messung und Reduzierung von CO2-Fussabdruck/-Emissionen.
2	Universal Music Group N.V.	5,03	Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.	Die Produkte und Dienstleistungen von UMG werden als sozial nachhaltig erachtet, weil Forschungsergebnisse darauf hinweisen, dass Musik einen starken positiven Einfluss auf Menschen ausübt. Sie kann das Gedächtnis anregen, die Ausdauer bei der Arbeit steigern, die Stimmung aufhellen, Ängste und Depressionen lindern, Müdigkeit vertreiben, die Schmerzempfindlichkeit dämpfen und Menschen helfen, sich effektiver zu bewegen. Die Nutzung von Non-Fungible Tokens (NFTs) trägt zu diesem Thema bei, indem sie besseren Zugang zu diesen Vorzügen ermöglicht und Abfall vermindert, weil sie digitale anstelle physischer Sammelobjekte bietet. Die Direct-to-

				Consumer-NFT-Option von UMG hat das Potenzial, aus der Monetisierung im Zusammenhang mit Blockchain/Metaversum (Konzerte, Merchandising, Musik usw.) in 5 Jahren 5 bis 15 % Umsatz zu generieren.
3	Block, Inc. Klasse A	4,19	Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.	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.
4	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	4,17	Innovation in der Lieferkette, wie durch qualitative Fallstudien belegt.	LVMH entwickelte mit Prada und Cartier die Blockchain-Plattform AURA, um über die gesamte Lieferkette Rohstoffe verantwortungsbewusst und ethisch einwandfrei zu beschaffen und rückzuverfolgen.
5	WisdomTree, Inc.	3,80	Zugang zu verbesserter digitaler Sicherheit und ein verbesserter Zugang zu und Effizienz von digitalen Dienstleistungen weltweit, was durch qualitative Fallstudien belegt werden kann.	Wisdomtree tokenisiert Fonds in der Absicht, Anlegern mehr Liquidität und niedrigere Kosten zu bieten. Wisdomtree ist mit 20 % an Securrency beteiligt, das eine Technologie entwickelt hat, um sicherzustellen, dass digitale Transaktionen auf öffentlichen Blockchains aus aufsichtsrechtlicher Perspektive (AML/KYC) vorschriftskonform sind, was die mit digitalen Vermögenswerten einhergehenden Compliance-Probleme lösen soll. WisdomTree, Inc. ist ausserdem ein Unterzeichner der UN-PRI.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 91,88 % des Teilfonds. Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 95 % des Teilfonds.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?** *[bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

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?** *[Beschreiben Sie die Ziele für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen getätigt wurden, sofern diese nicht in der Antwort auf die vorstehende Frage enthalten sind. Beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Listen Sie für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte die in Artikel 9 der Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Investition beigetragen hat.]*

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 nicht zu 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 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? [Fügen Sie dies bei Finanzprodukten hinzu, die nachhaltige Investitionen enthalten.]

Der Anlageverwalter ermittelte, ob die nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR des Teilfonds die Umweltziele oder sozialen Ziele nicht erheblich 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

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.

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? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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 dritten 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?

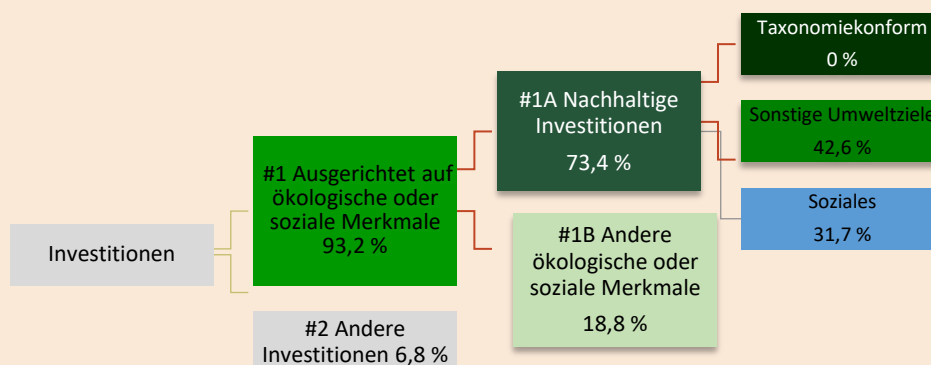
#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	SAP SE EUR NPV	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	5,14	Deutschland
2	UNIVERSAL MUSIC GR EUR 10	Kommunikationsdienstleistungen - Medien und Unterhaltung	5,02	Niederlande
3	BLOCK INC USD 0.0000001	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	4,16	USA
4	LVMH MOET HENNESS EUR 0.3	Nicht-Basiskonsumgüter - Gebrauchsgüter und Bekleidung	4,16	Frankreich
5	WisdomTree Inc USD 0.01	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	3,78	USA
6	ACCENTURE P USD 0.0000225	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3,76	USA
7	SIEMENS AG-SP USD NPV ADR	Industrie - Investitionsgüter	3,75	USA
8	MERCEDES-BENZ GRO EUR NPV	Nicht-Basiskonsumgüter - Autos und Autoteile	3,73	Deutschland
9	KERING EUR 4	Nicht-Basiskonsumgüter - Gebrauchsgüter und Bekleidung	3,59	Frankreich
10	NASDAQ INC USD 0.01	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	3,48	USA
11	ASX LTD AUD NPV	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	3,46	Australien
12	SBI HOLDINGS INC JPY NPV	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	3,19	Japan
13	NATIONAL BANK HOL USD NPV	Finanzen - Banken	3,09	USA
14	NVIDIA CORP USD 0.001	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausüstung	2,88	USA
15	BAYCURRENT CONSUL JPY NPV	Industrie - Gewerbliche und berufliche Dienstleistungen	2,76	Japan

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
30. September 2022
- 31. Dezember 2022



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



Bezugszeitraum: 30. September 2022 – 31. Dezember 2022

#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.

[Fügen Sie den nachstehenden Hinweis ein, wenn mit dem Finanzprodukt nachhaltigen Investitionen getätigt wurden.]

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.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 93,2 % 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 73,4 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR. Davon hatten 41,7 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 31,7 % ein soziales Ziel. 0 % des Nettoinventarwerts des

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **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.

Teilfonds wurden in mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale: 93,2 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 73,4 % des Nettoinventarwerts

- Taxonomiekonform: 0 % des Nettoinventarwerts

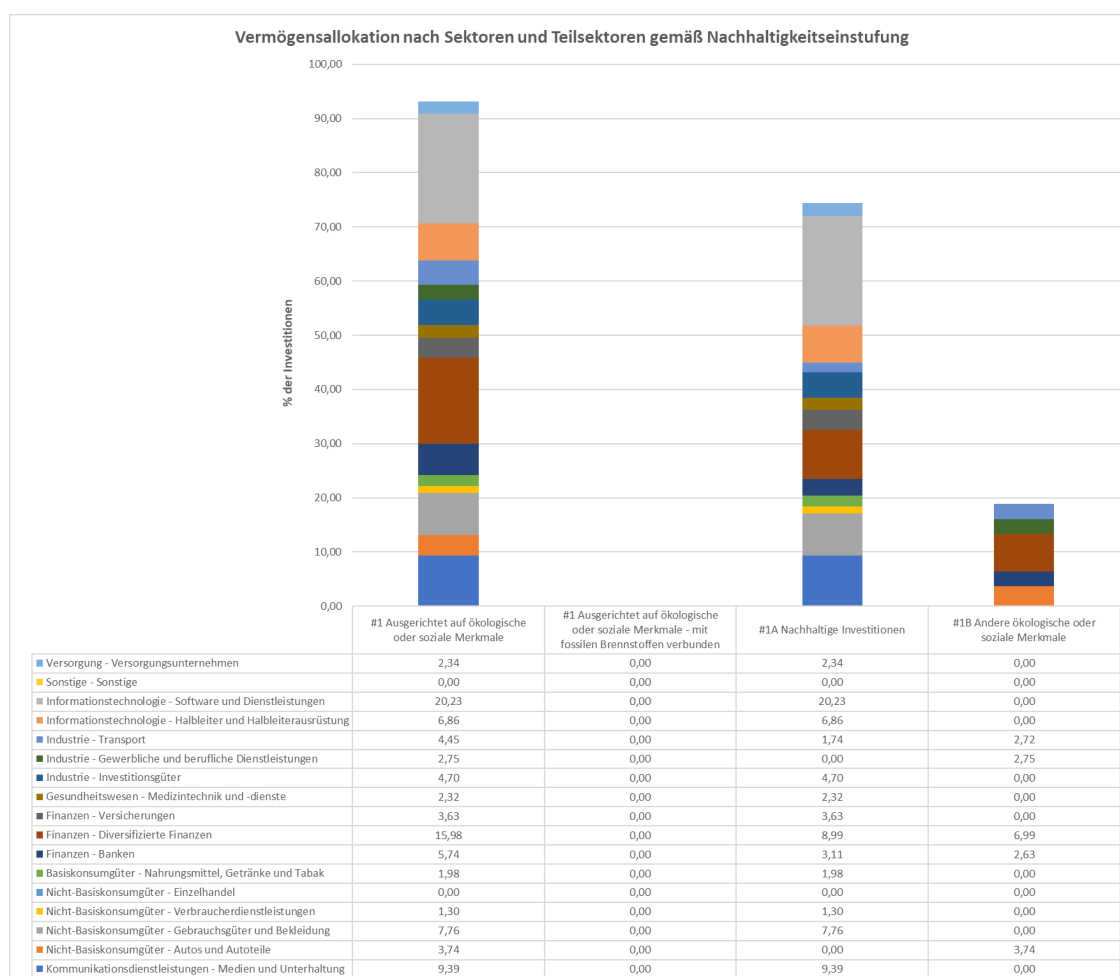
- Umwelt: 41,7 % des Nettoinventarwerts

- Soziales: 31,7 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 18,8 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 6,8 % des Nettoinventarwerts

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform? [Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 51 dieser Verordnung ein.]

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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: [Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]

In fossiles Gas In Kernenergie


Nein

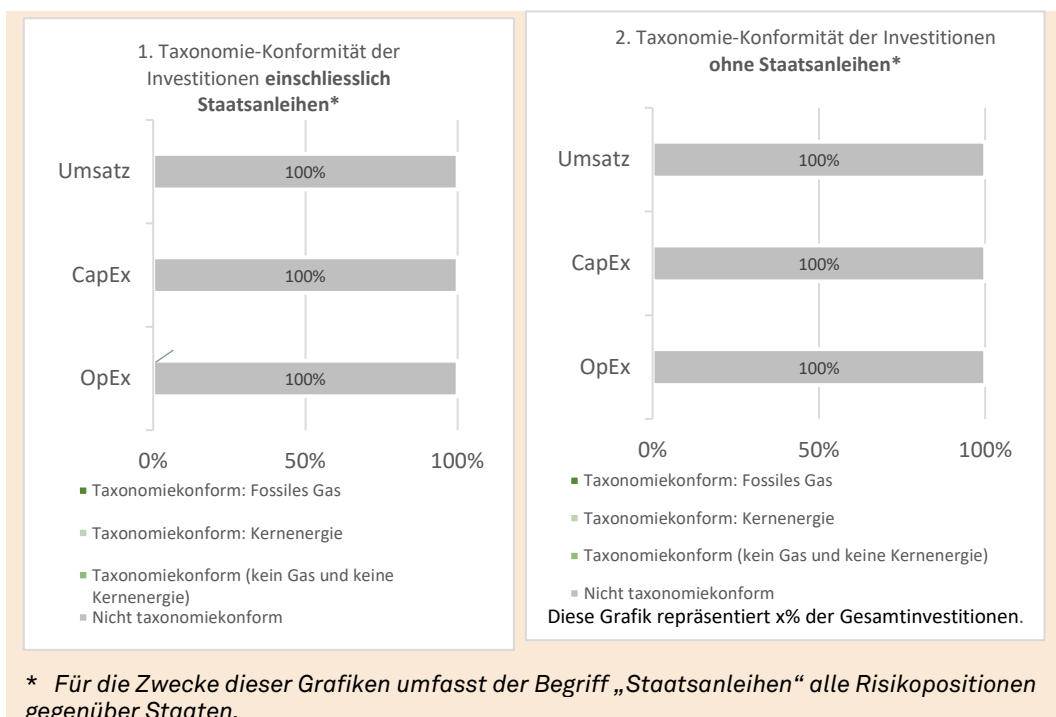
In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]

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.

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]

 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 Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind? [Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]

0,00 %

- Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt? [Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]

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?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

Der Teilfonds investierte 42,6 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel, durch die in nicht mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger

Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel enthalten hat.]*

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 31,7 % 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 6,82 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

- 1) 4,87 % 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.
- 2) 1,95 % in ein Unternehmen, bei dem der Anlageverwalter nach Aufnahme von Kontakten feststellte, dass es nicht mehr seinen ESG- und Nachhaltigkeitskriterien entsprach. Die Position wurde anschliessend abgestossen. Bis zur Entscheidung, die Position zu veräussern, wurde das Unternehmen als eines erachtet, das den ökologischen und sozialen Mindestschutz des Anlageverwalters erfüllte.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen? *[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erfüllung der*

mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.]

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.

Mitwirkung ist nicht 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 Referenzwert abgeschnitten?

[Fügen Sie den Abschnitt ein, wenn ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde, und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]

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

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

ANHANG IV

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 U.S. 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 ___% 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 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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



Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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 eine Auflistung von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst eine Auflistung der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

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.

● **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:

- **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:
 - Die mehr als 30 % ihres Umsatzes mit Teersanden oder Kraftwerkskohle erzielten
 - Bei denen der Anlageverwalter davon ausging, dass sie gemäss der Daten Dritter über ein negatives Rating in Bezug auf wesentliche Umweltkriterien verfügen
 - Die umstrittene Waffen herstellen, oder
 - die gemäss Daten Dritter unter ein vorgegebenes Umweltrating fielen, wenn dieses Umweltrating vom Anlageverwalter als relevant angesehen wurde, oder die gemäss 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).

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
 - Bei denen der Anlageverwalter davon ausging, dass sie gemäss der Daten Dritter über ein negatives Rating in Bezug auf wesentliche Umweltkriterien verfügen
 - Die umstrittene Waffen herstellten, oder
 - die gemäss Daten Dritter unter ein vorgegebenes Umweltrating fielen, wenn dieses Umweltrating vom Anlageverwalter als relevant angesehen wurde, oder die gemäss 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).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Zum 31. Dezember 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.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. 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 nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigt?***

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? Nähere Angaben:

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 Teilfonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren im Bezugszeitraum nicht.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	VODAFONE VAR 04/04/79	Telekommunikation	2,38	Vereinigtes Königreich
2	United Re 3.875% 11/15/27	Investitionsgüter	2,00	Vereinigte Staaten
3	Perrigo F 4.375% 03/15/26	Gesundheitswesen	1,75	Vereinigte Staaten
4	Office Pr 4.5% 02/01/25	Immobilien	1,74	Vereinigte Staaten
5	PERRIGO F 3.9% 12/15/24	Gesundheitswesen	1,72	Vereinigte Staaten
6	Perrigo F 4.4% 06/15/30	Gesundheitswesen	1,71	Vereinigte Staaten
7	Royal Ca 11.5% 06/01/25	Konsumgüter	1,53	Vereinigte Staaten
8	Royal Ca 10.875% 06/01/23	Konsumgüter	1,49	Vereinigte Staaten
9	Steelcase 5.125% 01/18/29	Industrie	1,37	Vereinigte Staaten
10	Sprint Ca 6.875% 11/15/28	Telekommunikation	1,29	Vereinigte Staaten
11	LAS VEGAS 3.2% 08/08/24	Konsumgüter	1,29	Vereinigte Staaten
12	Howmet Ae 5.125% 10/01/24	Grundstoffe	1,28	Vereinigte Staaten

13	Sands Chi 5.9% 08/08/28	Konsumgüter	1,28	Macau
14	NORDSTROM 5% 01/15/44	Konsumgüter	1,25	Vereinigte Staaten
15	Rolls-Roy 3.625% 10/14/25	Investitionsgüter	1,22	Vereinigtes Königreich



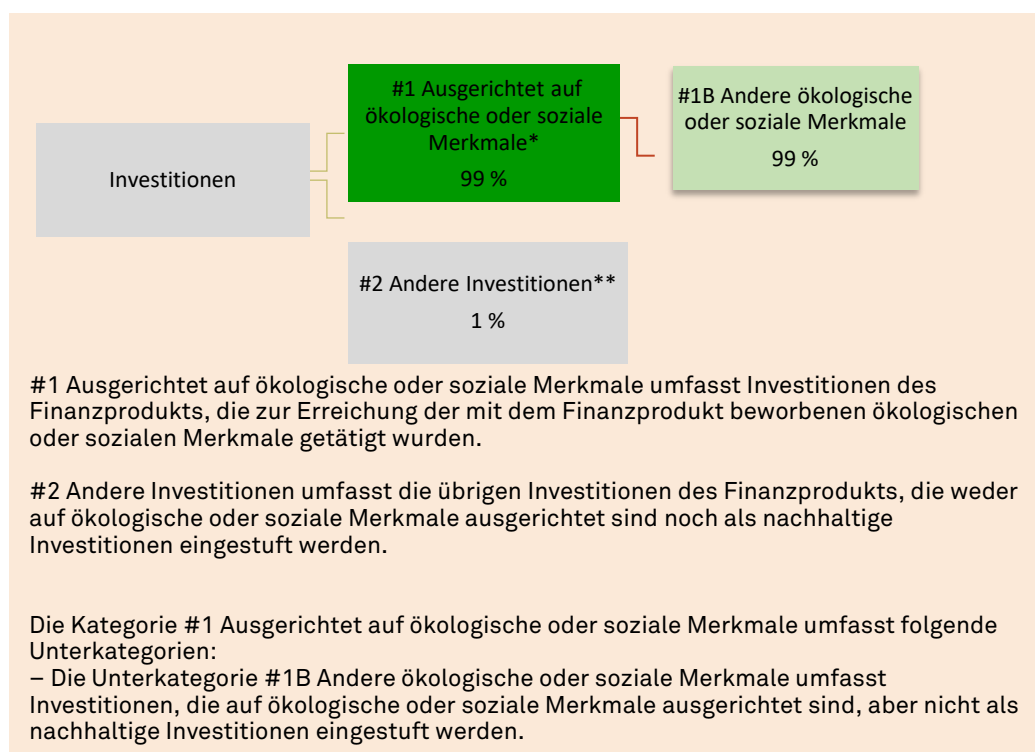
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *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 2022 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 bestimmten Vermögenswerten an.



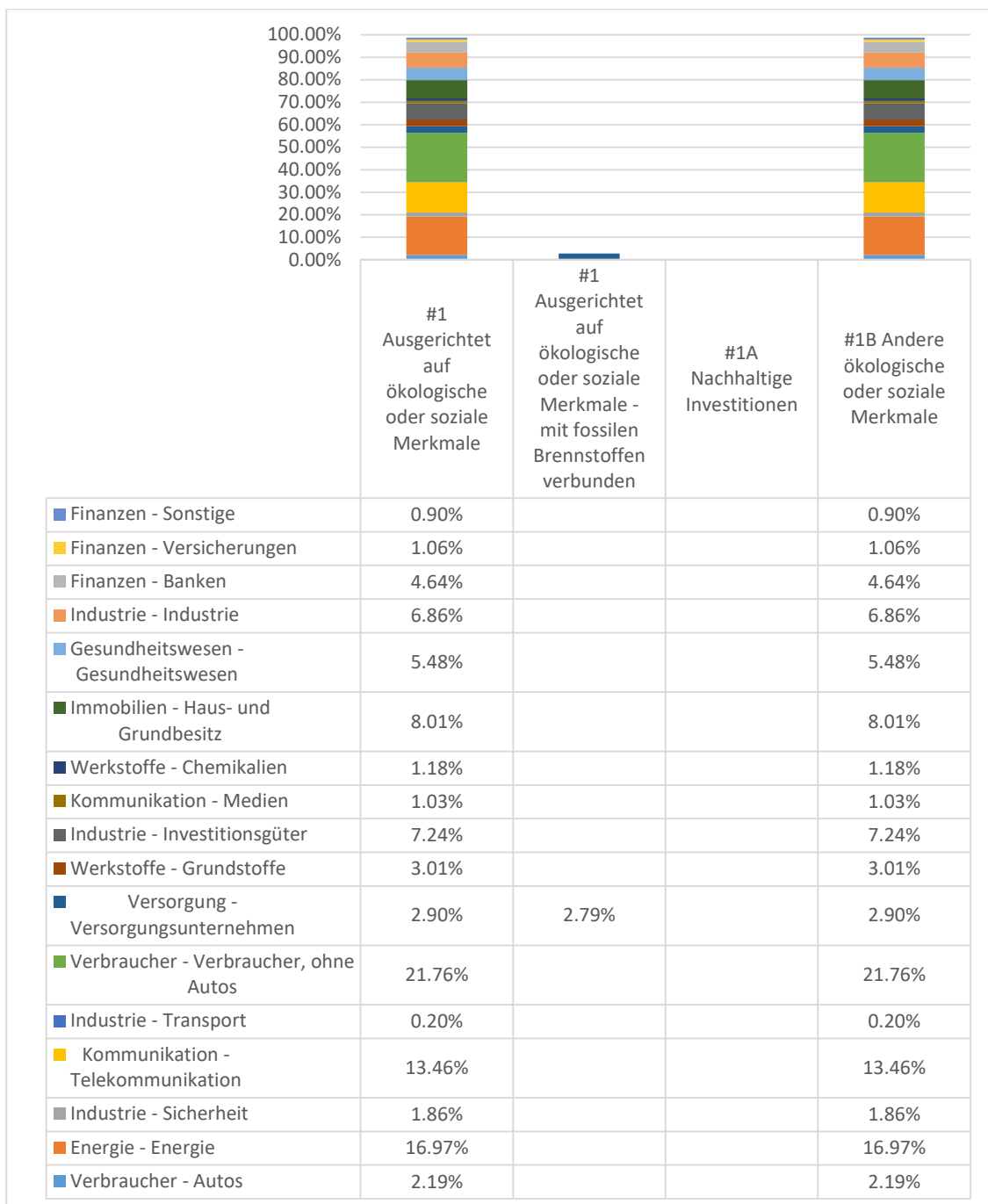
* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können.

** #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 2022 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Konsumgüter und Energie engagiert sowie in den Sektoren Telekommunikation und Immobilien, wie nachstehend dargestellt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **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.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. 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-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

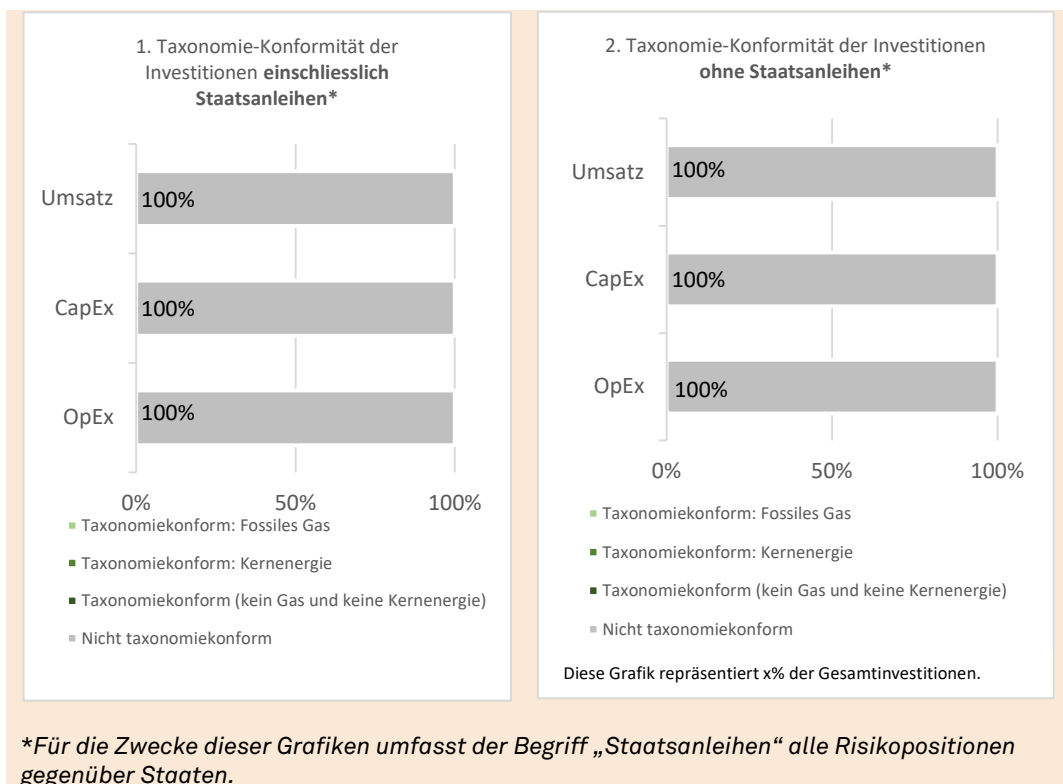
- Ja:
- In fossilem Gas In Kernenergie
- Nein

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 EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In den nachstehenden Diagrammen 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 Taxonomiekonformität 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.*

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



● **Wie hoch war 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.




Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



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 auch die folgenden internen Kontrollmechanismen, um zu überwachen, ob der Teilfonds die einprogrammierten verbindlichen Elemente im Bezugszeitraum beachtete:
 - 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 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?

Nicht zutreffend.



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.

ANHANG V

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: [213800QE71BVU06AGO26](#)

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein
<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 98,4 %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht? [Führen Sie das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts an und beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Für die in Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte geben Sie in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel die in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele an, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende Investition beigetragen hat. Geben Sie für die in Artikel 9 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Finanzprodukte an, wie das Ziel einer Reduzierung der CO₂-Emissionen auf das Übereinkommen von Paris abgestimmt wurde.]

[Führen Sie das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts an und beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Für die in Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte geben Sie in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel die in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele an, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende Investition beigetragen hat. Geben Sie für die in Artikel 9 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Finanzprodukte an, wie das Ziel einer Reduzierung der CO₂-Emissionen auf das Übereinkommen von Paris abgestimmt wurde.]

Mit Nachhaltigkeits-indikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 31. Mai 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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 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:

- 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.

● **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 Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Mittel

Nachhaltigkeitsindikator 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 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 96 % 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.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen? [Bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde.]

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

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.

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?

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 Drittdatenanbieter. 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? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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 dritten 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?

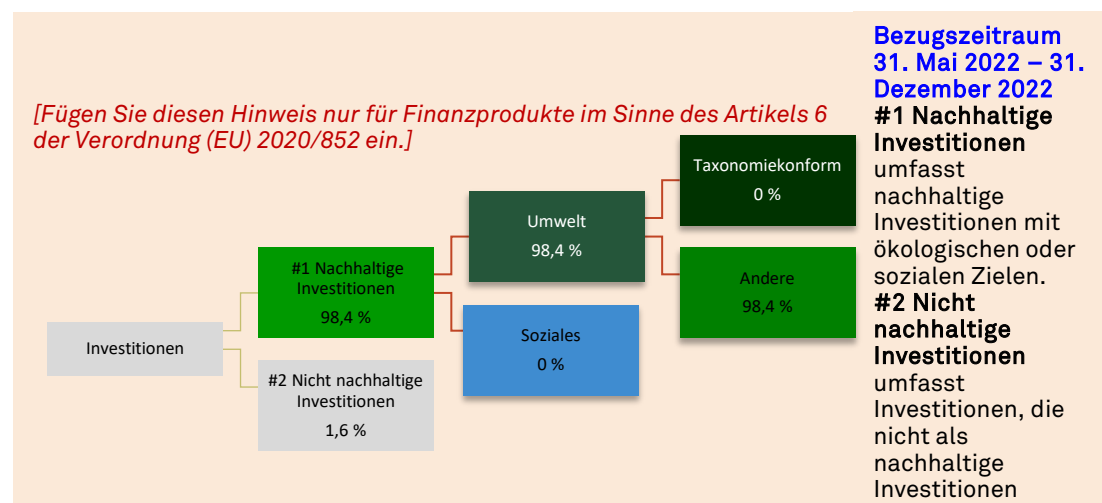
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **31. Mai 2022 – 31. Dezember 2022**

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	NEXTERA ENERGY I USD 0.01	Versorgung - Versorgungsunternehmen	6,53	USA
2	HUBBELL INC USD 0.01	Industrie - Investitionsgüter	5,33	USA
3	DEERE & CO USD 1	Industrie - Investitionsgüter	4,34	USA
4	TRANE TECHNOLOGIES USD 1	Industrie - Investitionsgüter	4,09	USA
5	LONGI GREEN ENERGY CNY 1	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausüstung	3,77	China
6	TE CONNECTIVITY CHF 0.57	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	3,69	USA
7	DANAHER CORP USD 0.01	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,63	USA
8	INGERSOLL-RAND I USD 0.01	Industrie - Investitionsgüter	3,05	USA
9	VOLTRONIC POWER TE TWD 10	Industrie - Investitionsgüter	2,97	Taiwan
10	RWE AG EUR NPV	Versorgung - Versorgungsunternehmen	2,94	Deutschland
11	ALBEMARLE CORP USD 0.01	Grundstoffe - Grundstoffe	2,92	USA
12	NOVOZYMES A/S-B SHA DKK 2	Grundstoffe - Grundstoffe	2,89	Dänemark
13	TOYOTA INDUSTRIES JPY NPV	Industrie - Investitionsgüter	2,71	Japan
14	DARLING INGREDIE USD 0.01	Basiskonsumgüter - Nahrungsmittel, Getränke und Tabak	2,64	USA
15	ORSTED A/S DKK 10	Versorgung - Versorgungsunternehmen	2,63	Dänemark



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 98,4 % des Nettoinventarwerts waren in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel investiert. 98,4 % 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: 98,4 % des Nettoinventarwerts

– Sonstige Umweltziele: 98,4 % des Nettoinventarwerts

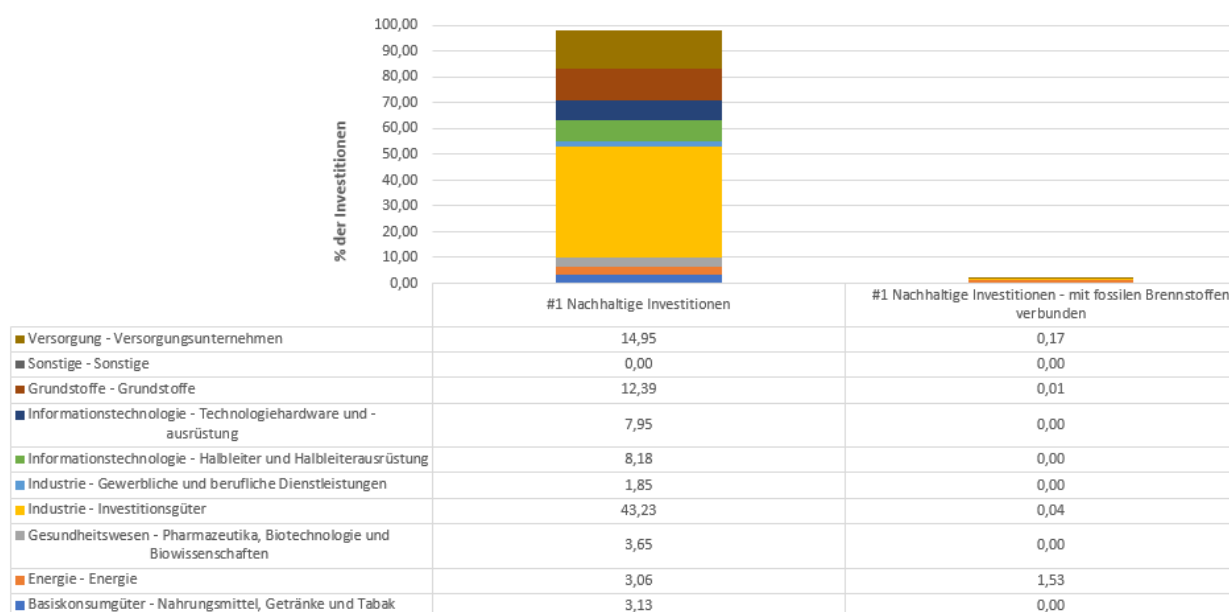
– Soziales: 0 % des Nettoinventarwerts

#2 Nicht nachhaltige Investitionen: 1,6 % des Nettoinventarwerts

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?** [Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 61 Buchstabe c dieser Verordnung.]

Vermögensallokation nach Sektoren und Teilspektoren gemäß Nachhaltigkeitseinstufung



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht? [Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU)

2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 62 dieser Verordnung ein.]

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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?**

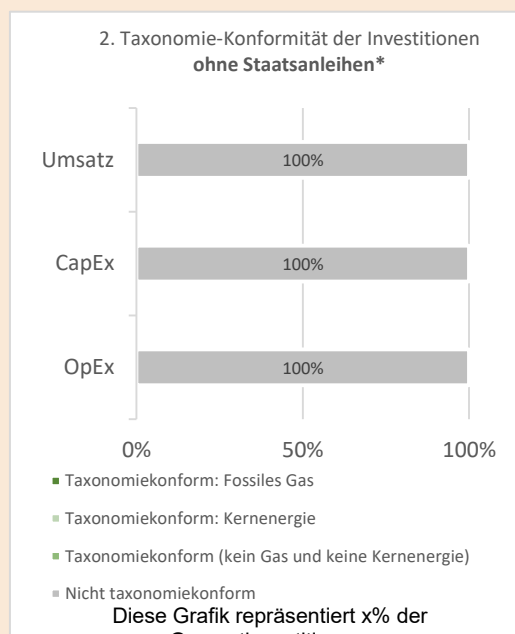
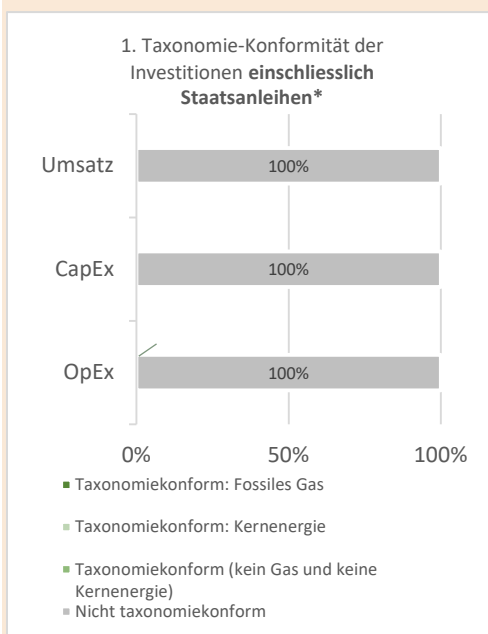
Ja: *[Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

In den nachstehenden Diagrammen 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 Taxonomiekonformität 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **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.

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.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** *[Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]*

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** *[Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden? *[Fügen Sie dies nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu, wenn das Finanzprodukt Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]*

Der Teilfonds investierte 98,4 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel, durch die in nicht mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel umfasst.]*

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 1,6 % 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? *[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Finanzprodukts ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der*

Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit dem nachhaltigen Investitionsziel.]

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 Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]*

Es wurde kein Referenzwert zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds bestimmt.

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein.]

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

Qualitative Fallstudien – Nachweis der Ausrichtung der fünf Top-Positionen (nach Gewichtung) des Fonds auf das vom Anlageverwalter entwickelte Rahmenwerk Future Earth zum 31. Dezember 2022

Die folgenden Angaben weisen den Beitrag der fünf Top-Positionen (nach Gewichtung) des Teilfonds zu Umweltzielen zum Ende des Bezugszeitraums (31. Dezember 2022) anhand der Ausrichtung auf das vom Anlageverwalter entwickelte Rahmenwerk Future Earth aus. Diese Angaben sollen den vom Anlageverwalter verfolgten Ansatz für alle Investitionen im Teilfonds veranschaulichen (ausgenommen zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken genutzte Instrumente). Alle Investitionen des Teilfonds sind durch die Ausrichtung auf das vom Anlageverwalter entwickelte Rahmenwerk auf Umweltziele ausgerichtet.

#	Bestand	Gewichtung im Teilfonds zum 31. Dez. 2022 (%)	Zusammenfassung	Nachweis der Ausrichtung auf das nachhaltige Investitionsziel
1	NEXTERA ENERGY INC	6,18 %	NextEra Energy, Inc. ist ein Anbieter von Diensten für die Erzeugung und Distribution nachhaltiger Energie. Das Unternehmen erzeugt Strom aus Windkraft, Sonnenenergie und Erdgas. Über ihre Tochtergesellschaften betreibt NextEra Energy auch mehrere gewerbliche Kernkraftwerke.	NextEra ist ein Entwickler erneuerbarer Energie von Weltrang. Es handelt sich dabei um diversifiziertes Unternehmen für saubere Energie mit einer Geschäftsstrategie, die besonderen Wert legt auf die Entwicklung und den Betrieb langfristig unter Vertrag genommener Anlagen mit Schwerpunkt auf erneuerbaren Projekten.
2	HUBBELL INC	5,69 %	Hubbell Incorporated stellt elektrische und elektronische Produkte für Gewerbe, Industrie, Versorgungs- und Telekommunikationsbranche her. Zu den Produkten des Unternehmens zählen Stecker, Buchsen, Steckverbinder, Beleuchtungskörper, Hochspannungsprüfungs- und -messtechnik sowie Komponenten zur Sprach- und Datensignalverarbeitung. Hubbell ist in den Vereinigten Staaten und anderen Ländern tätig.	Hubbell ist ein globaler Hersteller von elektrischer Ausrüstung und unterstützt daher die Sektoren Elektrifizierung (energieträgerübergreifend), Industrie, Gewerbe und Wohnbau. Das Unternehmen ist in zwei Hauptsegmenten tätig: elektrische Lösungen durch das Angebot von Produkten wie Leitungs-, Verbindungs- und Beleuchtungsprodukten. Das zweite Segment, die Versorgungslösungen, stellt Produkte im Zusammenhang mit der Stromübertragung und -versorgung bereit.
3	INGERSOLL RAND INC	4,84 %	Ingersoll Rand Inc. produziert Technik zur Durchflusssteuerung. Das Unternehmen hat Vakuumpumpen, Flaschengebläse, Pumpen und	Ingersoll Rand ist der führende Akteur auf dem Markt für Industriepumpen und -kompressoren. Dabei handelt es sich um wichtige Anlagen, die in vielen Branchen zum

#	Bestand	Gewichtung im Teilfonds zum 31. Dez. 2022 (%)	Zusammenfassung	Nachweis der Ausrichtung auf das nachhaltige Investitionsziel
			Luft- und Gaskompressoren im Angebot. Ingersoll-Rand beliefert Kunden in aller Welt.	Einsatz kommen. Die Effizienzsteigerung in diesem Bereich ist eine wichtige Komponente, um Industrieunternehmen dabei zu unterstützen, ihre Verpflichtungen zum Erreichen von Klimaneutralität einzuhalten.
4	TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,61 %	Trane Technologies Public Limited Company stellt Technik für die Industrie her. Das Unternehmen vertreibt Heizungs- und Klimaanlage, Elektrofahrzeuge, Reinraumtechnik und Flüssigkeitssystemprodukte. Trane Technologies ist für Kunden weltweit tätig.	Trane ist ein weltweit führender Anbieter von Heizungs- und Klimatechnik, mit geschäftlichem Schwerpunkt auf dem US-Markt. Nachhaltigkeit steht für das Unternehmen ganz oben auf der Tagesordnung. Produktentwicklung und Innovation sind auf die Reduzierung des CO ₂ -Fussabdrucks bei der Klimatisierung von Gebäuden ausgerichtet. ~35 bis 40 % der Stromkosten und des CO ₂ -Fussabdrucks eines Gebäudes entfallen auf Heizungs-, Lüftungs- und Klimatechnik, und der Gebäudebetrieb macht ~30 % der THG-Emissionen aus. Die Sanierung gewerblicher Heizungs-, Lüftungs- und Klimatechnik hat demzufolge das Potenzial, die gesamten THG-Emissionen um 10 bis 12 % zu senken, was für die Immobilieneigentümer durch Amortisierung in nur zwei bis drei Jahren reizvoll ist
5	DEERE	4,14 %	Deere & Company produziert und vertreibt eine breite Technikpalette für Agrar-, Bau- und Forstwirtschaft sowie Gewerbe- und Privatkunden. Das Unternehmen liefert Ersatzteile für eigene Produkte und die Erzeugnisse anderer Hersteller. Ferner offeriert Deere auch Finanzierungsdienste für Produkte und Teile. Deere & Company bietet seine Dienste und Produkte weltweit an.	Die grösste Ertragskomponente bilden Landmaschinen. In dieser Sparte ist Deeres Führungsposition in der digitalen Landwirtschaft und der Präzisionslandwirtschaft ein massgeblicher Treiber für die Wettbewerbsvorteile des Unternehmens. Präzisionslandwirtschaft ist der Schlüssel zur Produktion grösserer Nahrungsmittelmengen bei geringerem Einsatz von Material (wie Agrarchemie, Düngemitteln usw.) und zur Verbesserung der belastenden Ökobilanz und des CO ₂ -Fussabdrucks der Landwirtschaft.

ANHANG IV

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
FinanzprodukteName des Produkts: BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
Unternehmenskennung: 213800ESHZR9UGUCT211

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]● ● 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 13 % 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? *[Führen Sie die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale an. Für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit Umweltzielen führen Sie die in Artikel 9 dieser Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Anlage beigetragen hat. Für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen mit sozialen Zielen getätigt wurden, führen Sie bitte die sozialen Ziele an.]*

Der Teilfonds wurde am 7. November 2022 in einen Artikel-8-Fonds umgewandelt. Der „Bezugszeitraum“ für diesen regelmässigen Bericht beginnt daher am 7. November 2022 und endet am 31. Dezember 2022. Beachten Sie

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.

bitte, dass aus unvorhergesehenen operativen Gründen, die voraussichtlich nicht erneut auftreten, eine geringfügige Abweichung zwischen den Daten, zu denen die Datenpunkte erfasst wurden, und dem Bezugszeitraum vorliegt. Der erste Datenpunkt entsprach dem 31. Oktober 2022 (um eine Analyse vor dem Termin zu ermöglichen, an dem der Teilfonds die Anforderungen von Artikel 8 einhielt), der zweite dem 16. Januar 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.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Die nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR des Teilfonds mit einem sozialen Ziel waren auf Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet – „Gesundheit und Wohlergehen“. 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

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

1. *Kohlenstoffintensität 1 & 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:

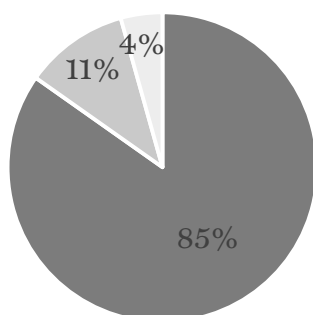
- Geschäftsethik, Bestechung und Korruption
 6. *Umstrittene Waffen*
 7. *Gesamtzahl der Verurteilungen wegen Verstössen gegen Korruptions- und Bestechungsvorschriften*
- Datenschutz und -sicherheit
 8. *Kunden – Score für Datenschutz & Datensicherheit*
 9. *Kontroversen im Zusammenhang mit Verstössen 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*

Alle Aktieninvestitionen des Teilfonds wurden vor dessen Umwandlung in einen Artikel-8-Fonds gemäss SFDR beziehungsweise vor dem Kauf, falls nach diesem Datum, sowie am Ende des Bezugszeitraums an den vorstehend aufgeführten 14 Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Die Daten wurden intern festgelegten Schwellenwerten gegenübergestellt. Dabei handelte es sich zum Teil um absolute Werte, zum Teil um Sektordurchschnitte. Wurde ein Schwellenwert erreicht, so löste das ein Warnsignal aus, welches eine Analyse, einen Kommentar und eine Schlussfolgerung des „Stock Champion“ (eines Mitglieds des für die Analyse der Aktiengesellschaft zuständigen Research-Teams des Anlageverwalters) und gegebenenfalls eine weitere Überprüfung durch die Additional Objectives Portfolios Group, ein internes Unternehmensführungsforum, erforderte.

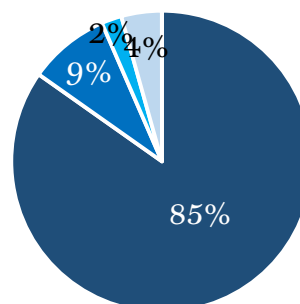
Die Analyse wurde von der Additional Objectives Portfolios Group geprüft. Angesichts des relativ kurzen Bezugszeitraums für den ersten regelmässigen SFDR-Bericht des Teilfonds liegen nur begrenzt aussagekräftige Informationen zu der gegenüber diesen Indikatoren erzielten Entwicklung vor. Allerdings sind die folgenden Punkte zu beachten:

- Für über 80 % der Investitionen des Teilfonds liegen keine Warnsignale im Zusammenhang mit Indikatoren für die ökologische Nachhaltigkeit vor. Der Anteil der Investitionen mit 0, 1 oder 2 Signalen war über die beiden Zeitpunkte hinweg stabil. Dasselbe galt für Signale in Bezug auf Indikatoren für die soziale Nachhaltigkeit. Die nachstehenden Tortendiagramme geben den Prozentsatz der Unternehmen mit Warnsignalen wieder, die am Ende des Bezugszeitraums hinsichtlich Indikatoren für soziale oder ökologische Nachhaltigkeit vorlagen.

% der Unternehmen mit ökologischen Warnsignalen



% der Unternehmen mit sozialen Warnsignalen



- No Flags ■ 1 Flag ■ 2 Flags ■ No Flags ■ 1 Flag ■ 2 Flags ■ 3 Flags

- Zwischen den beiden Zeitpunkten gab es 3 neue warnsignale, von denen sich 2 auf ein- und dieselbe Aktiengesellschaft bezogen. Für jede Investition analysierte der Stock Champion die Informationen, was von der Additional Objectives Group abschliessend überprüft wurde.

1. Unternehmen A

- *Warum wurden 2 Warnsignale ausgelöst, die das soziale Thema „Arbeitspraktiken und Menschenrechte“ betrafen?:* Der international tätige US-Markenmode- und Bekleidungseinzelhändler steht seit mehreren Jahren in der Kritik. Er soll angeblich Ware von Zulieferern aus China beziehen, denen vorgeworfen wird, im Rahmen von Arbeitstransferprogrammen Angehörige ethnischer Minderheiten zu beschäftigen. Obwohl keine konkreten neuen Entwicklungen im Zusammenhang mit dem Unternehmen vorliegen, änderte der externe Datenanbieter seine Methode zur Einstufung von Vorwürfen im Zusammenhang mit der Ausbeutung von Minderheitsgruppen im Juni 2022 und hat die Schwere von Kontroversen in Verbindung mit Menschenrechtsfragen im Zusammenhang mit Zwangsarbeitsprogrammen für Uiguren im Anschluss hochgestuft. Infolgedessen geriet das Unternehmen daraufhin während des Bezugszeitraums auf die „UNGC“-Watchliste von MSCI.
- *Analyse des Stock Champion:* Das Unternehmen brachte öffentlich seine Bedenken über Berichte zum Ausdruck, dass uigurische Zwangsarbeiter in Xinjiang Baumwolle pflückten, und erklärte, dass es keine Produkte aus der Region beziehe. Es ist vertretbar, daraus zu folgern, dass das Unternehmen eine Reihe effektiver Abhilfemassnahmen ergriffen hat und dass es in seinem Einflussbereich entsprechende Schritte unternimmt, um „für die Beseitigung aller Formen von Zwangsarbeit einzutreten“, der einschlägige UNGC-Grundsatz (4). Die Angelegenheit wird engmaschig überwacht.

2. Unternehmen B – ein Neuzugang im Bezugszeitraum

- *Warum wurde im Rahmen des Umweltthemas „Klima- und Übergangsrisiken“ ein Warnsignal ausgelöst?:* Das US-Basiskonsumgüterunternehmen ist global führender Grossflächen-Discounter für Mitglieder. In seinen Filialen vertreibt es Benzin und Diesel im Einzelhandel. In der vorgelagerten Exploration ist es nicht engagiert.
 - *Analyse des Stock Champion:* Der auf den Treibstoff Einzelhandel entfallende Anteil am Unternehmensumsatz liegt in der Regel im hohen einstelligen oder niedrigen zweistelligen Bereich. Hauptzweck des Treibstoffgeschäfts ist es, Mitglieder in die Filialen zu locken. Künftig können daher zum selben Zweck bei der Eröffnung neuer Filialen Ladestationen für Elektrofahrzeuge (EV) ins Programm aufgenommen werden, wie bereits bei manchen neuen Niederlassungen in Kalifornien der Fall. Daher geht der Anlageverwalter nicht davon aus, dass sich das Risiko eines raschen Übergangs über den langfristigen Zeithorizont für die Umstellung auf EV für das Unternehmen in ein wesentliches Risiko übersetzt.
- 4 Warnsignale, die am ersten Bewertungspunkt ausgelöst wurden, lagen in letzter Zeit nicht mehr vor.

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.

- *... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen? [bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

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? [Beschreiben Sie die Ziele für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen getätigt wurden, sofern diese nicht in der Antwort auf die vorstehende Frage enthalten sind. Beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Listen Sie für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte die in Artikel 9 der Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Investition beigetragen hat.]*

Das soziale Ziel, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR beitragen, war Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung – „Gesundheit und Wohlergehen“. Das Umweltziel, zu dem die nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR beitragen, 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 diesem Ziel wie folgt bei:

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel

- Novo Nordisk: globales Pharmaunternehmen mit Hauptschwerpunkt auf Diabetes und Adipositas: 89 % des Umsatzes sind auf Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Gesundheit und Wohlergehen“ 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 Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Gesundheit und Wohlergehen“ ausgerichtet.
- CSL: eines der grössten Unternehmen in der globalen Branche der Blutplasmaproducte, das auf die Therapie seltener, überwiegend chronischer Erkrankungen wie Immun- und Blutgerinnungsstörungen spezialisiert ist: 58 % des Umsatzes sind auf Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Gesundheit und Wohlergehen“ ausgerichtet.
- Roche: globales Pharma- und Diagnostikunternehmen, weltweit führend im Geschäftsfeld Onkologie: 47 % des Umsatzes sind auf Ziel 3 der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung „Gesundheit und Wohlergehen“ 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.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet? [Fügen Sie dies bei Finanzprodukten hinzu, die nachhaltige Investitionen enthalten.]

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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. Die obligatorischen Indikatoren in Anhang I Tabelle 1 und alle relevanten Indikatoren (nach Sektoren) in den Tabellen 2 und 3 in diesem Anhang wurden im Bezugszeitraum vom 7. November 2022 bis zum 31. Dezember 2022 folgendermassen berücksichtigt:

- Indikatoren in Anhang I Tabelle 1:
 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

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.

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 enthaltenen obligatorischen Indikatoren mit Ausnahme von PAI 2, dem CO₂-Fussabdruck. Für die DNSH-Bewertung müssen die PAIs auf Aktienebene 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.

- Indikatoren in Anhang 2 Tabelle 1:
 4. Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO₂-Emissionen
 8. Engagement in Gebieten mit hohem Wasserstress
- Indikatoren in Anhang 3 Tabelle 1:
 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 Investition gemäss SFDR darstellte. Unter den 5 Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR eingestuft wurden, wurde ein solches Warnsignal in 19 Fällen ausgelöst, die sich mehrheitlich auf Datenlücken bezogen.

- Zwischen den beiden Zeitpunkten wurde 1 neues Warnsignal für ein US-Unternehmen aus dem Gesundheitswesen für PAI 3 ausgelöst. Der Datenpunkt der Aktie blieb in dem Zeitraum jedoch unverändert. Der Wert des Sektormedians nahm ab, sodass ein Warnsignal ausgelöst wurde.

- 1 Warnsignal, das am ersten Bewertungspunkt ausgelöst wurde, lag in letzter Zeit nicht mehr vor.

Wenn die Daten vom externen Datenanbieter nicht verfügbar waren, wurde generell zunächst das Unternehmen, in das investiert wird, kontaktiert. Meldete das Unternehmen den Datenpunkt nicht, wurden ein Näherungswert oder alternative Kontextinformationen herangezogen.

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 5 Wertpapieren, die als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR eingestuft wurden, wurde ein solches Warnsignal in 10 Fällen ausgelöst, die sich zur Hälfte auf Datenlücken bezogen. Zwischen den beiden Zeitpunkten wurden keine neuen Warnsignale ausgelöst und keine Warnsignale zurückgenommen.

Wenn die Daten vom externen Datenanbieter nicht verfügbar waren, wurde generell zunächst das Unternehmen, in das investiert wird, kontaktiert. 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? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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 werden als mit den Grundsätzen verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken übereinstimmend angesehen, da keine Warnsignale in Bezug auf bestimmte Menschenrechte, Arbeitsbedingungen, allgemeine Kontroversen und Einhaltung der Steuervorschriften, 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.

[Fügen Sie eine Erklärung für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu.]

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
wur
den**



bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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 enthaltenen obligatorischen Indikatoren auf Portfolioebene. Bei diesen handelte es sich um:

- PAI 2 CO₂-Fussabdruck
- PAI 3 THG-Emissionsintensität 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 in den Leitungs- und Kontrollorganen
- 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 festgelegt hat. 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.

In der folgenden Tabelle sind die Messschwellenwerte und der Portfoliowert zu diesen beiden Feststellungszeitpunkten aufgeführt. Daraus lässt sich schliessen, dass keiner dieser Schwellenwerte verletzt wurde (Hinweis: für

Geschlechtervielfalt würde ein Portfoliowert, der unter dem Messschwellenwert liegt, eine potenzielle Verletzung darstellen).

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgrösse	Messschwellenwert - Endpunkt	Portfoliowert – Endpunkt	Messschwellenwert - Ausgangspunkt	Portfoliowert – Ausgangspunkt
2	CO ₂ -Fussabdruck je Mio. EUR	Wert des Referenzwerts* - 438	154	Wert des Referenzwerts* - 465	151
3	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	Wert des Referenzwerts* - 999	577	Wert des Referenzwerts* - 1007	593
4	Aktive Engagements im Sektor fossile Brennstoffe	10 %	6 %	10 %	6 %
7	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	10 %	0 %	10 %	0 %
10	Verstösse gegen den UNGC	0 %	0 %	0 %	0 %
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	30 %	32 %	30 %	32 %
14	Engagement in umstrittenen Waffen	0 %	0	0 %	0

*Es wurde derselbe Referenzwert herangezogen, an dem auch die Wertentwicklung des Teilfonds gemessen wird, der MSCI World NR Index.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Grösste Investitionen	Sektor	Vermöge	Land
Novo Nordisk	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaft	4.22	Dänemark
Microsoft Corporation	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3.55	USA
Mastercard	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3.18	USA
Linde	Grundstoffe - Grundstoffe	3.13	USA
Automatic Data Processing	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	2.81	USA
Keyence	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	2.81	Japan
AIA Group	Finanzen - Versicherungen	2.79	Hongkong
Amphenol	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	2.78	USA
LVMH	Nicht-Basiskonsumgüter - Gebrauchsgüter und Bekleidung	2.69	Frankreich
Compass Group	Nicht-Basiskonsumgüter - Verbraucherdienstleistungen	2.59	Vereinigtes König
Texas Instruments	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterrausrüstung	2.56	USA
Taiwan Semiconductor - ADR	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterrausrüstung	2.51	Taiwan
Alimentation Couche-Tard	Basiskonsumgüter - Lebens- und Grundnahrungsmittelhandel	2.49	Kanada
Intuitive Surgical	Gesundheitswesen - Medizintechnik und -dienste	2.46	USA
TJX Companies	Nicht-Basiskonsumgüter - Einzelhandel	2.41	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 7. November 2022 bis 31. Dezember 2022

Zum 31. Dezember 2022 entsprach die Vermögensallokation des Teilfonds der Darstellung im Diagramm. Dieses weicht vom Diagramm zur Vermögensallokation in den vorvertraglichen Informationen (Anhang II) ab, denn das sollte lediglich die vorgesehene Vermögensallokation des Teilfonds illustrieren. Daraus gingen die an anderer Stelle im betreffenden Anhang erwähnten Mindestinvestitionen hervor.

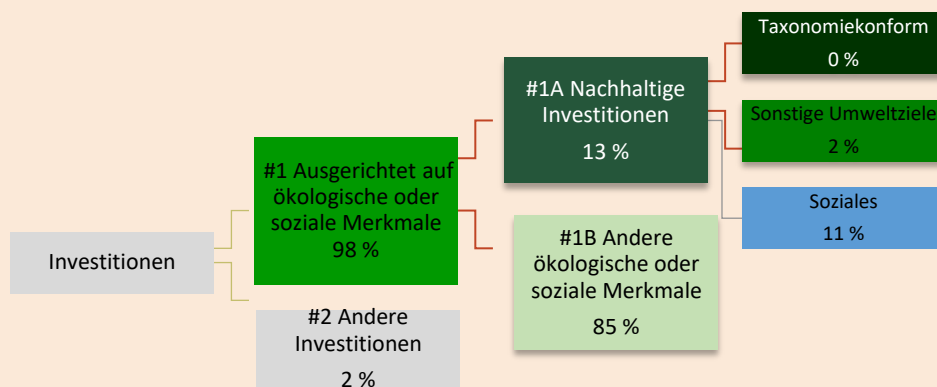
Zum 31. Dezember 2022 waren 98 % des Nettoinventarwerts dieses Teilfonds in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere investiert, die zum Kaufzeitpunkt und fortlaufend den „ESG-Kriterien“ des Anlageverwalters entsprachen. Der verbleibende Anteil am Teilfonds war in Barmittel investiert. Zur Klarstellung: 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 2022 waren 13 % 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 2022 waren 2 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel investiert und 11 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



#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.

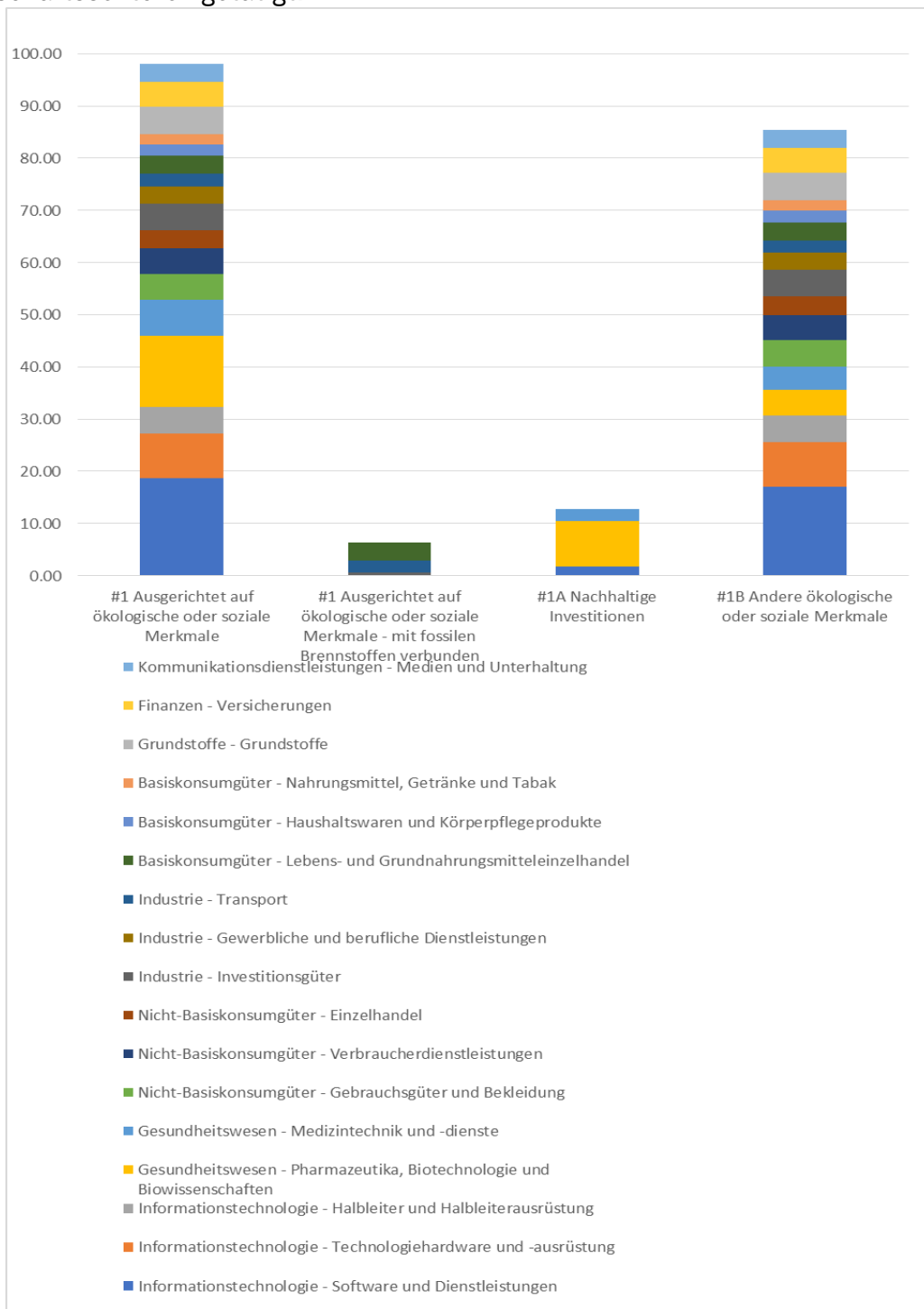
[Fügen Sie den nachstehenden Hinweis ein, wenn mit dem Finanzprodukt nachhaltigen Investitionen getätigt wurden.]

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?**
[Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 54 dieser Verordnung.]

Zum 31. Dezember 2022 wurden die Investitionen des Teilfonds in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:



Sectors	#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	ökologische oder soziale Merkmale - mit fossilen Brennstoffen verbunden	#1A Nachhaltige Investitionen	ökologische oder soziale Merkmale
Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	18.71		1.67	17.04
Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	8.57			8.57
Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleitersausrüstung	5.07			5.07
Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaft	13.64		8.75	4.89
Gesundheitswesen - Medizintechnik und -dienste	6.79		2.30	4.50
Nicht-Basiskonsumgüter - Gebrauchsgüter und Bekleidung	5.05			5.05
Nicht-Basiskonsumgüter - Verbraucherdienstleistungen	4.86			4.86
Nicht-Basiskonsumgüter - Einzelhandel	3.54			3.54
Industrie - Investitionsgüter	5.02	0.53		5.02
Industrie - Gewerbliche und berufliche Dienstleistungen	3.33			3.33
Industrie - Transport	2.40	2.40		2.40
Basiskonsumgüter - Lebens- und Grundnahrungsmittel Einzelhandel	3.46	3.46		3.46
Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2.15			2.15
Basiskonsumgüter - Nahrungsmittel, Getränke und Tabak	2.02			2.02
Grundstoffe - Grundstoffe	5.21			5.21
Finanzen - Versicherungen	4.77			4.77
Kommunikationsdienstleistungen - Medien und Unterhaltung	3.54			3.54
	98.14	6.39	12.72	85.42

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

[Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 51 dieser Verordnung ein.]

Die nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren nicht mit der EU-Taxonomie konform. 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 Kernenergie¹ investiert?**

Ja: [Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]

In fossiles Gas

In Kernenergie

\

Nein

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.

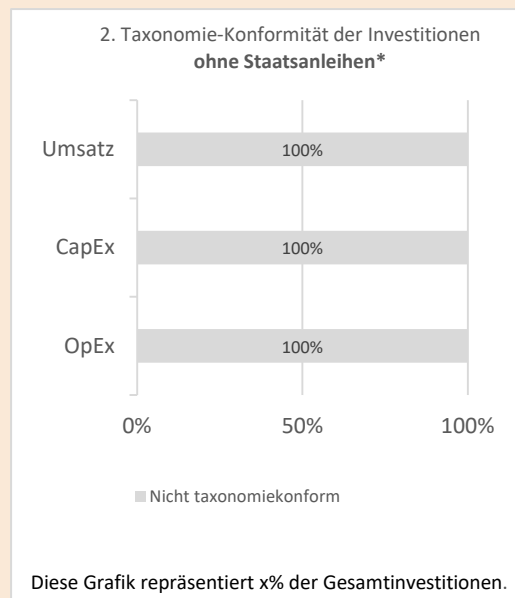
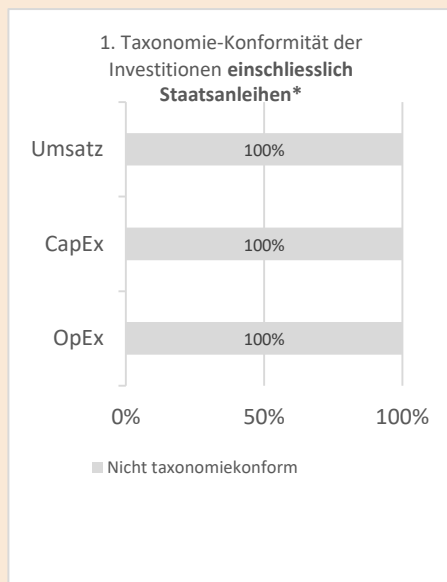
[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen 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 Taxonomiekonformität 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.

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** [Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]

0 %.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** [Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]

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?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

100 % der nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren nicht mit der EU-Taxonomie konform. Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel in

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomiekonform waren, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Zum Datum dieses Anhangs sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel enthalten hat.]

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte zum 31. Dezember 2022 aber 11 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 31. Dezember 2022 hielt der Teilfonds 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?

[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erfüllung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.]

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 Integrität, Nachhaltigkeit und Governance-Faktoren.
- Screening von Umwelt-, Sozial- und Governance-Datenpunkten und von Kontroversen, das von einem externen Datenanbieter bereitgestellt wurde.
- 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. Der Investment Executive übte zum Zeitpunkt der Umwandlung des Teilfonds in einen Artikel-8-Fonds die Aufsicht über den Portfolioaufbau aus und ebenso für alle Folgekäufe neuer Investitionen.

Im Bezugszeitraum empfahl die Additional Objective Portfolios Group, eine potenzielle Anlageidee, die ein grosses amerikanisches Gesundheitsunternehmen betraf, nicht in das Teilfondsportfolio aufzunehmen. Dies wurde vom Investment Executive unterstützt. Die Ausschlussempfehlung für diese Investition erfolgte aufgrund anhaltender Unsicherheit und Bedenken in Bezug auf die Berücksichtigung „solider Managementstrukturen“.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten? *[Fügen Sie den Abschnitt ein, wenn ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde, und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]*

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]
Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **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

ANHANG IV

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](#)
 Rechtsträgerkennung: [2138000BBVFZ8TN6N134](#)

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

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 **80 %** 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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

[Führen Sie die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale an. Für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit Umweltzielen führen Sie die in Artikel 9 dieser Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Anlage beigetragen hat. Für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen mit sozialen Zielen getätigt wurden, führen Sie bitte die sozialen Ziele an.]

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 20. Juli 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Mittel
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen)

Ohne zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltene Instrumente stellte sich die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren folgendermassen dar:

Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 - 96,75 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 - 91 % des Teilfonds.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 - 100 % des Teilfonds.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?** [bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]

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?** [Beschreiben Sie die Ziele für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen getätigt wurden, sofern diese nicht in der Antwort auf die vorstehende Frage enthalten sind. Beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Listen Sie für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte die in Artikel 9 der Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Investition beigetragen hat.]

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 nicht zu 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:

- 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 Emissionsverringern 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? [Fügen Sie dies bei Finanzprodukten hinzu, die nachhaltige Investitionen enthalten.]

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

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.

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.

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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?

[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]

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 dritten 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: **20. Juli 2022 – 31. Dezember 2022**

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	HUBBELL INC USD 0.01	Industrie - Investitionsgüter	3,78	USA
2	ANSYS INC USD 0.01	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	3,64	USA
3	EATON CORP PLC USD 0.01	Industrie - Investitionsgüter	3,29	USA
4	CNH INDUSTRIAL N EUR 0.01	Industrie - Investitionsgüter	3,25	USA
5	SCHNEIDER ELECTRIC EUR 4	Industrie - Investitionsgüter	2,99	Frankreich
6	ALBEMARLE CORP USD 0.01	Grundstoffe - Grundstoffe	2,95	USA
7	SAMSUNG SDI CO L KRW 5000	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	2,85	Korea
8	MP MATERIALS C USD 0.0001	Grundstoffe - Grundstoffe	2,79	USA
9	APTIV PLC USD 0.01	Nicht-Basiskonsumgüter - Autos und Autoteile	2,65	USA
10	INFINEON TECHNOLO EUR NPV	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausrüstung	2,52	Deutschland
11	TRIMBLE INC USD 0.001	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	2,49	USA
12	VISTEON CORP USD NPV	Nicht-Basiskonsumgüter - Autos und Autoteile	2,48	USA
13	EAST JAPAN RAILWA JPY NPV	Industrie - Transport	2,44	Japan
14	DENSO CORP JPY NPV	Nicht-Basiskonsumgüter - Autos und Autoteile	2,43	Japan
15	LUMENTUM HOLDIN USD 0.001	Informationstechnologie - Technologiehardware und -ausrüstung	2,36	USA

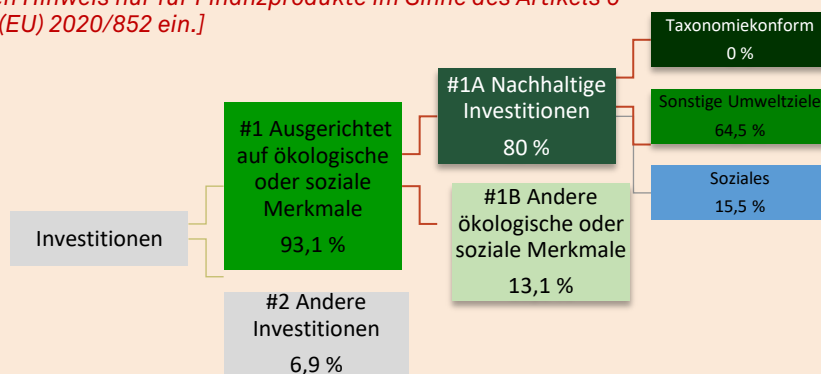


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



Bezugszeitraum: 20. Juli 2022 – 31. Dezember 2022

#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.

[Fügen Sie den nachstehenden Hinweis ein, wenn mit dem Finanzprodukt nachhaltigen Investitionen getätigt wurden.]

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.

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 93,1 % 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 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR. Davon hatten 64,5 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 15,5 % 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: 93,1 % des Nettoinventarwerts

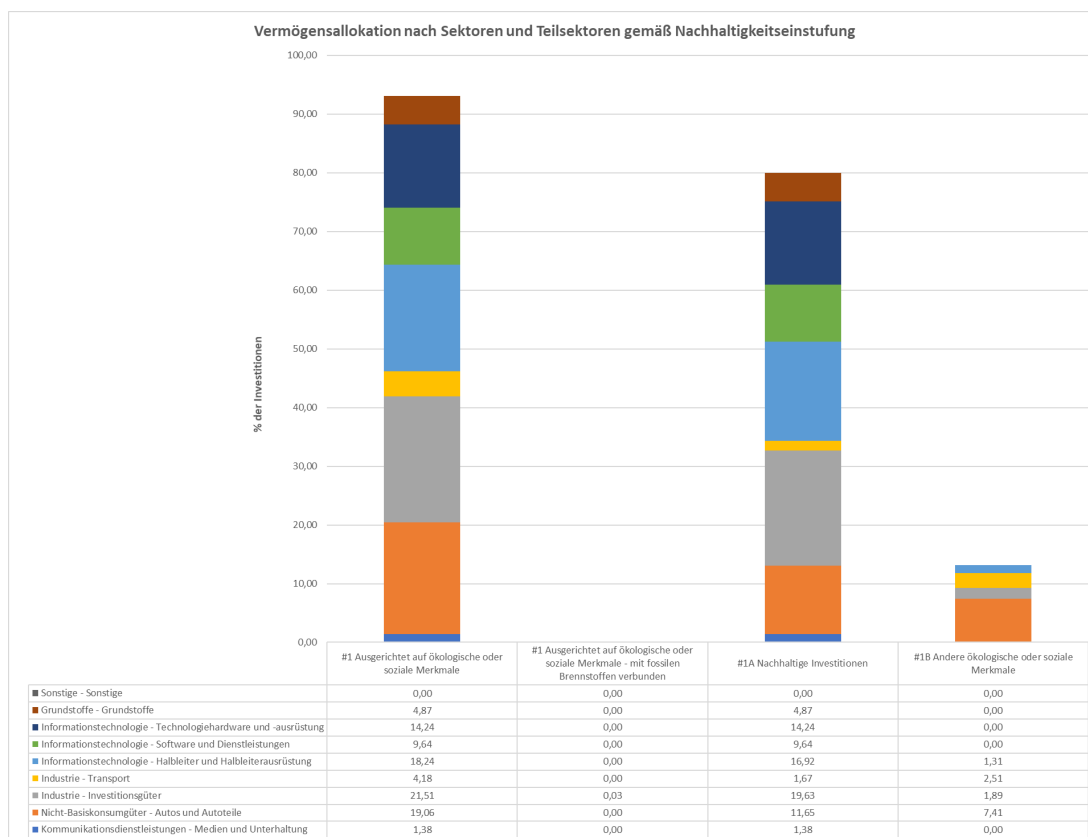
#1A Nachhaltige Investitionen: 80 % des Nettoinventarwerts

- Taxonomiekonform: 0 % des Nettoinventarwerts
- Umwelt: 64,5 % des Nettoinventarwerts
- Soziales: 15,5 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 13,1 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 6,9 % des Nettoinventarwerts

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform? [Fügen Sie diesen

Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 51 dieser Verordnung ein.]

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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 Kernenergie¹ investiert?**

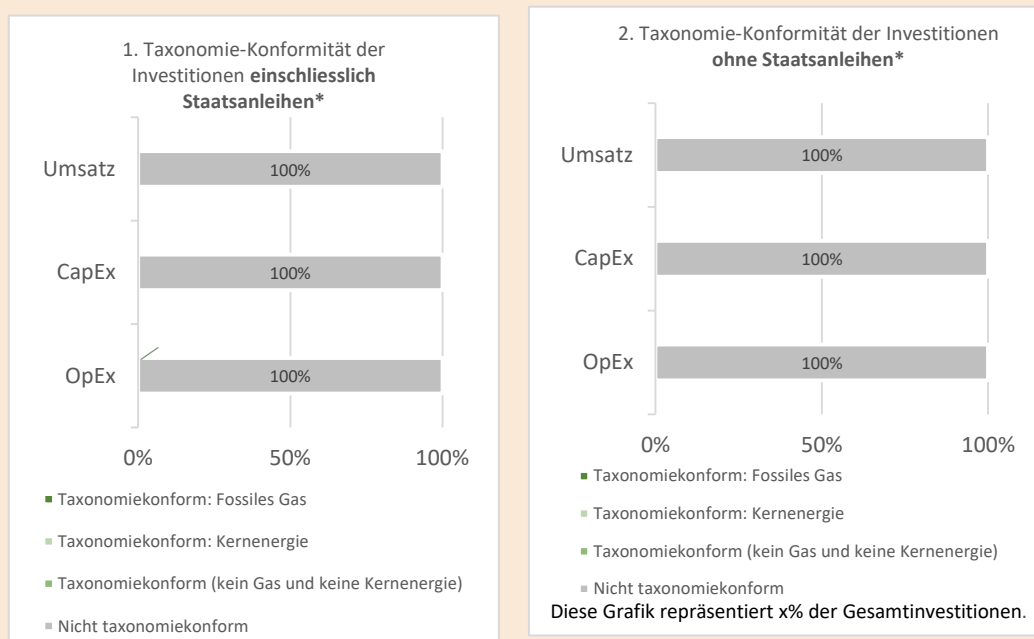
Ja: *[Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

In den nachstehenden Diagrammen 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 TaxonomieKonformität 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für Kernenergie beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. 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 Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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.

[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird,

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** [Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** [Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]

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?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

Der Teilfonds investierte 64,5 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht taxonomiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel enthalten hat.]

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 15,5 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 6,9 % des Nettoinventarwerts in Kategorie #2 (andere Investitionen), darunter:

- 1) 3,26 % 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.
- 2) 3,64 % in ein Landmaschinenunternehmen, das am Ende des Bezugszeitraums Gegenstand einer Überprüfung durch den Anlageverwalter war, um seine Ausrichtung auf die ESG- und Nachhaltigkeitskriterien des Anlageverwalters zu bestätigen.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erfüllung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.]

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.

Mitwirkung ist nicht 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? *[Fügen Sie den Abschnitt ein, wenn ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde, und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]*

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]

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

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

ANHANG V

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 Fund](#)
 Unternehmenskennung: [213800D07SNROTOSKR14](#)

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

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: **98,7 %**

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% 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 **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

[Führen Sie das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts an und beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Für die in Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte geben Sie in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel die in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele an, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende Investition beigetragen hat. Geben Sie für die in Artikel 9 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Finanzprodukte an, wie das Ziel einer Verringerung der CO₂-Emissionen mit dem Übereinkommen von Paris in Einklang gebracht wurde.]



Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 31. Mai 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Bezugszeitraum“) 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 Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
---------------	--

97 % 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:

Nachhaltigkeits-indikator Nr. 1

Unternehmens-kategorie	Schwellenwert	% der im Teilfonds gehaltenen Unternehmen, die zum 31. Dez. 2022 diesen Schwellenwert einhielten
Klinische Vorreiter (Clinical Pioneers)	Ausgaben von mindestens 30 % der OpEx für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten	70 %
Unterstützende Akteure (Supporting Cast)	Ausgaben von mindestens 15 % der OpEx für Forschung und Entwicklung neuer Produkte und/oder Dienstleistungen in den vorangegangenen 12 Monaten	20 %
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 %
SUMME		97 %

Ein Unternehmen, auf das (nach Anzahl der Unternehmen) 3 % des Teilfonds entfielen, erfüllte dessen Schwellenwertanforderungen nicht und wurde im Anschluss vom Anlageverwalter abgestossen.

Nachhaltigkeits-indikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 3	0 %
Nachhaltigkeits-indikator Nr. 4	Mittel

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 99 % 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.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?** [Bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde.]

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

- **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

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.

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? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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 dritten 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?



#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	BIOMARIN PHARMA USD 0.001	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	6,82	USA
2	ELI LILLY & CO USD NPV	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	5,52	USA
3	ASTRAZENECA PLC USD 0.25	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	5,16	Vereinigtes Königreich
4	SANOVI-ADR USD NPV ADR	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	4,71	USA
5	ABBVIE INC USD 0.01	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	4,67	USA
6	DANAHER CORP USD 0.01	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	4,47	USA
7	ALNYLAM PHARMACE USD 0.01	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	4,34	USA
8	MERCK KGAA EUR NPV	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,96	Deutschland
9	CYTOKINETICS IN USD 0.001	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,80	USA
10	REGENERON PHARM USD 0.001	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,55	USA
11	SAREPTA THERAP USD 0.0001	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,48	USA
12	CATALENT INC USD 0.01	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,32	USA
13	LEGEND BIO USD 0.0001 ADR	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,25	USA
14	ULTRAGENYX PHAR USD 0.001	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,08	USA
15	DENALI THERAPEUT USD 0.01	Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	3,04	USA

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **31. Mai 2022 – 31. Dezember 2022**



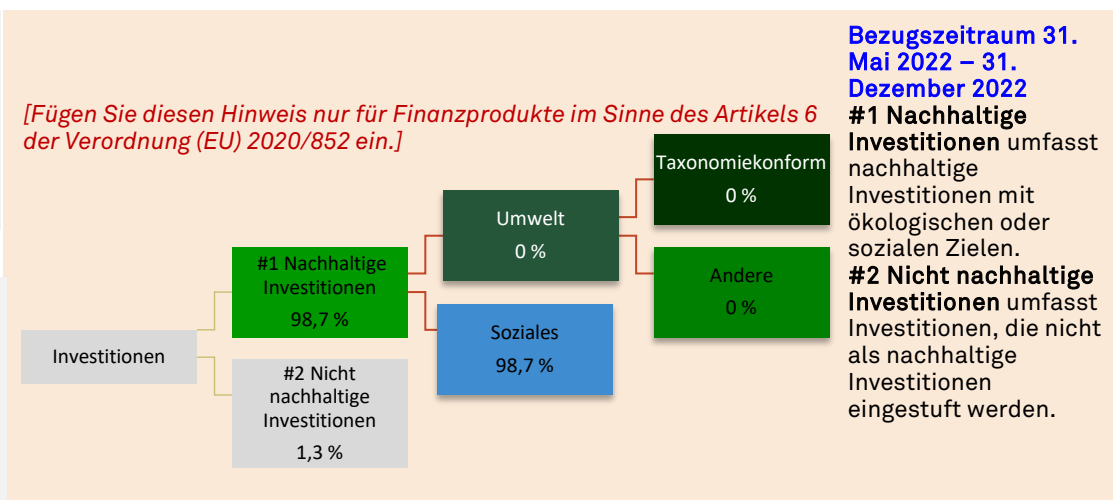
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **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.



Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 98,7 % 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.

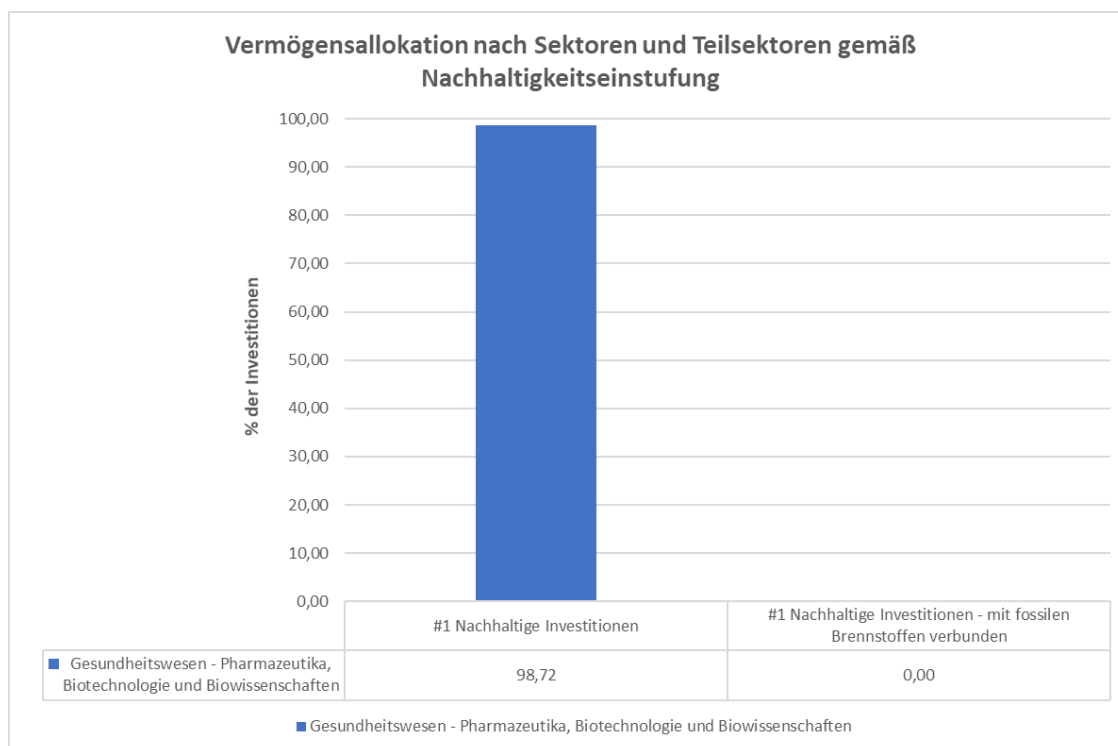
#1 Nachhaltige Investitionen: 98,7 % des Nettoinventarwerts

– Sonstige Umweltziele: 0 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 98,7 % des Nettoinventarwerts

#2 Nicht nachhaltige Investitionen: 1,3 % des Nettoinventarwerts

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt? *[Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 61 Buchstabe c dieser Verordnung.]*



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht? *[Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 62 dieser Verordnung ein.]*

k. A.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

Ja: *[Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

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.

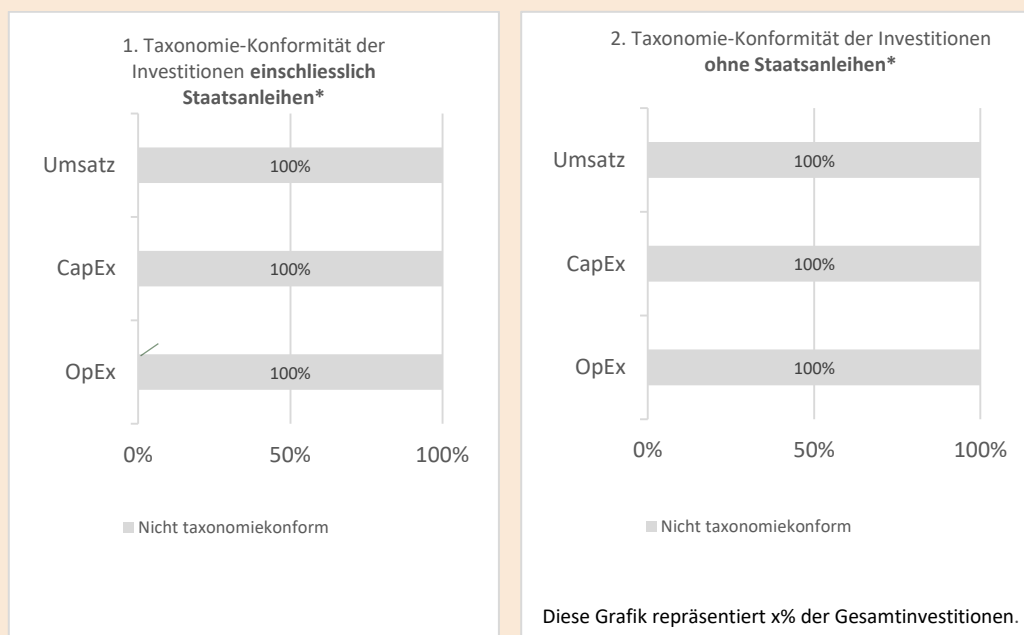
[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen 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.

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** [Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** [Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



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 nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

[Fügen Sie dies nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu, wenn das Finanzprodukt Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

k. A.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel umfasst.]*

Der Teilfonds investierte 98,7 % 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 1,3 % 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?

[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Finanzprodukts ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit dem nachhaltigen Investitionsziel.]

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.
- Mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts wurden in Unternehmen investiert, 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 Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]*

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

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein.]

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

ANHANG IV

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,7 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt? [Führen Sie die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale an. Für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit Umweltzielen führen Sie die in Artikel 9 dieser Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Anlage beigetragen hat. Für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen mit sozialen Zielen getätigt wurden, führen Sie bitte die sozialen Ziele an.]

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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 Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
	0,41 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	Der Teilfonds hielt eine Position in einem Autounternehmen, das nach Ansicht des externen Datenanbieters des Anlageverwalters nach dem Kauf gegen die UNGC-Grundsätze verstossen hatte. Die

Position wurde anschliessend abgestossen.

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Schwach
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	100 %

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 100 % der Investitionen des Teilfonds in Unternehmensanleihen (ausgenommen staatliche Emittenten, FDI, Barmittel und Barmitteln gleichgestellter Mittel).

Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 45 % der Investitionen des Teilfonds.

Die Datenabdeckung für Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4 lag bei 100 % der von dem Teilfonds gehaltenen staatlichen Emittenten.

Es wurden keine Derivate (FDI) eingesetzt, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?** *[bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

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?** *[Beschreiben Sie die Ziele für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen getätigt wurden, sofern diese nicht in der Antwort auf die vorstehende Frage enthalten sind. Beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Listen Sie für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte die in Artikel 9 der Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Investition beigetragen hat.]*

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 nicht zu 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 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 grünen 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 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? [Fügen Sie dies bei Finanzprodukten hinzu, die nachhaltige Investitionen enthalten.]

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?

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 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

— — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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.

[Fügen Sie eine Erklärung für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu.]

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? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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. 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 versties (PAI Nr. 10), was zum Abzug von Kapital aus diesem Emittenten führte.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten 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?

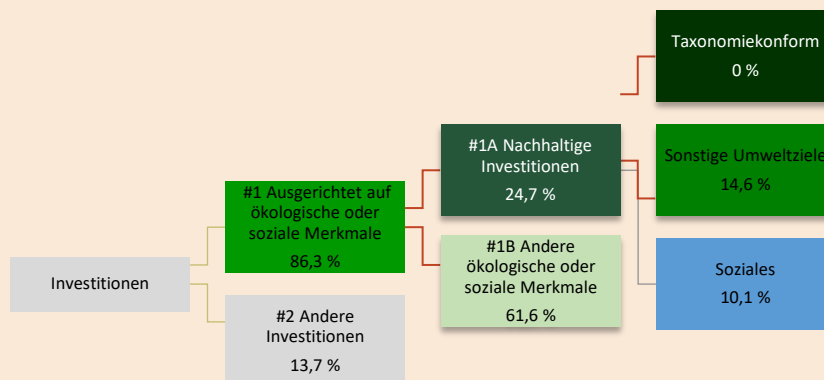
#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	US TS 1.125% 01/15/25	Staatsanleihen - Staatsanleihen	6,29	USA
2	US TR FRN 10/31/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	6,14	USA
3	US TR FRN 01/31/24	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,66	USA
4	US TSY 3% 11/15/45	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,33	USA
5	US TS 0.625% 04/15/23 IFL	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,28	USA
6	CAN H FRN 03/15/27	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,20	Kanada
7	CAN HS 2.35% 09/15/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,08	Kanada
8	CANADA 0.25% 05/01/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,08	Kanada
9	AUSTRA 2.75% 04/21/24	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,04	Australien
10	US TSY 0.25% 09/30/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,91	USA
11	CANADA 1.75% 03/01/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,69	Kanada
12	CANAD 4% 12/01/31 IFL	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,36	Kanada
13	N ZEAL 0.5% 05/15/24	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,36	Neuseeland
14	INDONE 6.5% 06/15/25	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,29	Indonesien
15	TREASU 1% 11/20/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,27	Australien

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022**

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



Bezugszeitraum 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

#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.

[Fügen Sie den nachstehenden Hinweis ein, wenn mit dem Finanzprodukt nachhaltigen Investitionen getätigt wurden.]

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.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 86,3 % 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 24,7 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR. Davon hatten 14,6 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 10,1 % 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: 86,3 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 24,7 % des Nettoinventarwerts

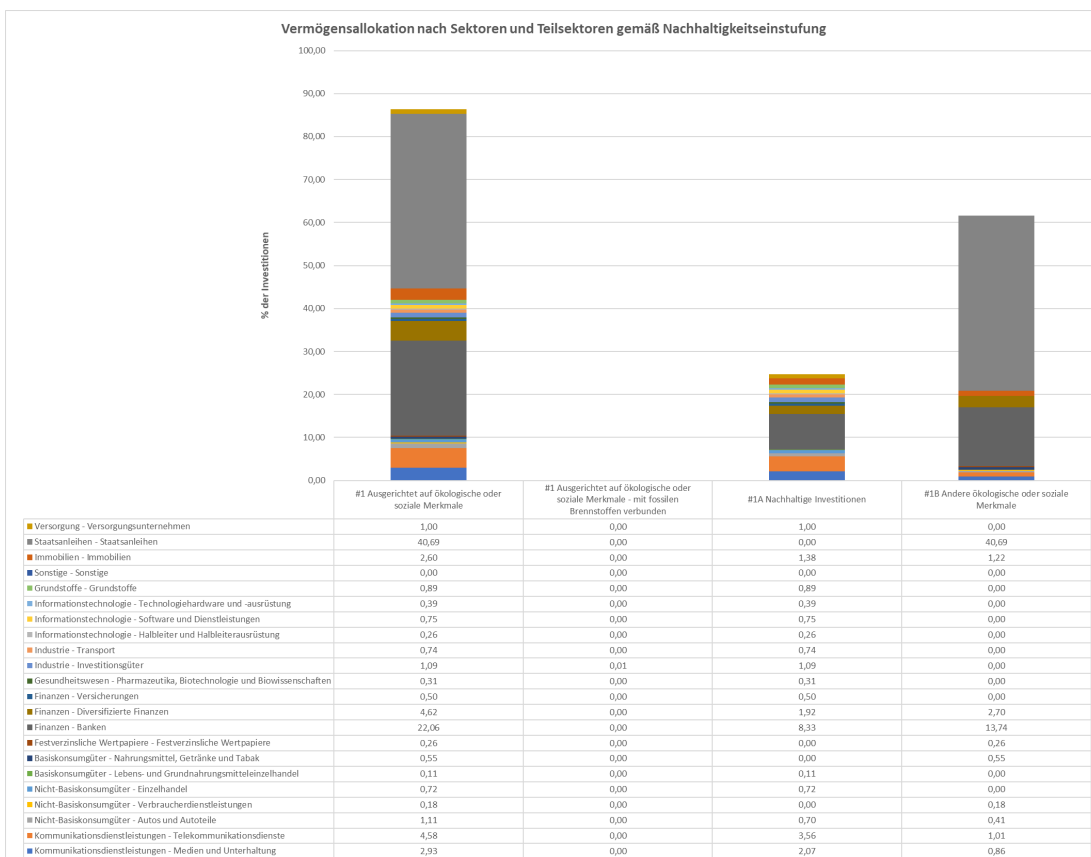
- Taxonomiekonform: 0 % des Nettoinventarwerts

- Umwelt: 14,6 % des Nettoinventarwerts
- Soziales: 10,1 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 61,6 % des Nettoinventarwerts

#2 Andere Investitionen: 13,7 % des Nettoinventarwerts

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt? [Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 54 dieser Verordnung.]



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform? [Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 51 dieser Verordnung ein.]

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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?

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.

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. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

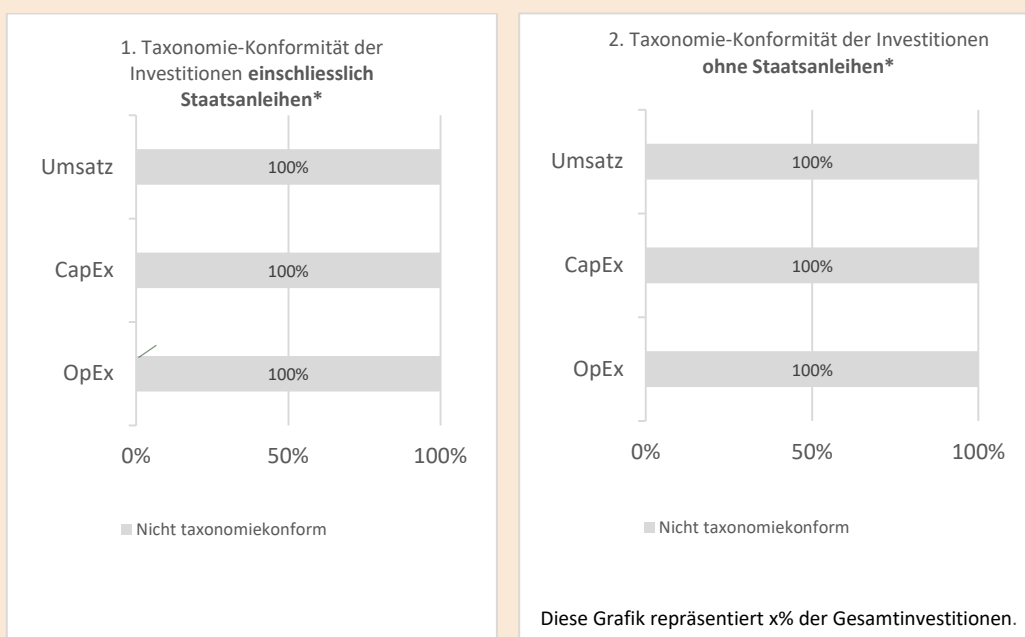
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

- Ja: *[Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

In den nachstehenden Diagrammen 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 Taxonomiekonformität 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** *[Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]*

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** *[Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

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?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

Der Teilfonds investierte 14,6 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht taxonomiekonform sind, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel enthalten hat.]*

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 10,1 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel.

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Teilfonds investierte 13,7 % 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.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erfüllung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.]

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 versties. 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.

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Mitwirkung ist nicht 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? *[Fügen Sie den Abschnitt ein, wenn ein Index als*

Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde, und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Index zu finden ist.]

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

ANHANG V

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?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: **47,2 %**

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: **49,3 %**

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% 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 **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?



[Führen Sie das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts an und beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Für die in Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte geben Sie in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel die in Artikel 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele an, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde

liegende Investition beigetragen hat. Geben Sie für die in Artikel 9 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Finanzprodukte an, wie das Ziel einer Verringerung der CO2-Emissionen mit dem Übereinkommen von Paris in Einklang gebracht wurde.]

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum vom 23. September 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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 Nr. 7: Bezahlbare und saubere Energie
- SDG Nr. 9: Industrie, Innovation und Infrastruktur
- SDG Nr. 11: Nachhaltige Städte und Gemeinden
- SDG Nr. 13: Klimaschutzmassnahmen

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen zu den folgenden sozialen Zielen bei:

- SDG Nr. 2: Kein Hunger
- SDG Nr. 3: Gesundheit und Wohlergehen
- SDG Nr. 4: Hochwertige Bildung
- SDG Nr. 5: Geschlechtergleichheit
- SDG Nr. 6: Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen
- SDG Nr. 7: Bezahlbare und saubere Energie

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

- SDG Nr. 8: Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- SDG Nr. 9: Industrie, Innovation und Infrastruktur
- SDG Nr. 10: Weniger Ungleichheiten
- SDG Nr. 11: Nachhaltige Städte und Gemeinden
- SDG Nr. 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 Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	0 %

Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Mittel
Nachhaltigkeitsindikator 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 beigefügt ist.

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 96,25 % der Investitionen des Teilfonds abzüglich der für FDI und zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken eingesetzten Instrumente.

Die Datenabdeckung für den Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3 lag bei 97 % 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.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen? [Bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde.]

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

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.

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?*

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 Drittdatenanbieter. 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
 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? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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? *[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]*

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 unlösliche 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 unlöslichen 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 dritten 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?

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	TAIWAN SEMICONDUCT TWD 10	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausüstung	5,46	Taiwan
2	AIA GROUP LTD HKD NPV	Finanzen - Versicherungen	4,30	Hongkong
3	SHENZHEN INOVANCE T CNY 1	Industrie - Investitionsgüter	3,75	China
4	BLACKROCK INST US DOL HRT	Sonstige - Sonstige	3,43	USA
5	BANK RAKYAT INDONE IDR 50	Finanzen - Banken	3,24	Indonesien
6	WEG SA BRL NPV	Industrie - Investitionsgüter	3,00	Brasilien
7	TATA CONSULTANCY SV INR 1	Informationstechnologie - Software und Dienstleistungen	2,99	Indien
8	HDFC BANK LIMITED INR 1	Finanzen - Banken	2,95	Indien
9	BY-HEALTH CO LTD-A CNY 1	Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2,94	China
10	MARICO LTD INR 1	Basiskonsumgüter - Nahrungsmittel, Getränke und Tabak	2,92	Indien
11	HINDUSTAN UNILEVER INR 1	Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2,82	Indien
12	PHARMARON BEIJING C CNY 1	Gesundheitswesen - Pharmazeutika, Biotechnologie und Biowissenschaften	2,70	Hongkong
13	ASML HOLDING NV EUR 0.09	Informationstechnologie - Halbleiter und Halbleiterausüstung	2,43	Niederlande
14	HOUSING DEVELOPMENT INR 2	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	2,36	Indien
15	GODREJ CONSUMER PRO INR 1	Basiskonsumgüter - Haushaltswaren und Körperpflegeprodukte	2,32	Indien

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
 23. September 2022 – 31. Dezember 2022

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

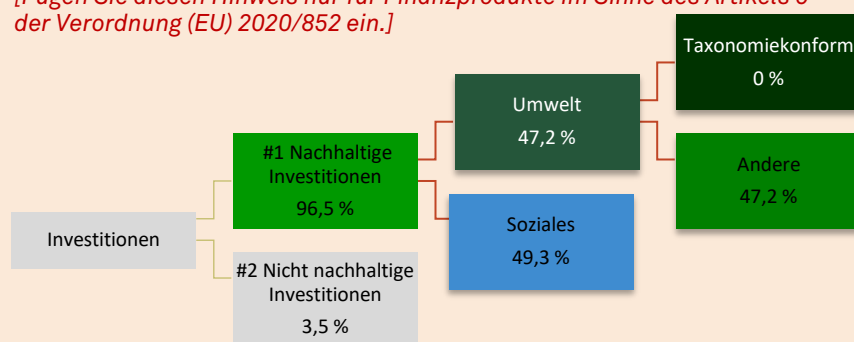


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein. Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.]

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



Bezugszeitraum 23. September 2022 – 31. Dezember 2022
#1 Nachhaltige Investitionen umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
#2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 96,5 % 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 47,2 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel investiert und 49,3 % 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.

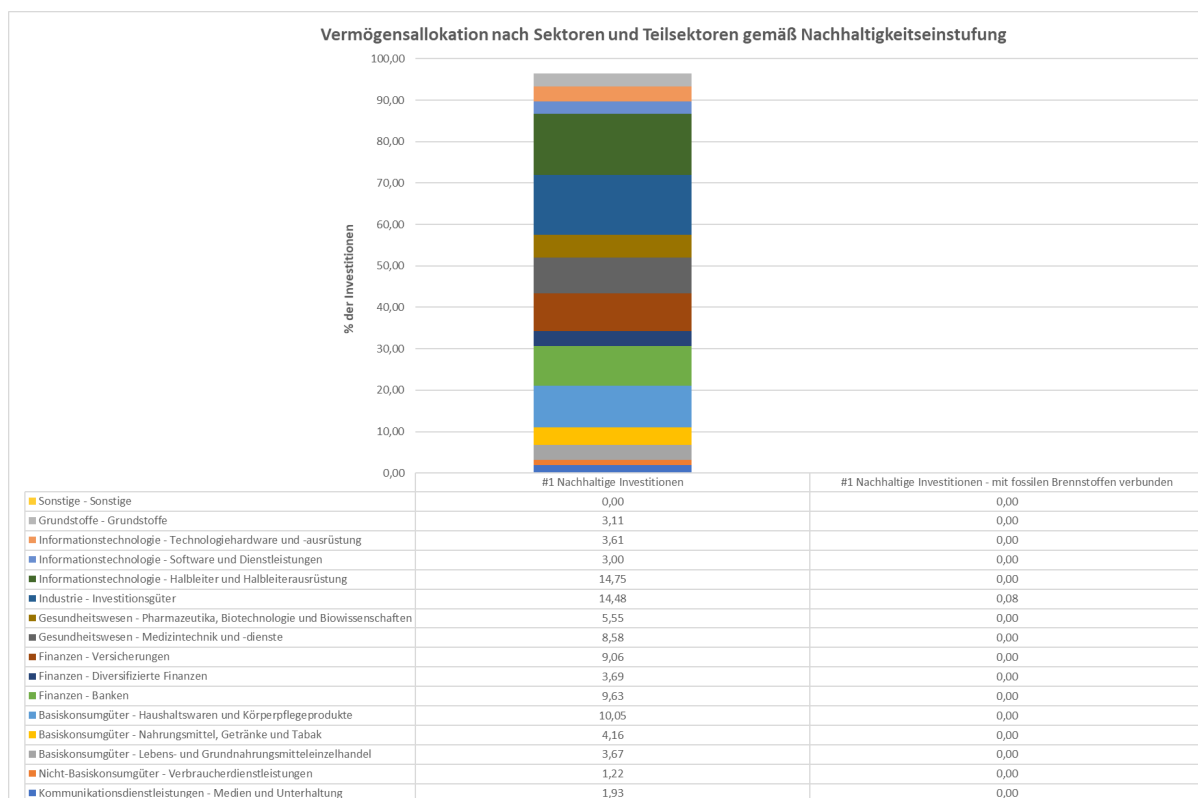
#1 Nachhaltige Investitionen: 96,5 % des Nettoinventarwerts

– Sonstige Umweltziele: 47,2 % des Nettoinventarwerts

– Soziales: 49,3 % des Nettoinventarwerts

#2 Nicht nachhaltige Investitionen: 3,5 % des Nettoinventarwerts

- **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?** *[Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 61 Buchstabe c dieser Verordnung.]*



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht? *[Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 62 dieser Verordnung ein.]*

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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: *[Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*

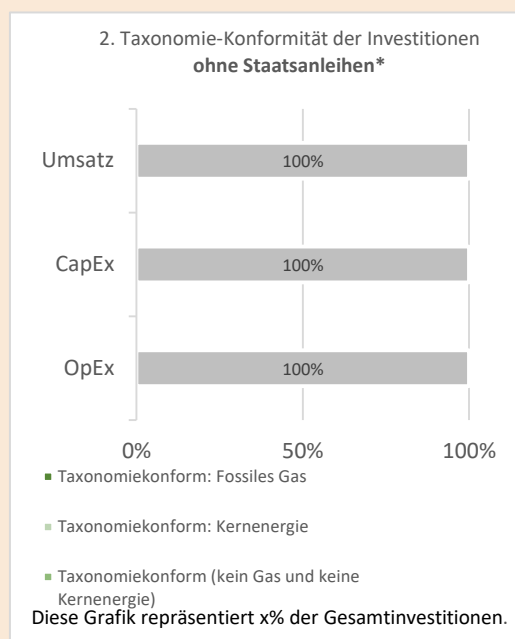
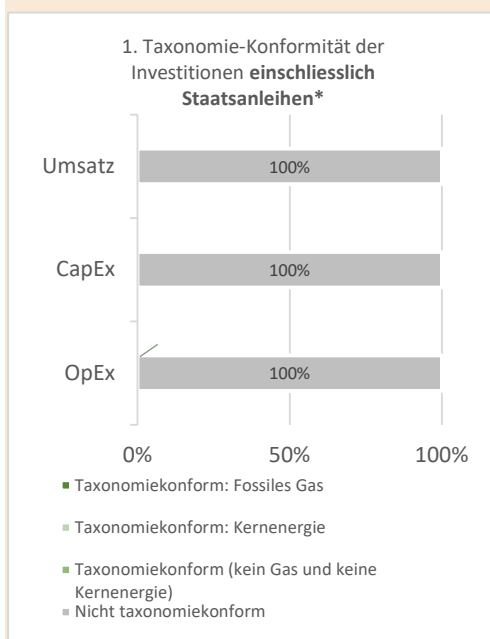
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]
 Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
 - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen 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 Taxonomiekonformität 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* 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-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.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** *[Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]*

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** *[Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde.]*

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden? *[Fügen Sie dies nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu, wenn das Finanzprodukt Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]*

Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu, wenn das Finanzprodukt Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

Der Teilfonds investierte 47,2 % des Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel, durch die in nicht mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten 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? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel umfasst.]*

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 49,3 % 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 3,5 % 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? *[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Finanzprodukts ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der*

Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit dem nachhaltigen Investitionsziel.]

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.

[Fügen Sie diesen Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein.]

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

– 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.

Mitwirkung ist nicht 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 Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten? [Fügen Sie diesen

Abschnitt nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 ein und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes

zu finden ist.]

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

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 2022

Die folgenden Informationen belegen den Beitrag zu Umweltzielen und/oder sozialen Zielen durch die Ausrichtung auf eines oder mehrere der Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs), den die fünf Top-Positionen (nach Gewichtung) des Teilfonds zum Ende des Bezugszeitraums (31. Dezember 2022) leisteten. Diese Angaben sollen den vom Anlageverwalter verfolgten Ansatz für alle Investitionen im Teilfonds veranschaulichen (ausgenommen zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken genutzte Instrumente). Alle Investitionen des Teilfonds sind auf ein oder mehrere UN SDGs ausgerichtet.

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
1	Taiwan Semiconductor Manufact TWD10	5,46	9	Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung und Innovationsförderung	TSMC setzte als erstes Unternehmen automatisierte Fertigung um. 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 initiierte TSMC eine umfassende digitale Transformation. Digitalisierte Fertigungsstätten werden in Betrieb genommen, um den Fertigungsprozess zu transformieren. Mit automatisierter Datenerfassung, Systemassistenten 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.
			7	Sicherstellung von Zugang zu bezahlbarer, zuverlässiger, nachhaltiger und moderner Energie für alle	TSMC ist der führende Anbieter hochleistungsfähiger, energiesparender 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. TSMC ist eines von nur zwei Unternehmen weltweit, die in der Lage sind 3-nm-Wafer zu produzieren. Das ist insofern relevant, als 3-nm-Wafer das 0,64-fache der Fläche der nächstbesten 5-nm-Wafer beanspruchen, eine um 11 % höhere Verarbeitungsgeschwindigkeit pro Wafer aufweisen und den Energieverbrauch (bei gleicher Rechenleistung) für den Kunden um 30 % verringern. Das heisst, obwohl der Produktionsprozess energie- und wasserintensiv ist, hat das resultierende Produkt eine positive Auswirkung auf das

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
					Kundenprodukt.
			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 auch eine Abfallverminderung unter lokalen Zulieferern um 35 % bis 2030 gegenüber dem Stand von 2014 an.
			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.
2	AIA Group Ltd NPV	4,29	3	Sicherstellung einer gesunden Lebensweise und Förderung des Wohlergehens aller Altersgruppen	AIA versucht, Mitgliedern die Vorzüge einer gesunden Lebensweise nahezubringen und sie zu belohnen, wenn sie mehr für ihre Gesundheit tun. AIA fokussiert sich auf Vorsorgeuntersuchungen und fortlaufende Innovationen, um sicherzustellen, dass Kunden stets zur richtigen Zeit die richtigen Leistungen erhalten. AIA Vitality ist ein wissenschaftsgestütztes Wellness-Programm, das auf Teilnehmer einwirkt, damit diese ihre Gesundheit messbar verbessern. 24 % der Mitglieder, die mit einem BMI-Wert im ungesunden Bereich begannen, und 73 % der Mitglieder, deren Blutzuckerwerte eingangs im ungesunden Bereich lagen, haben inzwischen einen Wert im (nach subjektiver Auffassung des Unternehmens) gesunden Bereich erreicht. AIA hat von 2018 bis 2022 im Neugeschäft einen Vitality-integrierten Produktwert von 2,5 Mrd. US\$ generiert. Im Rahmen von AIAs One-Billion-Initiative möchte das Unternehmen erreichen, dass sich bis 2030 eine Milliarde Menschen für ein gesünderes, längeres, besseres Leben engagieren (2022 waren es schon 258 Millionen).
			8	Förderung von dauerhaftem inklusivem und nachhaltigem Wirtschaftswachstum,	AIA ist eine massgebliche Gruppenversicherung, die Unternehmen in der gesamten Region unterstützt und ihre Beschäftigten schützt. Über die Hälfte der asiatischen Erwerbsbevölkerung arbeitet für KMU, weshalb KMU erheblich zur Entwicklung der lokalen Volkswirtschaften beitragen. 2020 schloss AIA über 80.000 KMU-Policen für über 2,3 Millionen Beschäftigte ab. AIA bot KMU-Beschäftigten in bestimmten Märkten kostenlos Versicherungsschutz für COVID-19 an. In anderen Märkten ermöglichte das Unternehmen digitale Dienste wie Fernkonsultationen für Arzttermine.

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
				produktiver Vollbeschäftigung und menschenwürdiger Arbeit für alle	
			11	Macht Städte und Kommunen inklusiv, sicher, widerstandsfähig und nachhaltig	AIA beteiligt sich aktiv an der Finanzierung vieler regionaler Infrastrukturprojekte. Von den insgesamt getätigten Fremd- und Eigenkapitalbeteiligungen (von rund 247,3 Mrd. US\$) entfallen rund 32 Mrd. US\$ auf infrastrukturbezogene Sektoren
3	Shenzhen Inovance Tech Co Ltd 'A' CNY1	3,75	11	Macht Städte und Kommunen inklusiv, sicher, widerstandsfähig und nachhaltig	Shenzhen Inovance produzierte 2004 ursprünglich Niederspannungswechselrichter und weitete sein Produktangebot unter anderem auf Produkte für die Industrieautomation, Industrieroboter für verschiedene Sektoren (OEMs und Endverbraucher), Elektrofahrzeuge (EVs) und Eisenbahntransitverkehr aus. Das Unternehmen liefert massgeschneiderte Servosysteme für Kunden, zu denen Hersteller von Lithiumbatterien ebenso zählen wie Handyfabrikanten und Produzenten von Halbleitern und Industrierobotern. Inovance liefert ferner SaaS/PaaS-Lösungen für seine Kunden, um den Betriebsstatus ihrer Produkte zu überwachen, und hat bereits erhebliche Vorstöße bei Kunden aus den Sparten Aufzüge, Luftkompressoren und Textilien gemacht. Insbesondere für EVs liefert Inovance Wechselrichter und Microgrid-Lösungen für die Photovoltaikindustrie, ebenso wie ein komplettes Angebot an elektronischen und mechanischen Epowertrain-Bauteilen, darunter Wechselrichter und Motoren für EVs, Gleichspannungswandler und E-Achsen für EVs und ICEs. 2021 verfügte Shenzhen Inovance über 12.000 Industrieroboter, aufgeteilt auf Scarra und 6-Joint, und wollte bis Ende 2022 15.000 erreicht haben.
			9	Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung und	Inovance investiert 10 % seines Umsatzes in Forschung und Entwicklung und beschäftigt 800 Ingenieure mit Schwerpunkt auf den folgenden drei Bereichen: Kerntechnologien, Produktentwicklung und industrielle Anwendungen. Das Unternehmen setzt einen einzigartig kompromisslosen technischen Prozess ein, der fortschrittliche Designmodellierung, Leistungsanalyse und Qualitätssicherungsmethoden einbezieht. Das Produktportfolio von Inovance deckt das Spektrum der zentralen Komponenten für Industrieroboter sowie verschiedene integrierte Lösungen ab.

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
				Innovationsförderung	
4	Bank Rakyat Indonesia IDR50	3,25	8	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. Per 2022 hat die Bank Rakyat Kredite an 14,4 Millionen Mikrokreditnehmer vergeben, von denen 10,9 Millionen ihre Kreditanträge über das staatlich geförderte KUR-Programm gestellt haben. Über dieses KUR-Programm können Kreditnehmer Zugang zu Krediten zu einem (für informelle Kreditnehmer – ganz besonders in Schwellenländern mit entsprechend höheren Staatsanleiherenditen – extrem niedrigen) effektiven Jahreszins von nur 6 % erhalten. Der Gesamtsaldo an Mikrokrediten für 2022 betrug 449,6 Bio. Rp. Davon entfielen 251,5 Bio. Rp auf das KUR-Programm. Spektrum und Breite der Infrastruktur der Bank Rakyat machen sie zum zentralen Lösungsanbieter für das Vorantreiben der Finanzinklusion in Indonesien.
			4	Sicherstellung inklusiver und gleichberechtigter hochwertiger Ausbildung und Förderung von Chancen für lebenslanges Lernen für alle	Das Mikrogeschäft (Micro Business) stellt die Unterstützung für staatliche Programme zur Förderung von Finanzkompetenz, finanzieller Inklusion oder eigenverantwortlichem wirtschaftlichem Handeln von Menschen aus Kommunen in benachteiligten Regionen, Grenzregionen und Regionen in äusserster Randlage dar. Um Finanzkompetenz und -inklusion zu steigern, vermarktet das BRI Micro Business seine Basiskontoprodukte aus dem Programm Basic Service Account (BSA), nämlich Tabunganku und SimPel (Sparangebote für Studenten).
			9	Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung	Durch kleine und mittlere Finanzierungen beteiligte sich die BRI an der Förderung staatlicher Programme, insbesondere an der Steigerung der Zahl von Unternehmen und der Erweiterung des Zugangs für Kleinunternehmer, Einzelhändler und mittelgrosse Unternehmen zur Deckung zusätzlichen Risikokapitalbedarfs, zur Bekämpfung der Armut, zur Steigerung der Beschäftigung und zum Abbau der Arbeitslosigkeit. 2020 umfasste die Infrastrukturfinanzierung in Höhe von 36,483 Mrd. Rp unter anderem mehrere Teilsektoren, die nachhaltigem Wachstum Vorschub leisten. Zum Stand von 2020 zahlte die BRI erfolgreich KUR-Kredite in Höhe von 138,5 Bio. Rp an über 6 Millionen Mikro-, Klein- und Mittelstandsunternehmen aus – 57 % mehr als 2019.

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
				rung und Innovationsförderung	
5	WEG SA Com Stk NPV	3,00	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.
			9	Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur, Unterstützung einer inklusiven und nachhaltigen Industrialisierung und Innovationsförderung	Bei den weltweit verkauften Motoren handelt es sich nach wie vor um Motoren mit niedrigem Wirkungsgrad (über 70 % der weltweit vertriebenen Motoren entfallen auf die Wirkungsgradklassen IE1 oder IE2). Der Grossteil des Umsatzes von WEG stammt aus weit energieeffizienteren Produkten – zu über 50 % aus in den letzten drei Jahren auf den Markt gebrachten Produkten der Klasse IE3 und besser. 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. Das Unternehmen betreibt weltweit mehr als 108 Forschungs-/Testlabore. 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.
			12	Gewährleistung nachhaltiger Konsum- und	WEG will an Prozessen arbeiten, die Auswirkungen auf die Umwelt verringern, indem es Aktivitäten auf Präventivmassnahmen zum Umweltschutz – wie den Erhalt natürlicher Ressourcen und das Management von Emissionen und Abfallaufkommen –, auf Investitionen in Technologien und auf die laufende Prozessoptimierung

#	Bestand	Gewichtung zum 31. Dez. 2022 (%)	Ausrichtung auf SDG Nr.	Beschreibung des SDG	Inwiefern war dieses Unternehmen auf das SDG ausgerichtet?
				Produktionsmuster	durch Festlegung von Zielen und Unterzielen stützt. WEG verfügt über ein Programm für Qualität und Produktivität (Quality and Productivity Program, WQPP), das ein Umweltprogramm (Environmental Program, EP) einschliesst, mit dem der Verbrauch von Rohstoffen und Produktionsfaktoren optimiert, Prozesse und Produkte entwickelt werden sollen, die weniger umweltschädlich sind, und Wasser- und Abwasserwirtschaftsprozesse verbessert werden sollen. WEG nutzt Kaizen-Implementierungsprogramme, um Umweltvorteile zu steigern, und verzeichnet infolgedessen bei Wasserverbrauch, Stromverbrauch und Festabfallaufkommen im Verhältnis zum Nettobetriebsergebnis seit 2018 stetige Rückgänge.
			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.

ANHANG IV

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?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

Ja

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: ____%

Nein

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es **52,3 %** 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 **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt? [Führen Sie die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale an. Für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte in Bezug auf nachhaltige Investitionen mit Umweltzielen führen Sie die in Artikel 9 dieser Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Anlage beigetragen hat. Für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen mit sozialen Zielen getätigt wurden, führen Sie bitte die sozialen Ziele an.]

Die mit dem Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Bezugszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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 Nachhaltigkeitsindikatoren haben folgendermassen abgeschnitten:

Indikator Nr.	Wie hat der Indikator im Bezugszeitraum abgeschnitten?
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 1	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 2	0 %
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 3	Mittel
Nachhaltigkeitsindikator Nr. 4	100 % der Investitionen (ohne die zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehaltenen)

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 1 und Nr. 2 lag bei 96,75 % der Investitionen des Teilfonds (ausgenommen FDI, Barmittel und Barmitteln gleichgestellte Mittel).

Die Datenabdeckung für die Nachhaltigkeitsindikatoren Nr. 3 lag bei 91 % 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.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?** *[bei Finanzprodukten hinzufügen, bei denen mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

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?** *[Beschreiben Sie die Ziele für Finanzprodukte, mit denen nachhaltige Investitionen getätigt wurden, sofern diese nicht in der Antwort auf die vorstehende Frage enthalten sind. Beschreiben Sie, wie die nachhaltigen Investitionen zum nachhaltigen Investitionsziel beigetragen haben. Listen Sie für die in Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte die in Artikel 9 der Verordnung genannten Umweltziele auf, zu denen die dem Finanzprodukt zugrunde liegende nachhaltige Investition beigetragen hat.]*

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 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

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.

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? [Fügen Sie dies bei Finanzprodukten hinzu, die nachhaltige Investitionen enthalten.]

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 Drittdatenanbieter. 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
- — — — *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

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 zusammengenommen 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.

[Fügen Sie eine Erklärung für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu.]

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?

[Abschnitt hinzufügen, wenn bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt wurden]

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 dritten 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 2022 – 31. Dezember 2022**

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	US TR FRN 10/31/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	6,73	USA
2	ITALY 0% 11/29/22	Staatsanleihen - Staatsanleihen	4,95	Italien
3	BUNDES 0.5% 02/15/25	Staatsanleihen - Staatsanleihen	4,32	Deutschland
4	BR ICS-EURO LIQ-G ACC T0	Sonstige - Sonstige	3,93	Irland
5	ITALY 0.3% 08/15/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	3,17	Italien
6	INVECO PHYSICAL GOLD ETC	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	2,75	Vereinigtes Königreich
7	ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	2,74	Vereinigtes Königreich
8	ML PNT(BAEICTUS&BAEICRVC)	Finanzen - Banken	2,68	USA
9	ITALY 0.95% 03/01/23	Staatsanleihen - Staatsanleihen	2,27	Italien
10	N ZEAL 0.5% 05/15/24	Finanzen - Banken	2,21	Neuseeland
11	BARCLAYS BAN WTS 11/13/22	Sonstige - Sonstige	2,19	Vereinigtes Königreich
12	AUSTRA 2.75% 04/21/24	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,97	Australien
13	US TSY 3.25% 05/15/42	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,91	USA
14	AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC	Finanzen - Diversifizierte Finanzen	1,78	Niederlande
15	MEXICO 7.75% 05/29/31	Staatsanleihen - Staatsanleihen	1,77	Mexiko



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

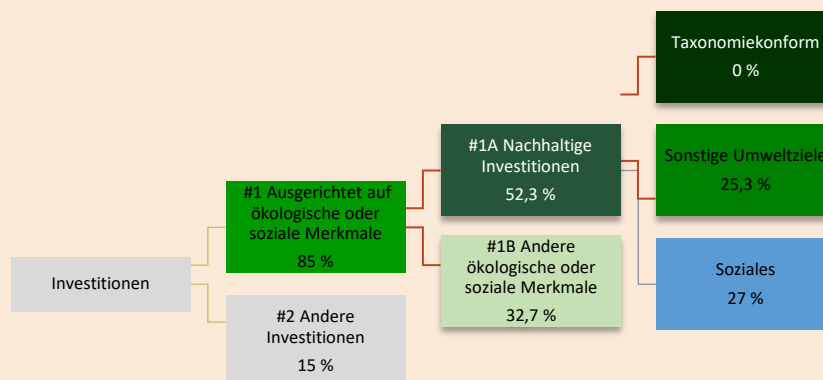
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]



Bezugszeitraum 1. Januar 2022 – 31. Dezember 2022

#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.

[Fügen Sie den nachstehenden Hinweis ein, wenn mit dem Finanzprodukt nachhaltigen Investitionen getätigt wurden.]

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.

Das Diagramm zur Vermögensallokation veranschaulicht die Vermögensaufteilung dieses Teilfonds. 85 % 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 52,3 % des Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR.

Davon hatten 25,3 % ein nicht mit der EU-Taxonomie konformes Umweltziel und 27 % 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: 85 % des Nettoinventarwerts

#1A Nachhaltige Investitionen: 52,3 % des Nettoinventarwerts

- Taxonomiekonform: 0 % des Nettoinventarwerts
- Umwelt: 25,3 % des Nettoinventarwerts
- Soziales: 27 % des Nettoinventarwerts

#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale: 32 % des Nettoinventarwerts

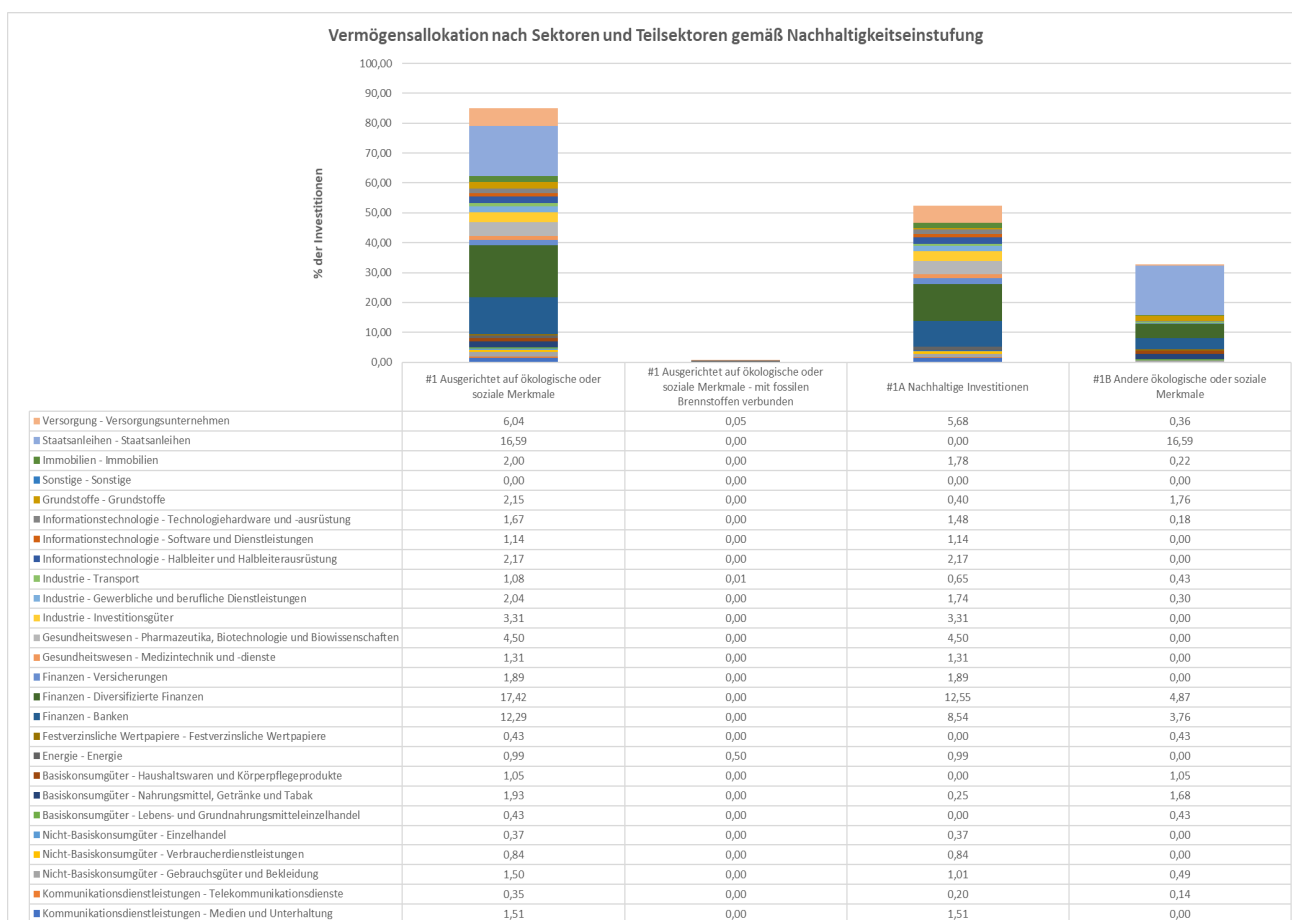
#2 Andere Investitionen: 15 % des Nettoinventarwerts

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt? [Bitte machen Sie Angaben gemäss Artikel 54 dieser Verordnung.]



[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform? *[Fügen Sie diesen Abschnitt für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 sowie Informationen gemäss Artikel 51 dieser Verordnung ein.]*

Nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit Umweltzielen waren nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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 Kernenergie¹ investiert?**

Ja *Bitte unten spezifizieren, und Einzelheiten in den Grafiken im Kasten.]*

In fossiles Gas Kernenergie

✘ Nein

[Fügen Sie den Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind.]

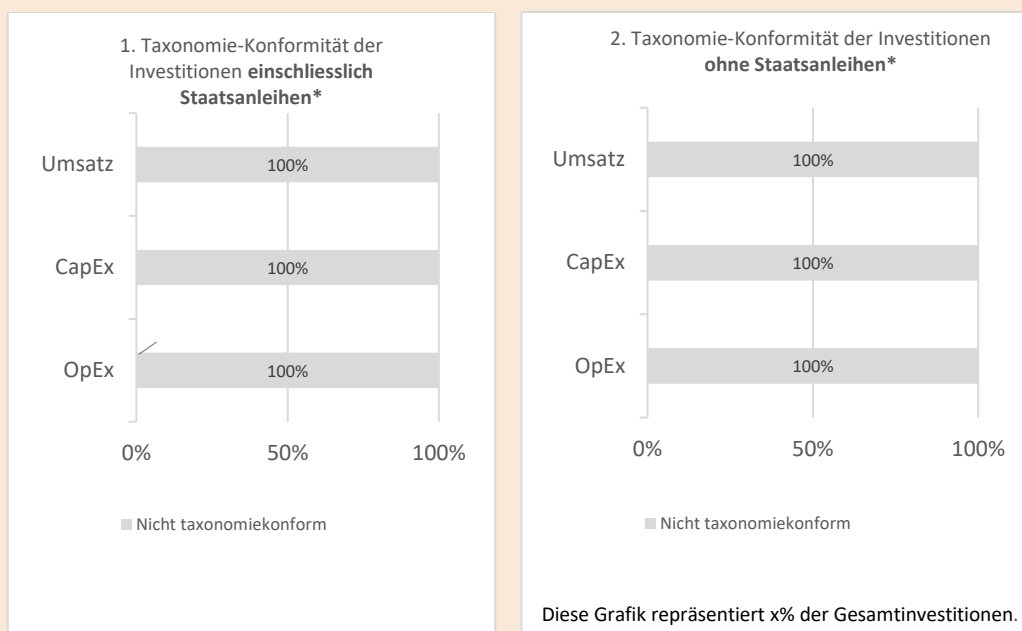


sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**

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.

In den nachstehenden Diagrammen 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.*

[Geben Sie Informationen zu taxonomiekonformen Investitionen in fossiles Gas und/oder Kernenergie und die Erläuterung am linken Rand auf der vorherigen Seite nur dann an, wenn im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt in taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert wurde.]



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?** *[Fügen Sie eine Aufschlüsselung der Anteile der Investitionen während des Bezugszeitraums hinzu.]*

0,00 %

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?** *[Hinzufügen, wenn mindestens ein früherer regelmässiger Bericht vorgelegt wurde]*

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.

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. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglicht 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 Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

[Fügen Sie diesen Abschnitt nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel enthielt, durch die in Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde, die keine ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten sind, und erklären Sie, warum mit dem Finanzprodukt in nicht taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wurde.]

Der Teilfonds investierte 25,3 % seines Nettoinventarwerts in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel.

Der Teilfonds investierte in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel, durch die in nicht mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten investiert wird, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Gegenwärtig sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten begrenzt und variieren je nach Unternehmen, in die investiert wird.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? *[Fügen Sie diesen Abschnitt nur ein, wenn das Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel enthalten hat.]*

Der Teilfonds ist zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in sozial nachhaltige Investitionen zu investieren, investierte aber 27 % 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 15 % 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?

[Führen Sie die Massnahmen auf, die im Berichtszeitraum zur Erfüllung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ergriffen wurden, einschliesslich der Mitwirkung der Aktionäre gemäss Artikel 3g der Richtlinie 2007/36/EG und sonstiger Massnahmen im Zusammenhang mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen.]

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.

Mitwirkung ist nicht 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.

[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]

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 bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

[Fügen Sie den Abschnitt ein, wenn ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde, und geben Sie an, wo die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes zu finden ist.]

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

ANHANG IV

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

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 oder soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31 % 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 **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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 eine Auflistung von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst eine Auflistung der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



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 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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 2022 insgesamt 83 % 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
- 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 2022 31 % seines Nettoinventarwerts in Use-of-Proceeds Impact Bonds und Impact Issuers investiert, die jeweils als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR eingestuft werden.

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

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.

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.

● **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 2022 insgesamt 31 % 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 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 Bonds, 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 1,8 gegenüber einem Wert des Referenzwerts von 1,9 (wobei 1 = am besten, 5 = am schlechtesten ist).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Kohlenstoffintensität:** Die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Teilfonds war erfolgreich und beständig um mindestens 25 % niedriger als die vermögensgewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Referenzwerts wie nachstehend dargelegt:

Kohlenstoffintensität Scope 1 und 2	(Vermögens)gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Tonnen/Mio. USD Umsatz)	
	Fonds	Index
Erfassung (gemeldet/geschätzt) (%)	65	122
Renormiert	94 (82/12)	97 (88/9)
	69	126

- **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 ausgegebene 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 nach Massgabe des Anlageverwalters nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigt?

Vom Beginn des Bezugszeitraums am 1. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 stellte der Anlageverwalter folgendermassen sicher, dass die nach Massgabe des Anlageverwalters nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigten:

- **Use-of-Proceeds Impact Bonds** – für einen jeden Use-of-Proceeds Impact Bond wurde festgestellt, dass kein Verstoss gegen den Bewertungsrahmen des Anlageverwalters vorlag, der eine Analyse zur „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ einbezog. Dazu gehörte eine Analyse des Nachhaltigkeitsprofils des Emittenten sowie eine Überprüfung, ob Prozesse vorhanden waren, um im Zusammenhang mit Use-of-Proceeds Impact Bonds bestehende Risiken im ESG-Bereich zu erkennen, zu steuern und zu mindern.
- **Impact Issuers** – Impact Issuers wurden auf der Grundlage der jeweils verfügbaren Daten, die vom Anlageverwalter erfasst und analysiert wurden, um eine schlechte Ausrichtung auf die UN SDGs zu ermitteln, vom Anlageverwalter nicht als sehr schlecht auf die UN SDGs ausgerichtet („strongly misaligned“) eingestuft.

Im Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 stützte sich die Analyse der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durch den Anlageverwalter auf die Verfügbarkeit von Informationen und Daten. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt.

Vom 1. August 2022 bis zum Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds am 31. Dezember 2022 beeinträchtigten die Investitionen des Teilfonds, bei denen es sich nach Massgabe des Anlageverwalters um nachhaltige Investitionen gemäss SFDR handelte, ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele des Teilfonds nicht erheblich, da sie die vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte nicht verletzen.

— — — *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Vom Beginn des Bezugszeitraums am 1. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 wurden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen zum Beispiel berücksichtigt durch:

- Ausschlusslisten für umstrittene Waffen, gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen verstossende Emittenten, Abbau und Verstromung von Kohle
- Eine Grenze für die Kohlenstoffintensität und eine CO₂-Ausrichtung.

Vom 1. August 2022 bis zum Geschäftsjahresende des Teilfonds am 31. Dezember 2022 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 gemäss SFDR des Teilfonds 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.

Vom 1. August 2022 bis zum Geschäftsjahresende des Teilfonds am 31. Dezember 2022 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 stellte die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, im vorstehenden Zeitraum zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend den PAI-Schwellenwerten gegenüber, 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 dritten 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? Nähere Angaben:

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 zusammengenommen 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, sowie die 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 stellte die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, im vorstehenden Zeitraum zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend diesen Schwellenwerten gegenüber, und zwar anhand von Daten, die vom bestimmten externen Datenanbieter des Anlageverwalters bezogen wurden.

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten 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 15 Top-Investitionen des Teilfonds sind danach ausgewählt worden, welche Investitionen den grössten Anteil an den Gesamtinvestitionen des Teilfonds im Bezugszeitraum ausmachen, berechnet als Durchschnitt im Dreimonatsturnus seit Beginn des Bezugszeitraums, sodass daraus die Repräsentation der 15 Top-Investitionen des Teilfonds im Bezugszeitraum möglichst genau hervorgeht.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
1. Januar 2022 bis
31. Dezember 2022

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	Goldman S VAR 04/30/24	Finanzen - Banken	0,66	USA
2	BPCE SA 0.375% 02/02/26	Finanzen - Banken	0,60	Frankreich
3	Enel Fina 0.25% 11/17/25	Versorgung	0,56	Italien
4	UBS GROUP 1.5% 11/30/24	Finanzen - Banken	0,56	Schweiz
5	Banque Fe VAR 06/16/32	Finanzen - Banken	0,54	Frankreich
6	Blackston 1% 05/04/28	Finanzen - Sonstige	0,54	Luxemburg
7	CREDIT SU VAR 04/02/26	Finanzen - Banken	0,54	Schweiz
8	Comcast C 0% 09/14/26	Telekommunikation	0,51	USA
9	Banco San VAR 01/26/25	Finanzen - Banken	0,49	Spanien
10	CaixaBank 0.375% 02/03/25	Finanzen - Banken	0,48	Spanien
11	Abanca Co VAR 09/08/27	Finanzen - Banken	0,47	Spanien
12	AT&T INC 3.15% 09/04/36	Telekommunikation	0,46	USA
13	ING GROEP 1% 09/20/23	Finanzen - Banken	0,45	Niederlande
14	Allianz S VAR 09/18/71	Finanzen - Versicherungen	0,45	Deutschland
15	Morgan St VAR 05/07/32	Finanzen - Banken	0,44	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?



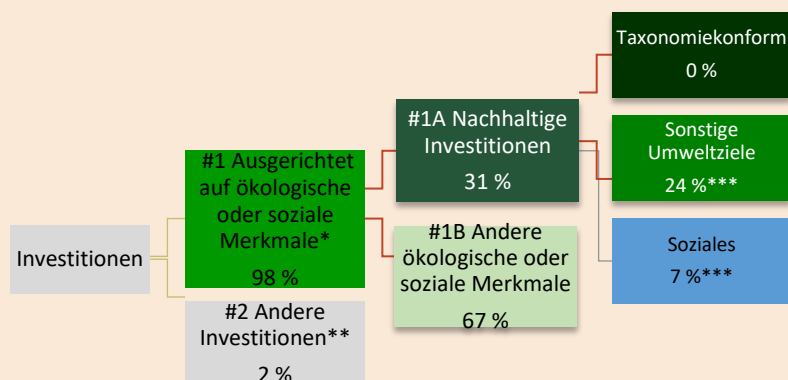
● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

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 nachstehenden Diagramm angegeben dem Stand vom 31. Dezember 2022 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten 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.

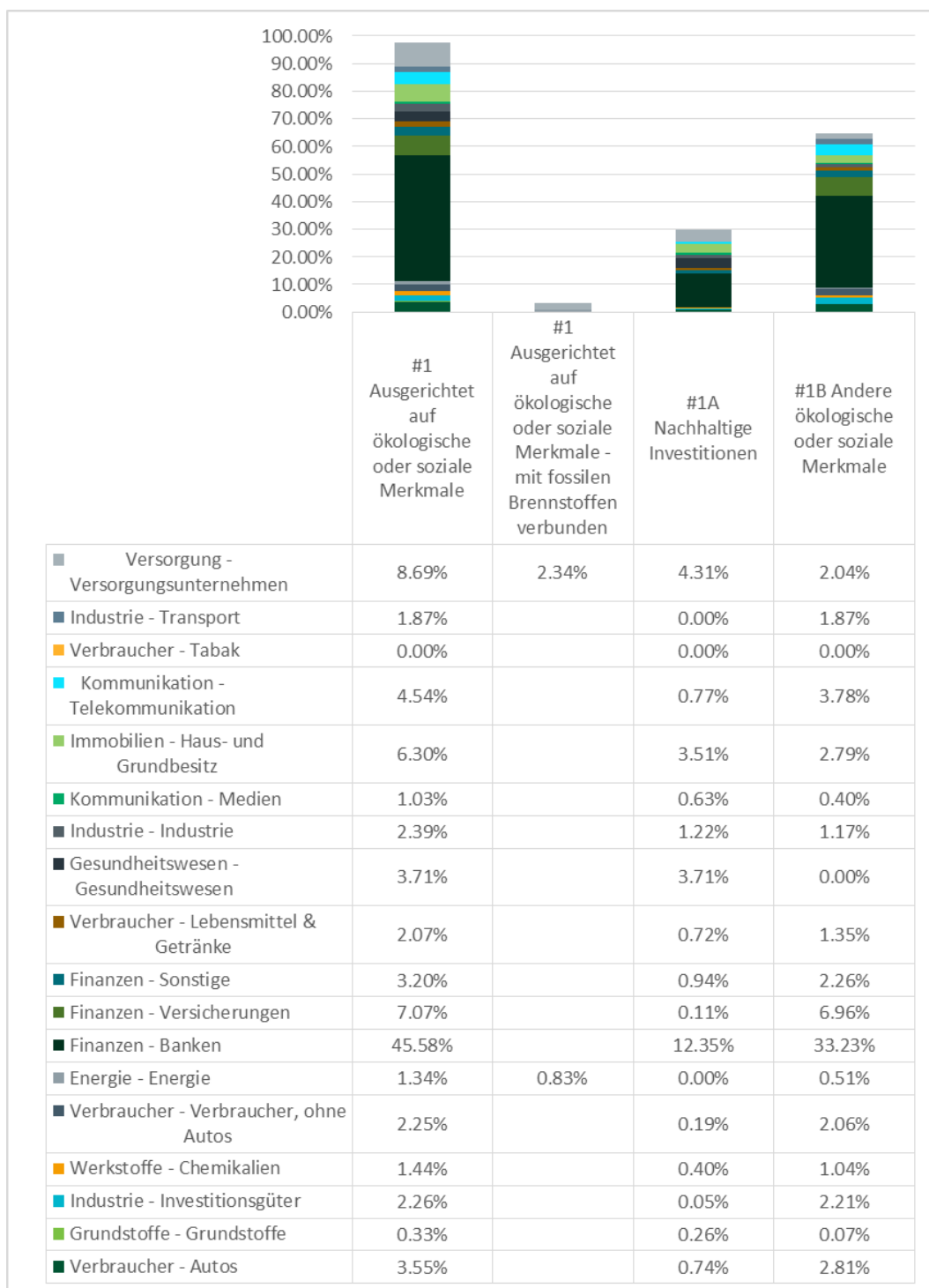
* Der Anlageverwalter war auf Informationen und Daten von dritten Datenanbietern angewiesen, um die Ausrichtung auf manche ökologische oder soziale Merkmale berücksichtigen zu können. Insbesondere die fehlende oder unvollständige Berichterstattung einiger Investitionen zu Kennzahlen hatte zur Folge, 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 2022 trugen 7 % 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 2022 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Finanzen - Banken und Versorgung engagiert sowie in den Sektoren Finanzen - Versicherungen und Immobilien, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. 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 %

Die vom Teilfonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren im Bezugszeitraum nicht EU-taxonomeikonform.

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 investiert¹?**

Ja:

In fossilem Gas

In Kernenergie

Nein

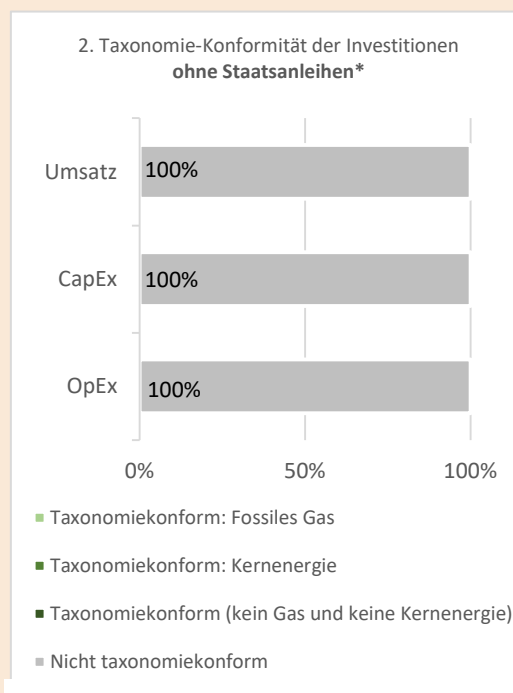
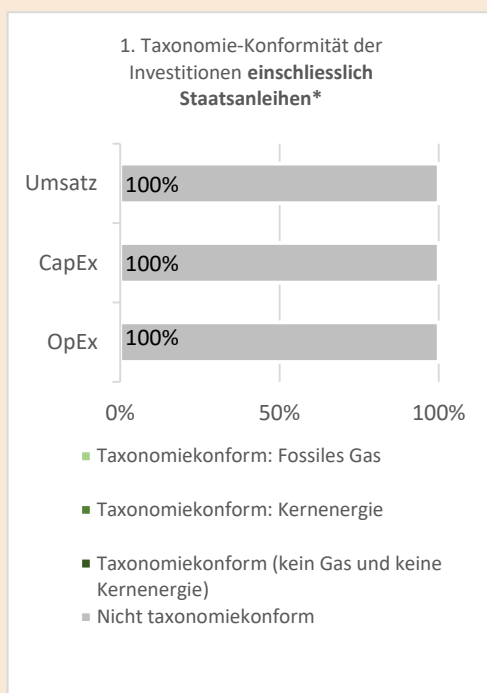
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

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. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement. **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.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen 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.*



Diese Grafik repräsentiert x% der Gesamtinvestitionen.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

- **h war 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?

100 % der nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2022 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomeikonform waren, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Zum Datum dieses Anhangs sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten 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 zum 31. Dezember 2022 7 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel. .

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. 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.
 - 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?

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.

ANHANG V

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 84 %

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: 9 %

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% 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 **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, 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 enthält keine Liste sozial nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

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 schuldtitlebezogenen Wertpapieren sowie in darauf bezogene FDI investiert.

Das nachhaltige Investitionsziel des Teilfonds wurde im Bezugszeitraum von der Auflegung des Teilfonds am 10. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (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

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
- 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
 - 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):
 - Geschlechtergleichheit
 - Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
 - Weniger Ungleichheiten

Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum nicht in Improving Issuers (wie in Anhang III zur SFDR beschrieben).

Die diesem Teilfonds zugrunde liegenden nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR trugen nicht zu den in Artikel 9 der EU-Taxonomie-Verordnung genannten Umweltzielen bei.

● **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 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).
- 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;
 - (b) im Falle eines jeden solchen Use-of-Proceeds Impact Bonds, 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 Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung beitrugen.

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?**

Der Teilfonds wurde am 10. Januar 2022 aufgelegt. Im Zeitraum vom 10. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 stellte der Anlageverwalter folgendermassen sicher, dass die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR bestimmten Investitionen die Umweltziele oder sozialen Ziele nicht erheblich beeinträchtigten:

- **Use-of-Proceeds Impact Bonds** – für einen jeden Use-of-Proceeds Impact Bond wurde festgestellt, dass kein Verstoss gegen den Bewertungsrahmen des Anlageverwalters vorlag, der eine Analyse zur

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

„Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ einbezog. Dazu gehörte eine Analyse des Nachhaltigkeitsprofils des Emittenten sowie eine Überprüfung, ob Prozesse vorhanden waren, um im Zusammenhang mit Use-of-Proceeds Impact Bonds bestehende Risiken im ESG-Bereich zu erkennen, zu steuern und zu mindern

- **Impact Issuers** – Impact Issuers wurden auf der Grundlage der jeweils verfügbaren Daten, die vom Anlageverwalter erfasst und analysiert wurden, um eine schlechte Ausrichtung auf die UN SDGs zu ermitteln, vom Anlageverwalter nicht als sehr schlecht auf die UN SDGs ausgerichtet („strongly misaligned“) eingestuft.

Im Zeitraum vom 10. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 stützte sich die Analyse der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durch den Anlageverwalter auf die Verfügbarkeit von Informationen und Daten. Wenn solche Informationen nicht verfügbar oder unvollständig waren, war die Analyse der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durch den Anlageverwalter unvermeidlich eingeschränkt.

Vom 1. August 2022 bis zum Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds am 31. Dezember 2022 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?

Der Teilfonds wurde am 10. Januar 2022 aufgelegt. Im Zeitraum vom 10. Januar 2022 bis zum 31. Juli 2022 wurden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen zum Beispiel berücksichtigt durch:

- Ausschlusslisten für umstrittene Waffen, gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen verstossende Emittenten, Abbau und Verstromung von Kohle
- Eine Grenze für die Kohlenstoffintensität und eine CO₂-Ausrichtung. .

Vom 1. August 2022 bis zum Geschäftsjahresende des Teilfonds am 31. Dezember 2022 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

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.

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).

Vom 1. August 2022 bis zum Geschäftsjahresende des Teilfonds am 31. Dezember 2022 berücksichtigte der Teilfonds die vorstehenden PAIs im Hinblick auf seine nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR folgendermassen:

- 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, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR erachtet wurden.
- Der Anlageverwalter stellte die Wertentwicklung des Emittenten und/oder des Teilfonds, wie jeweils zutreffend, im vorstehenden Zeitraum zum Zeitpunkt der Investition und fortlaufend den PAI-Schwellenwerten gegenüber, 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 dritten 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? Nähere Angaben:

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 zusammengenommen 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.

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 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. Unzureichende Massnahmen bei Verstössen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Es wurden keine dieser vom Anlageverwalter festgelegten PAI-Schwellenwerte verletzt.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 Top-Investitionen des Teilfonds sind danach ausgewählt worden, welche Investitionen den grössten Anteil an den Gesamtinvestitionen des Teilfonds im Bezugszeitraum ausmachen, berechnet als Durchschnitt an jedem Quartalsende im Bezugszeitraum, sodass daraus die Repräsentation der 15 Top-Investitionen des Teilfonds im Bezugszeitraum möglichst genau hervorgeht.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 10. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022.

#	Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
1	BUNDES 0% 08/15/31	Staatlich / Supranational	2,63	Deutschland
2	Mitsubish 0.978% 06/09/24	Finanzen - Banken	2,19	k. A.
3	BANCO BIL 0.75% 06/04/25	Finanzen - Banken	2,08	Spanien
4	HSBC HOLD VAR 12/04/24	Finanzen - Banken	2,06	Vereinigtes Königreich
5	Enel Fina 1.125% 09/16/26	Versorgung	2,04	Italien
6	Engie SA VAR 11/30/71	Versorgung	1,83	Frankreich
7	Snam SpA 1.25% 08/28/25	Versorgung	1,82	k. A.
8	Abanca Co VAR 09/08/27	Finanzen - Banken	1,79	Spanien
9	COMMERZBA VAR 03/24/26	Finanzen - Banken	1,77	Deutschland
10	Credit Su 0.45% 05/19/25	Finanzen - Banken	1,58	Frankreich
11	Vonovia S 0.625% 03/24/31	Immobilien	1,55	Frankreich
12	LeasePlan 0.25% 09/07/26	Finanzen - Sonstige	1,50	USA
13	Unibail-R 0.625% 05/04/27	Immobilien	1,49	Irland
14	Bankinter 0.625% 10/06/27	Finanzen - Banken	1,48	Irland
15	SSE PLC 1.375% 09/04/27	Versorgung	1,48	Irland

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?



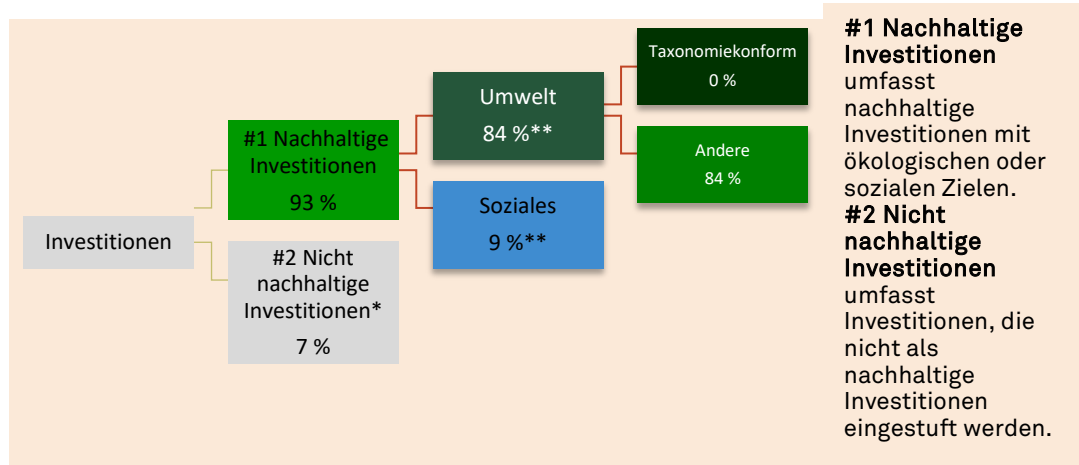
● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Mit dem Teilfonds wurden nachhaltige Investitionen angestrebt und er war verpflichtet, mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel und/oder sozialen Ziel zu investieren.

Zum 31. Dezember 2022 waren beispielsweise 93 % 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 2022 entsprechen und daraus nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervorgeht (die wesentlich höher oder niedriger ausfallen kann).

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

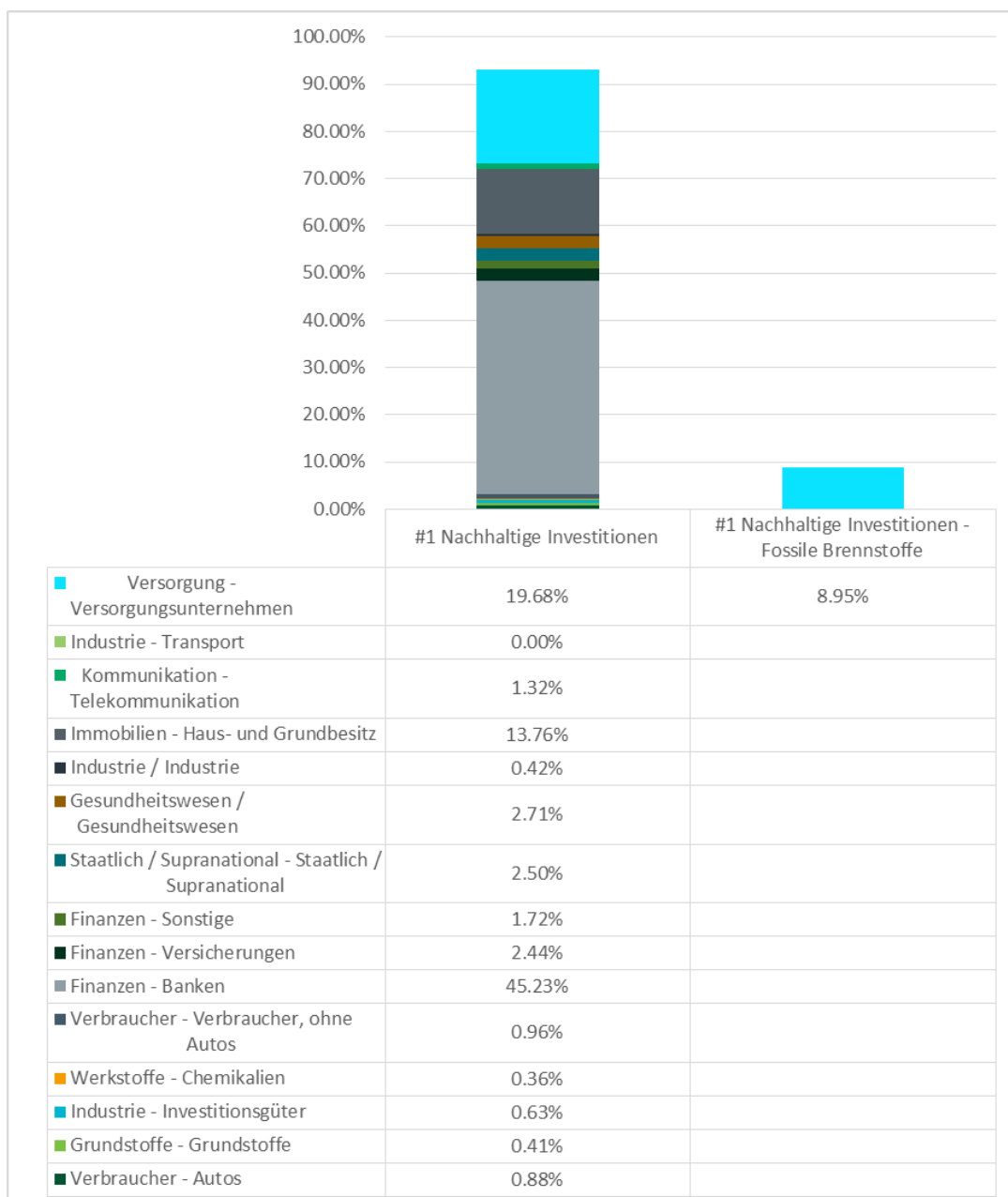


* #2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen gemäss SFDR eingestuft sind, d. h. Barmittel, Derivate (FDI) zu Absicherungszwecken und Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) zu Liquiditätszwecken. Weitere Einzelheiten sind der nachstehenden Frage „**Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**“ zu entnehmen.

** Zum 31. Dezember 2022 trugen 8 % 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.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Zum 31. Dezember 2022 war der Teilfonds überwiegend in den Sektoren Finanzen - Banken und Versorgung engagiert sowie in den Sektoren Immobilien und Gesundheitswesen, wie nachstehend dargestellt.



Die vorstehenden Zahlen entsprechen ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

0 %

Die vom Teilfonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren im Bezugszeitraum nicht mit der EU-Taxonomie konform.

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 Kernenergie investiert¹?

Ja:

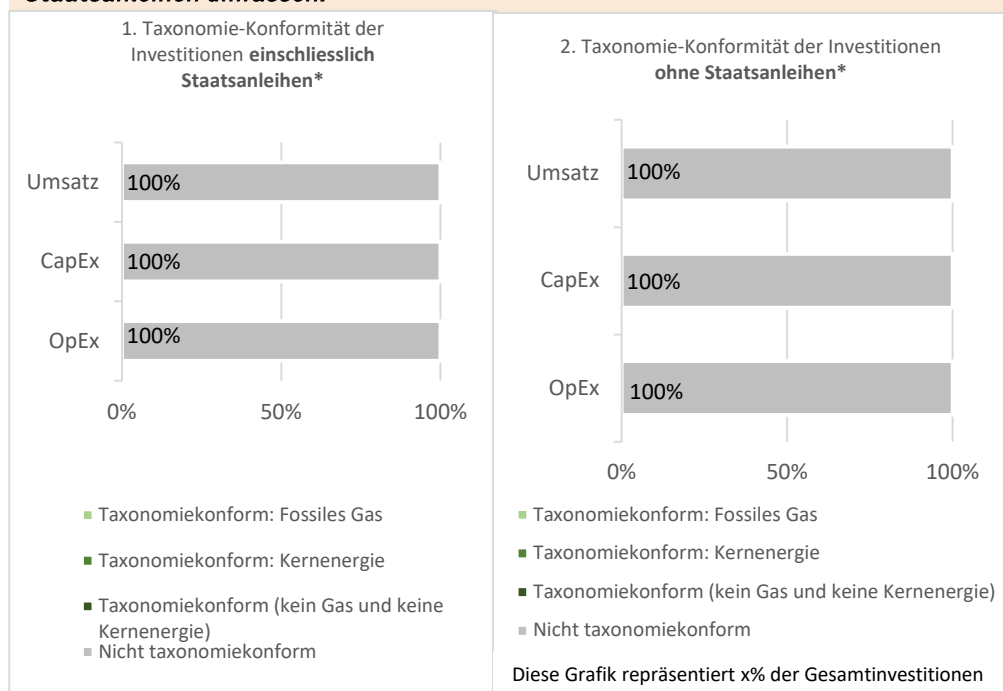
In fossilem Gas

In Kernenergie

Nein

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 EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.


In den nachstehenden Grafiken ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.

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. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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.

 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 Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

0 %

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Zum Datum dieses regelmässigen Berichts liegt kein Vergleich mit vergangenen Zeiträumen vor.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

100 % der nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel waren zum 31. Dezember 2022 nicht mit der EU-Taxonomie konform.

Der Teilfonds investierte mit nachhaltigen Investitionen gemäss SFDR mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nicht EU-taxonomeikonform waren, da der Nachweis der Taxonomie-Konformität von der Verfügbarkeit genauer, detaillierter und vollständiger Daten über die Unternehmen abhängt, in die der Teilfonds investiert. Zum Datum dieses Anhangs sind solche Informationen nicht notwendigerweise ohne Weiteres aus den öffentlichen Bekanntmachungen besagter Unternehmen verfügbar. Die Verfügbarkeit von Daten verbessert sich zwar und dürfte dies ebenfalls im Laufe der Zeit, doch sind die derzeit verfügbaren Daten 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 zum 31. Dezember 2022 9 %* seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen gemäss SFDR mit einem sozialen Ziel.

*Dieser angegebene Prozentsatz entspricht ausschliesslich dem Stand vom 31. Dezember 2022. Daraus geht nicht unbedingt die Position zu anderen Zeitpunkten im Bezugszeitraum hervor.



Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab 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 Anleiheemission 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 Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- *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.

VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM
FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE-VERORDNUNG (UNGEPRÜFT) Forts.

Zum 31. Dezember 2022 sind der BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Absolute Return Equity 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 Corporate Debt 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 Future Food Fund, der BNY Mellon Future Life Fund, der BNY Mellon Global Bond Fund, der BNY Mellon Global Credit Fund, der BNY Mellon Dynamic Bond Fund, der BNY Mellon Global Emerging Markets Opportunities Fund, der BNY Mellon Global Equity Fund, der BNY Mellon Global Equity Income 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 Short-Dated High Yield Bond Fund, 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, der BNY Mellon U.S. Equity Income Fund und der BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund als Artikel-6-Teilfonds eingestuft.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN

EINGETRAGENER SITZ

One Dockland Central, Guild Street
IFSC, Dublin 1, D01E4XO
Irland

DIE MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind:

David Dillon (Ire)[^]
Gerald Rehn (US-Amerikaner) (zurückgetreten am 8. Februar 2023)
Greg Brisk (Brite)
Claire Cawley (Irin)[^]
Caylie Stallard (Neuseeländerin) (bestellt am 8. Juni 2022)
Mark Flaherty (Ire) (bestellt am 22. Juli 2022)
Sarah Cox (Britin) (bestellt am 9. Februar 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* und **
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

Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD.
9 Temasek Boulevard
13-01 Suntec Tower Two
Singapore 038989
Singapur

Alcentra Limited
160 Quesen Victoria Street
London EC4V 4LA
Vereinigtes Königreich

Newton Investment Management North America LLC* und **
One Boston Place
201 Washington Street
Boston MA 02108

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 von The McGraw-Hill Companies, Inc. und wurde für die Verwendung durch BNY Mellon Global Funds, plc lizenziert. Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wird nicht von Standard & Poor's gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben, und Standard & Poor's übernimmt keine Gewährleistungen hinsichtlich der Ratsamkeit von Anlagen in den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker.

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.

